FRANKLIN TEMPLETON

# Franklin Athena Uncorrelated Strategies UCITS Fund

**W (acc) USD: LU3047205490** | **Prêmios de risco |** Informativo Comercial em 31 Outubro, 2026

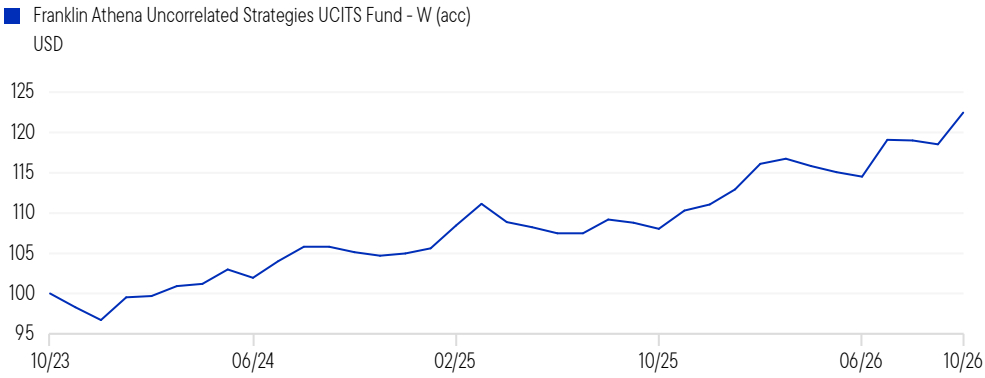
**Este é um comunicado de marketing. Consulte o prospecto do UCITS antes de tomar qualquer decisão final sobre investimentos.**

## Visão Geral de Investimento

Procura o crescimento do investimento no longo prazo, principalmente através do crescimento do capital, mantendo simultaneamente uma menor volatilidade em relação aos mercados acionistas e uma correlação substancialmente menor com as tradicionais classes de activos. O Fundo obtém exposição a várias estratégias não correlacionadas (i.e. estratégias sistemáticas de trading baseadas na análise quantitativa do preço e dados Fundamentais, através da utilização de algoritmos internos ou externos) investindo, direta ou indiretamente, através de derivados, produtos estruturados e outros Fundos, numa gama alargada de classes de ativos, tais como ações, obrigações soberanas de qualquer qualidade, matérias-primas e moedas. Estes investimentos podem ser de qualquer parte do mundo.

**O desempenho anterior não é uma previsão de resultados futuros.**

## Rendibilidade em 3 Anos em Moeda da classe de Acção (%)




## Retornos Totais (%)

| | Acumulada | | | | | | Anualizada | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 1-Mês | 3-Meses | YTD | 1-Ano | 3-Anos | 5-Anos | Início | 3-Anos | 5-Anos | Início | Date |
| W (acc) USD | 3,32 | 2,83 | 10,28 | 13,34 | 22,46 | — | 30,91 | 6,98 | — | 7,03 | 14/11/2022 |

## Retornos Anuais do Calendário (%)

| | 2025 | 2024 | 2023 | 2022 | 2021 | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| W (acc) USD | 5,80 | 8,51 | 2,07 | — | — | — | — | — | — | — |

**O valor das ações do fundo, e o rendimento obtido com as mesmas, pode diminuir ou aumentar e os investidores poderão não recuperar a totalidade do montante investido.**

As informações apresentadas sobre o desempenho são na moeda da classe de ações, incluem o reinvestimento dos dividendos brutos de impostos e são líquidos das comissões de gestão. Os encargos de vendas, impostos e outros custos aplicados localmente não foram deduzidos. Os retornos do fundo poderão aumentar ou diminuir, em resultado das taxas cambiais.
Os valores atualizados do desempenho poderão ser consultados no nosso website.
Quando a performance da carteira ou do seu índice de referência foi convertida, podem ser utilizadas as diferentes taxa de câmbio de encerramento entre a carteira e o seu índice de referência.

**A classe de ações W (acc) USD foi lançada em 08/08/2025. Dados de desempenho anteriores a essa data são para a classe de ações W (acc) USD lançada em 14/11/2022, que tinha encargos iguais ou maiores.O desempenho da classe W (acc) USD consiste no Franklin K2 Athena Uncorrelated Strategies UCITS Fund classe W (acc) USD de 14/11/2022 a 08/08/2025.**

## Informações do Fundo

| | |
|---|---|
| Umbrella | Franklin Templeton Opportunities Funds |
| Moeda base do fundo | USD |
| Data lançamento do fundo | 08/08/2025 |
| Data de Início da Classe de Ações | 08/08/2025 |
| Mínima de Investimento | EUR 1000 |
| ISIN | LU3047205490 |
| Código CUSIP | L4063Q840 |
| Bloomberg | FRAUSWA LX |
| Categoria Morningstar | Multistrategy USD |
| Categoria SFDR da UE | Artigo 6 |

## Referência(s) e Tipo

| | |
|---|---|
| ICE BofA U.S. 3-Month Treasury Bill Index | Comparador |

## Custos

| | |
|---|---|
| Carga inicial máxima | 0,00% |
| Taxa de saída | — |
| Carga contínua | 0,94% |
| Taxa de Performance | — |

Os encargos são as comissões que o fundo cobra aos investidores para cobrir os custos de operar o Fundo. Custos adicionais, incluindo comissões de transacção, também serão aplicados. Estes custos são pagos pelo Fundo, o que irá afectar o retorno total do Fundo. Os encargos do fundo serão aplicados em várias moedas, o que significa que os pagamentos podem aumentar ou diminuir como resultado das flutuações cambiais.

## Características do Fundo em 30 Setembro, 2026

| | Fundo |
|---|---|
| Valor da Cota-W (acc) USD | $12,67 |
| Total de Ativos Líquidos (USD) | $180,56 milhões |
| Número de Emitentes Short (excl. liquidez) | 383 |
| Número de Emitentes Long (excl. liquidez) | 406 |
| Desvio Padrão (3 Anos) | 4,97% |

## Strategy Contribution (% of NAV) em 30 Setembro, 2026

| | Return Contribution |
|---|---|
| Cross Asset Trend | 0,40 |
| FX Value | 0,23 |
| Equity Momentum | 0,22 |
| FX Carry | -0,03 |
| Equity Flows | -0,07 |
| Rates Multi-Style | -0,11 |
| Rates Flows | -0,29 |
| Equity Low Beta | -0,30 |
| Equity Value | -0,60 |
| Caixa | 0,31 |

## Exposições de categoria de ativo (% do NAV) em 30 Setembro, 2026

| | Exposição longa (% do NAV) | Exposição curta (% do NAV) | % da alocação de risco |
|---|---|---|---|
| das acções | 65.48 | -44.68 | 85.70 |
| Moeda | 40.89 | -33.16 | 3.18 |
| Taxa de juros | 22.55 | -39.75 | 5.92 |
| da mercadoria | 2.03 | -0.81 | 4.68 |
| Disponibilidades ou Caixa e equivalentes a caixa | | | 0.53 |

## Gestão de carteira

| | Anos com a Empresa | Anos de Experiência |
|---|---|---|
| Robert Christian | 16 | 36 |
| Brian Powers | <1 | 24 |

## Quais são os riscos?

O fundo não dá qualquer garantia ou proteção de capital pelo que poderá não recuperar o montante que investiu. O Fundo está sujeito aos seguintes riscos, que são materialmente relevantes: **Risco de Contraparte:** o risco de incumprimento das instituições financeiras ou dos agentes (quando ajam como contraparte dos contratos financeiros) de cumprir com as suas obrigações, por razões de insolvência, falência ou por outras razões. **Risco de Crédito:** o risco de perda derivado do incumprimento que poderá ocorrer caso um emitente não consiga cumprir com o pagamento do principal ou dos juros quando devido. O risco é mais elevado quando o Fundo possui valores com baixa notação, inferiores a investment-grade. **Risco de liquidez:** o risco que resulta de condições adversas de mercado que afectam a capacidade de vender os activos quando necessário. Tal risco pode ser desencadeado por (mas não limitado a) eventos inesperados, como desastres ambientais ou pandemias. Uma liquidez reduzida poderá ter um impacto negativo no preço dos ativos. **Risco de Instrumentos de Derivados:** o risco de perda num instrumento onde uma pequena alteração do valor do investimento subjacente pode ter um maior impacto no valor desse instrumento. Os derivados poderão implicar riscos de liquidez, crédito e de contraparte adicionais. "**Risco de modelo:**: Perda potencial como consequência de decisões que poderão basear-se, sobretudo, na produção de modelos internos, em resultado de erros no desenvolvimento, implementação ou utilização dos referidos modelos. A materialização do risco de modelo pode ser prejudicial ao desempenho do fundo."
Informações completas sobre os riscos de investir no Fundo estão definidas no prospeto do Fundo.

## Glossário

**Carga contínua:** O Valor de Encargos Correntes (OCF) inclui as comissões pagas à sociedade gestora, ao gestor de investimentos e ao depositário, bem como algumas outras despesas. O OCF é calculado tomando os principais custos materiais relevantes pagos ao longo do período de 12 meses indicado e dividindo-os pelos ativos líquidos médios durante o mesmo período. O OCF não inclui todas as despesas pagas pelo fundo (por exemplo, não inclui o valor pago pelo fundo pela compra e venda de valores). Para uma lista detalhada dos tipos de custos deduzidos aos ativos do fundo, solicitamos que consulte o prospeto. Para os custos anuais totais recentes, bem como cenários de desempenho hipotéticos que mostram os efeitos que os diferentes níveis de retorno poderão ter num investimento no fundo, solicitamos que consulte o KID. **Comparador:** O índice de referência é usado para comparar o desempenho do Fundo, mas não é uma restrição ao investimento do Fundo. **Desvio padrão** Uma medida do grau de variação dos retornos do fundo relativamente à média dos seus retornos anteriores. Quanto maior for o desvio padrão, maior a probabilidade (e o risco) de a rendibilidade do fundo oscilar comparativamente ao retorno médio.

## Informação de Dados do Portfólio

**Liquidez e equivalentes a liquidez:** 88,28 do total, à data de 30/09/2026. A liquidez e os equivalentes a liquidez podem contribuir para a alocação geral ao risco, mas não são tratados como activos com exposição ao risco.

## Informações importantes

**Este fundo cumpre os requisitos ao abrigo do Artigo 6 do Regulamento de Divulgação de Finanças Sustentáveis da UE (SFDR); o fundo não promove características ambientais e/ou sociais nem tem um objetivo de investimento sustentável, ao abrigo das regulamentações da UE.**

Este é um sub-fundo ("Fundo") da Franklin Templeton Opportunities Funds ("FTOF"), uma SICAV registada no Luxemburgo. A subscrição de ações do Fundo apenas poderá ser feita com base no prospeto em vigor e, quando disponível, do Documento de Informação Fundamental ao Investidor (KID), acompanhados pela versão mais recente e auditada do relatório e contas e do relatório semestral, caso publicado posteriormente. Estes documentos poderão ser obtidos no nosso sítio web www.franklintempleton.com/corporate/all-sites, ou gratuitamente junto do seu representante local da FT. Podem ainda ser solicitados através do European Facilities Service da FT, que se encontra disponível em www.eifs.lu/franklintempleton. Os documentos do fundo estão disponíveis em inglês, francês, alemão, italiano, polaco e espanhol. Adicionalmente, também está disponível o resumo dos direitos do investidor, em www.franklintempleton.lu/summary-of-investor-rights. O resumo está disponível em inglês. Os sub-fundos da FTOF são notificados para comercialização em diversos Estados-Membros da UE, ao abrigo da Diretiva UCITS. A FTOF pode terminar estas notificações relativamente a qualquer classe de acções e/ou sub-fundo em qualquer altura, utilizando o processo previsto no Artigo 93a da Directiva UCITS. Para evitar dúvidas, se tomar a decisão de investir, estará a comprar unidades/ações do Fundo e não estará a investir diretamente nos ativos subjacentes do Fundo.

Dada a variedade de opções de investimento existentes, aconselhamos que os investidores solicitem ajuda a um Assessor Financeiro.

**© Morningstar, Inc.** All rights reserved. A informação aqui contida (1) é propriedade da Morningstar e/ou dos seus fornecedores de conteúdos; (2) não poderá ser copiada ou distribuída; e (3) não são dadas garantias quanto à sua exatidão, exaustividade ou oportunidade. Nem a Morningstar nem os seus fornecedores de conteúdos poderão ser responsabilizados por quaisquer perdas ou danos que derivem da utilização desta informação.

Fonte: Os dados dos índices aqui citados são de propriedade da Intercontinental Exchange ("ICE") e/ou de seus licenciados, e foram licenciados para uso da Franklin Templeton. ICE e seus licenciados não se responsabilizam por danos causados pelo seu uso. Os índices não são manipulados e não é possível investir diretamente num índice. Não refletem quaisquer encargos de comissões, despesas ou vendas. Avisos importantes e termos do fornecedor de dados estão disponíveis no site www.franklintempletondatasources.com.

© 2026 Franklin Templeton. Todos os direitos reservados.