Franklin Templeton Investment Funds

Franklin Diversified Dynamic Fund

Multi-actifs
LU1147470923
31 janvier 2022

Reporting du fonds

Réservé aux clients professionnels. Non destiné aux clients particuliers.

Caractéristiques du compartiment

Devise de référence du compartiment	EUR
Actif net total (EUR)	157 millions
Date de création	13.02.2006
Nombre de positions	243
Indice de référence	Custom EURIBOR 3-Month + 5% Index
Fourchette de volatilité cible	8-11%
Catégorie Morningstar™	Allocation Aggressive EUR - Internationale

Résumé des objectifs d'investissement

L'objectif d'investissement du compartiment est d'obtenir une appréciation du capital à long terme, visant un rendement moyen annuel de 5 % (performance nette) selon l'Euro Interbank Offered Rate (EURIBOR) sur une période glissante de trois ans. Le compartiment cherche à atteindre son objectif avec une volatilité annualisée, dans des conditions de marché normales, entre 8 et 11 %. Rien ne garantit que le compartiment atteindra son objectif de rendement, ni qu'il restera dans la fourchette de volatilité prévue.

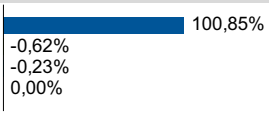
Équipe de gestion

Matthias Hoppe: Allemagne
Todd Brighton, CFA: USA

Notations - I (acc) EUR

Notation Morningstar: ★★★

Contribution aux risques sur 1 mois

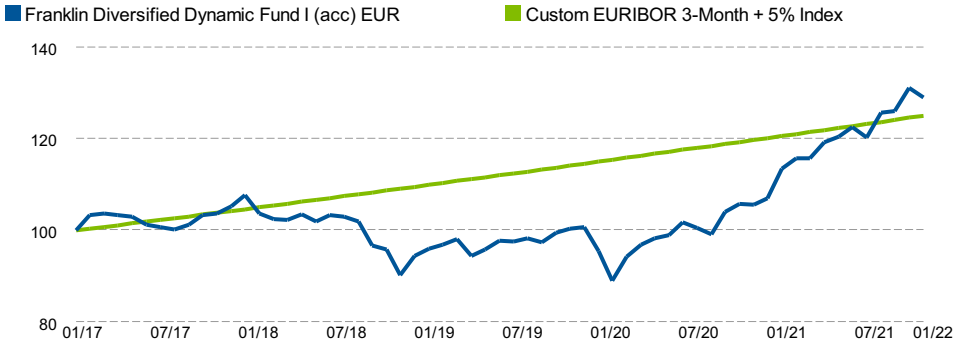


- Croissance
- Défensives
- Stables
- Couvertures de liquidités

Voir page 2 pour les définitions des catégories.

Performance

Performance sur 5 ans en devise de la part (%)



Performances annuelles glissantes en devise de la part (%)

	01/21 01/22	01/20 01/21	01/19 01/20	01/18 01/19	01/17 01/18
I (acc) EUR	22,22	4,74	6,72	-12,37	7,77
Indice de référence en EUR	4,42	4,52	4,61	4,66	4,65

Performance en devise de la part (%)

	Cumulée							
	1 mois	3 mois	YTD	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Depuis création
I (acc) EUR	-1,58	2,55	-1,58	22,22	36,61	29,02	85,66	81,02
Indice de référence en EUR	0,36	1,08	0,36	4,42	14,17	25,05	60,11	148,86

Performance par année civile en devise de la part (%)

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013	2012
I (acc) EUR	23,93	5,40	11,22	-14,34	4,68	-0,42	5,43	15,16	14,40	8,62
Indice de référence en EUR	4,42	4,54	4,62	4,66	4,65	4,71	4,98	5,15	5,16	5,42

Les performances passées ne constituent pas un indicateur ou une garantie des performances futures. Le cours des actions de la SICAV, ainsi que les revenus afférents, peuvent fluctuer à la hausse comme à la baisse, et il est possible que les investisseurs ne puissent pas récupérer l'intégralité des montants investis. Les performances affichées dans ce document sont calculées dans la devise du Compartiment, elles incluent les dividendes réinvestis et sont nettes de frais de gestion. Les droits d'entrée et autres commissions, taxes et coûts payables par un investisseur ne sont pas pris en compte dans le calcul de ces performances. En cas d'investissement dans un compartiment libellé en devise étrangère, la performance peut être affectée par des fluctuations de change. Les derniers chiffres de performances disponibles peuvent être obtenus sur notre site internet www.franklintempleton.fr.

La performance passée a été simulée. Se reporter à la section Informations Importantes à la fin de ce document pour des informations complémentaires.

Informations sur la part

				Frais		Dividendes			Identifiants du compartiment	
Part	Date de création	VL	TER (%) 31.12.2021	Droits d'entrée (max) (%)	Frais de gestion max (annuels) (%)	Fréquence	Date du dernier versement	Dernier dividende versé	Bloomberg ID	ISIN
I (acc) EUR	13.02.2006	18,10 EUR	0,87	N/A	0,60	N/A	N/A	N/A	FTSDIAE LX	LU1147470923

Adresse
55 avenue Hoche - 75008 Paris

Téléphone
01 40 73 86 00

Site Internet
www.franklintempleton.fr

Réservé aux clients professionnels. Non destiné aux clients particuliers.

Analyse du risque et du rendement du portefeuille (EUR)

Stratégies par catégorie de risque	Exposition moyenne du portefeuille (%)	1 mois Contribution à la performance (%)	1 mois Contributions prévisionnelles aux risques (%)
Croissance	**91,83**	**-1,67**	**100,85**
EQ-DM-Beta	0,75	-0,07	0,00
EQ-EM-Small Cap	0,23	-0,01	0,26
Equity-Global Equities	78,86	-1,08	96,84
Equity-Risk Reversal	5,86	-0,38	2,47
FI-DM-Credit	6,13	-0,13	1,27
Défensives	**5,99**	**0,18**	**-0,62**
Commodity-Gold	1,77	0,00	0,25
Currency-JPYTWD	-0,06	0,01	-0,36
Equity-Calendar Put Spread	-1,58	0,23	0,00
FI-Eurozone-Rates	5,68	-0,06	0,16
FI-Global-Rates	0,18	0,00	0,00
Stables	**7,76**	**-0,02**	**-0,23**
Cash and Equivalents	4,91	0,00	0,01
FI-Short-Term Credit	2,84	-0,02	0,04
UK Large vs. Small	0,01	0,01	-0,29
Couvertures de liquidités	**-5,59**	**0,00**	**0,00**

Les performances passées ne constituent ni un indicateur ni une garantie des performances futures.

Exposition moyenne du portefeuille : l'exposition économique moyenne au cours de la période pour chaque stratégie. Les chiffres présentés pour reflètent certains produits dérivés détenus dans le portefeuille (ou leurs actifs de référence sous-jacents) et peuvent ne pas atteindre 100 % au total ou être négatives en raison des arrondis, de l'utilisation de produits dérivés, de transactions non dénouées ou d'autres facteurs.

Contribution à la performance: Estime le taux de contribution de chaque position au rendement total du portefeuille. La somme de toutes les estimations peut différer du meilleur niveau de rendement officiel du portefeuille en raison de plusieurs facteurs tels que la différence entre le cours réel des titres inclus dans la performance et le cours de fin de journée utilisé dans le calcul de l'analyse.

Contributions prévisionnelles aux risques: Une répartition du risque d'investissement prévoyant la contribution proportionnelle basée sur les positions du portefeuille. Des valeurs positives indiquent une contribution en direction d'une augmentation de la volatilité du portefeuille et des valeurs négatives une contribution en direction d'une diminution de la volatilité du portefeuille.

Définitions

Croissance: les stratégies de croissance ont tendance à être corrélées positivement avec les marchés d'actions. Ces types de stratégies visent une croissance à long terme du capital provenant de marchés d'actions ou obligataires spécifiques. Ces stratégies recherchent des opportunités considérées comme ayant un bon potentiel de croissance.

Défensives: les stratégies défensives ont tendance à être corrélées négativement avec les marchés d'actions. Ces types de stratégies visent à minimiser le risque de perte du capital. Ces stratégies cherchent à protéger les investisseurs contre des pertes significatives en cas de baisse importante du marché.

Stables: les stratégies stables ont tendance à être peu corrélées, voire pas du tout, avec les marchés d'actions. Ces types de rendements visent à offrir régulièrement des rendements plus élevés que les marchés monétaires tout en prenant des risques légèrement plus élevés. Ces stratégies ne dépendent pas de la conjoncture économique, qu'elle soit forte ou faible, pour générer des rendements positifs et peuvent être un bon outil de diversification.

Couvertures de liquidités: Positions de trésorerie synthétiques qui sont créées lorsque nous utilisons des instruments financiers avec effet de levier (telles que les options et contrats à terme) pour obtenir une exposition sur le marché.

Informations supplémentaires relatives aux compartiments

Principales stratégies par exposition moyenne	Catégorie	% du total
Equity-Global Equities	Croissance	78,86
FI-DM-Credit	Croissance	6,13
Equity-Risk Reversal	Croissance	5,86
FI-Eurozone-Rates	Défensives	5,68
Cash and Equivalents	Stables	4,91
FI-Short-Term Credit	Stables	2,84
Commodity-Gold	Défensives	1,77
EQ-DM-Beta	Croissance	0,75
EQ-EM-Small Cap	Croissance	0,23
FI-Global-Rates	Défensives	0,18

Statistiques sur le compartiment	
Notation de crédit moyenne	BBB+
Duration moyenne	3,61 ans
Echéance moyenne pondérée	4,04 ans
Ecart type (3 ans)	9,32%
Ratio de Sharpe (3 ans)	1,24
Beta (3 ans) ^^	0,58

^^Mesuré par rapport au MSCI All Country World Index.

Expositions par classe d'actifs	% du total
Action	81,03
Obligations	14,85
Liquidités et équivalents	6,15
Matières premières	1,77
Investissements en devises	-0,10
Couvertures de liquidités	-3,69

Exposition géographique	% d'obligations	% du total actions	% du total
Amérique du Nord	28,25	61,03	56,04
Europe hors R-U	55,44	15,51	21,59
Asie hors Japon	4,42	7,16	6,74
Japon	N/A	7,63	6,47
Royaume-Uni	4,16	3,40	3,51
Australasie	2,65	2,27	2,32
Moyen-Orient / Afrique	0,99	0,83	0,85
Amérique Latine	4,10	0,02	0,64
Autre	N/A	2,14	1,81

Informations sur les produits dérivés détenus dans le portefeuille

Les pondérations de l'exposition moyenne du portefeuille, des principales stratégies par exposition moyenne, des expositions par classe d'actifs et de l'exposition géographique reflètent certains dérivés détenus dans le portefeuille (ou leurs actifs de référence sous-jacents) et peuvent ne pas atteindre 100 % au total ou être négatives en raison des arrondis, de l'utilisation de dérivés, de transactions non réglées ou d'autres facteurs.

Réservé aux clients professionnels. Non destiné aux clients particuliers.

Quels sont les risques principaux?

Le cours des actions du Fonds, ainsi que les revenus générés, peuvent fluctuer à la hausse comme à la baisse, et il est possible que les investisseurs ne puissent pas récupérer l'intégralité des montants investis. La performance peut aussi être affectée par les fluctuations de change. Les fluctuations de change peuvent influencer la valeur des investissements à l'étranger. Le Fonds investit directement ou indirectement (via des instruments financiers dérivés, des produits structurés ou des organismes de placement collectif) dans des actions et dans des titres à revenu fixe, des liquidités et équivalents et (indirectement uniquement) dans des investissements alternatifs (y compris des matières premières ou de l'immobilier), afin d'avoir une plus grande proportion d'actions par rapport aux autres actifs. Ces titres et instruments d'investissement ont subi par le passé des fluctuations de cours dues à des facteurs comme la volatilité générale des marchés d'actions, les fluctuations soudaines des taux d'intérêt, les modifications des perspectives financières ou de la solvabilité estimée des émetteurs de ces titres, ou les variations des prix des matières premières ou de l'immobilier. De ce fait, la performance du Fonds peut fluctuer dans le temps. Le Fonds peut distribuer des revenus bruts de frais. Si cette stratégie peut permettre la distribution de revenus plus élevés, elle peut également avoir pour effet de réduire le capital. D'autres risques significatifs comprennent : le risque de crédit, le risque de change, le risque de produits dérivés, le risque de liquidité et le risque de rendement cible.Pour des informations complètes sur tous les risques applicables à ce Fonds, veuillez vous reporter à la section « Prise en compte des risques » du prospectus actuel du fonds Franklin Templeton Investment Funds.

Informations Importantes

Depuis le 20.03.2015, tous les actifs de FTSAF–Franklin Strategic Dynamic Fund ont été transférés vers FTIF–Franklin Diversified Dynamic Fund, un sous-compartiment spécialement créé au sein de FTIF afin d'absorber les actifs de FTSAF–Franklin Strategic Dynamic Fund. Ce transfert d'actifs a permis à FTIF–Franklin Diversified Dynamic Fund de conserver les performances passées des actions correspondantes de FTSAF–Franklin Strategic Dynamic Fund depuis sa création.

Les risques inhérents aux marchés émergents peuvent être plus importants que sur les marchés développés. Investir dans des instruments dérivés comporte des risques spécifiques qui sont décrits dans le prospectus en vigueur et, s'il est disponible, dans le document d'information clé pour l'investisseur. Les fluctuations de change peuvent affecter la valeur des investissements à l'étranger. En cas d'investissement dans un compartiment libellé en devise étrangère, la performance peut être affectée par les fluctuations de change.

Informations Importantes: © 2022 Franklin Templeton. Tous droits réservés.
Toute souscription aux actions de la SICAV de droit luxembourgeois Franklin Templeton Investment Funds (la « SICAV ») ne peut être effectuée que sur la base du prospectus et des documents d'information clé pour l'investisseur (le « DICI »), et des derniers rapports périodiques de la SICAV. Le cours des actions de la SICAV, ainsi que les revenus afférents, peuvent fluctuer à la hausse comme à la baisse, et il est possible que les investisseurs ne puissent pas recouvrir l'intégralité des sommes investis. Les performances passées ne constituent pas un indicateur ou une garantie des performances futures. Les fluctuations de change peuvent affecter la valeur des investissements à l'étranger. En cas d'investissement dans un compartiment libellé en devise étrangère, la performance peut être affectée par les fluctuations de change. Investir dans les compartiments de la SICAV comporte des risques, lesquels sont décrits dans le prospectus et le DICI. Les marchés émergents peuvent être plus risqués que les marchés développés. Les investissements en instruments financiers dérivés entraînent des risques spécifiques plus amplement décrits dans le prospectus de la SICAV et le DICI. Aucune action de la SICAV ne peut être, directement ou indirectement, proposée ou vendue à des résidents des Etats Unis d'Amérique. Les éléments de recherche et d'analyse présentés dans ce document ont été fournie par Franklin Templeton pour ses besoins propres et doit être considérée comme telle. Veuillez-vous adresser à votre conseiller financier avant de prendre une décision d'investissement. Le dernier prospectus et le DICI, les derniers rapports périodiques sont disponibles sur notre site internet www.franklintempleton.fr ou peuvent être obtenus sans frais auprès de Franklin Templeton International Services S.à r.l., French branch.
Publié par Franklin Templeton International Services S.à r.l., French branch. 55 avenue Hoche - 75008 Paris, France. Le correspondent centralisateur de la SICAV de droit luxembourgeois Franklin Templeton Investment Funds en France est CACEIS Bank 1-3 Place Valhubert-75013 Paris.
Les documents du fonds sont disponibles sur www.ftidocuments.com en allemand, en anglais, en arabe, en danois, en espagnol, en estonien, en finlandais, en français, en grec, en hongrois, en islandais, en italien, en letton, en lituanien, en néerlandais, en norvégien, en polonais, en portugais, en roumain, en slovaque, en slovène, en suédois et en tchèque. Une synthèse des droits des investisseurs est également disponible sur le site www.franklintempleton.fr/Droits-des-investisseurs. Cette synthèse est disponible en anglais. Les compartiments de FTIF sont notifiés en vue de leur commercialisation dans plusieurs États membres de l'UE au titre de la Directive relative aux OPCVM. FTIF peut mettre fin à cette notification pour n'importe quelle catégorie d'actions et/ou n'importe quel compartiment à tout moment selon la procédure visée à l'article 93 bis de la Directive relative aux OPCVM.
Équipe de gestion: CFA® et Chartered Financial Analyst® sont des marques détenues par CFA Institute.
Notations: © Morningstar, Inc. Tous droits réservés. Les informations du présent document : (1) appartiennent à Morningstar et / ou ses fournisseurs de contenu ; (2) ne peuvent être reproduites ou diffusées ; (3) ne sont assorties d'aucune garantie de fiabilité, d'exhaustivité ou de pertinence. Ni Morningstar ni ses fournisseurs de contenu ne sont responsables des préjudices ou des pertes découlant de l'utilisation desdites informations.
Positions de liquidités négatives: Les positions en devises négatives, s'il elles existent, sont liées à la couverture, aux paiements dus et aux titres dérivés.
Les références faites aux indices sont exclusivement à titre de comparaison et représentent le contexte d'investissement existant pendant les périodes de temps indiquées. En cas de conversion de la performance du portefeuille ou de son indice de référence, des taux de change de clôture différents peuvent être utilisés entre le portefeuille et son indice de référence.
Données statistiques du fonds: La notation de la qualité de crédit moyenne (average credit quality ou ACQ) peut changer au fil du temps. Le portefeuille lui-même n'a pas été évalué par une agence de notation indépendante. La lettre correspondant à la notation, qui peut être basée sur les notations attribuées aux obligations par plusieurs agences, est utilisée pour indiquer la notation de crédit moyenne des obligations sous-jacentes du portefeuille et est généralement comprise entre AAA (la meilleure) et D (la plus basse). Pour les obligations non notées, les notations peuvent être attribuées sur la base des notations de l'émetteur ou de tout autre facteur pertinent. L'ACQ est déterminée en attribuant un nombre entier séquentiel à toutes les notations de crédit de AAA à D, en prenant une simple moyenne pondérée de l'endettement à sa valeur de marché et en arrondissant à la notation la plus proche. Le risque de défaut augmente au fur et à mesure que la notation d'une obligation diminue. En conséquence, l'ACQ fournie n'est pas une mesure statistique du risque de défaut du portefeuille, car une simple moyenne pondérée ne mesure pas l'augmentation du niveau de risque due aux obligations dont la notation est plus faible. L'ACQ est fournie à titre informatif seulement.