

**Fund Fact Sheet**
**Datos del Fondo**

|   |  |
|---|--|
| Divisa Base del Fondo                         | EUR                                    |
| Patrimonio (EUR)                              | 193 millones                           |
| Fecha de Lanzamiento                          | 13.02.2006                             |
| Número de Posiciones                          | 560                                    |
| Índice  | Custom EURIBOR<br>3-Month + 3.5% Index |
| Intervalo de volatilidad objetivo             | 5-8%                                   |
| Categoría Morningstar™                        | Mixtos Moderados EUR –<br>Global       |
| Rendimiento de distribución – A<br>(Ydis) EUR | 2,33%                                  |

**Resumen de los Objetivos de Inversión**

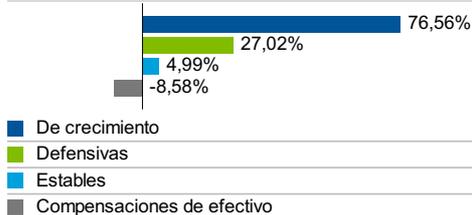
El objetivo de inversión del Fondo es lograr una combinación de rendimientos corrientes y apreciación del capital a largo plazo, con vistas a obtener una rentabilidad media anual del 3,5% (neto de comisiones) con respecto al tipo interbancario EURIBOR durante tres años consecutivos. El Fondo se propone alcanzar su objetivo con una volatilidad anualizada que oscile, en condiciones de mercado normales, entre el 5% y el 8%. No hay garantía de que el Fondo vaya a lograr su objetivo de rentabilidad ni de que podrá mantenerse dentro de la horquilla de volatilidad pretendida.

**Gestión del Fondo**

Matthias Hoppe: Alemania  
 Todd Brighton, CFA: Estados Unidos

**Ratings - A (Ydis) EUR**

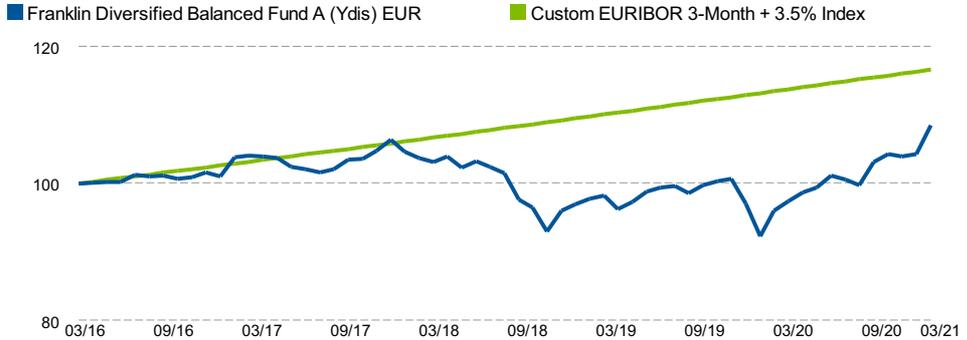
Rating Morningstar™: ★★ ★

**Exposición media de la cartera**


Consulte la página 2 para obtener las definiciones de la categoría.

**Información sobre Clases de Acciones**

| Clases de Acciones | Fecha de lanzamiento | Valor Liquidativo | TER (%) | Dividendos |                 |             | Códigos del Fondo |              |
|--------------------|----------------------|-------------------|---------|------------|-----------------|-------------|-------------------|--------------|
|                    |                      |                   |         | Frec.      | Fecha ult. pago | Último pago | Bloomberg ID      | ISIN         |
| A (Ydis) EUR       | 13.02.2006           | 12,12 EUR         | 1,60    | A          | 08.07.2020      | 0,2830      | FRSBAYE LX        | LU1147469677 |

**Rentabilidad**
**Rentabilidad a 5 años en Divisa de la Clase de Acción (%)**

**Rentabilidad Discreta Anual en Divisa de la Clase de Acción (%)**

|               | 03/20 | 03/19 | 03/18 | 03/17 | 03/16 |
|---------------|-------|-------|-------|-------|-------|
| A (Ydis) EUR  | 17,50 | -5,58 | -5,70 | -0,33 | 4,03  |
| Índice en EUR | 3,01  | 3,10  | 3,17  | 3,16  | 3,18  |

**Rentabilidad en Divisa de la Clase de Acción (%)**

|               | Acumulada |        |        |         | Desde Lanz. | Anualizada |        |         |      | Desde Lanz. |
|---------------|-----------|--------|--------|---------|-------------|------------|--------|---------|------|-------------|
|               | 1 Año     | 3 Años | 5 Años | 10 Años |             | 3 Años     | 5 Años | 10 Años |      |             |
| A (Ydis) EUR  | 17,50     | 4,61   | 8,47   | 41,76   | 42,75       | 1,51       | 1,64   | 3,55    | 2,38 |             |
| Índice en EUR | 3,01      | 9,57   | 16,62  | 40,55   | 93,03       | 3,09       | 3,12   | 3,46    | 4,44 |             |

**Rentabilidades pasadas no garantizan rentabilidades futuras. El valor liquidativo del fondo y la rentabilidad obtenida pueden sufrir oscilaciones al alza o a la baja, y los inversores pueden que no recuperen todo el capital invertido.** Todos los datos de rentabilidad mostrados se expresan en la divisa indicada e incluyen los dividendos reinvertidos, una vez descontadas las comisiones de gestión. En los cálculos no se incluyen los gastos de venta u otras comisiones, impuestos o costes pertinentes pagados por el inversor. La rentabilidad también puede verse afectada por fluctuaciones de las divisas. Las cifras de rentabilidad hasta la fecha pueden obtenerse en nuestro sitio web local.

Las referencias a índices se incluyen sólo con fines comparativos y se facilitan para representar el entorno de inversión que prevalecía durante los periodos de tiempo indicados. Una vez se ha convertido la rentabilidad para la cartera o su índice de referencia, se pueden usar tipos de cambio de cierre de divisas entre la cartera y su índice de referencia.

**La rentabilidad histórica se ha determinado mediante una simulación. Para más información, consulte la sección "Información importante" incluida al final del presente documento.**

## Análisis de riesgo/rentabilidad de la cartera (EUR)

| Estrategias por la categoría de riesgo | Exposición media de la cartera (%) | 1 Mes Contribución a la rentabilidad (%) |
|--|------------------------------------|--|
| <b>De crecimiento</b>                  | <b>76,56</b>                       | <b>4,21</b>                              |
| EQ-DM-Beta                             | 13,15                              | 0,69                                     |
| EQ-EM-Beta                             | 0,27                               | 0,00                                     |
| EQ-EM-Small Cap                        | 0,00                               | 0,00                                     |
| EQ-Global-Multi Factor                 | 42,79                              | 3,22                                     |
| Equity-Risk Reversal                   | 3,54                               | 0,26                                     |
| FI-DM-Credit                           | 14,73                              | 0,03                                     |
| FI-EM-Credit                           | 2,08                               | 0,01                                     |
| FI-EM-Rates                            | 0,00                               | 0,00                                     |
| <b>Defensivas</b>                      | <b>27,02</b>                       | <b>-0,15</b>                             |
| Cash & Other Net Assets                | -0,08                              | 0,00                                     |
| Commodity-Gold                         | 1,90                               | -0,02                                    |
| Currency-JPYEUR                        | -0,03                              | -0,02                                    |
| Currency-JPYTWD                        | -0,06                              | -0,02                                    |
| EQ-Hedging                             | -1,08                              | -0,13                                    |
| EQ-Income                              | -0,25                              | 0,04                                     |
| EQ-Tail Risk Hedging                   | 2,34                               | -0,06                                    |
| Equity-Long Volatility                 | 0,06                               | -0,02                                    |
| FI-DM-Securitized                      | 2,71                               | 0,00                                     |
| FI-Eurozone-Rates                      | 18,73                              | 0,03                                     |
| FI-Global-Rates                        | 2,80                               | 0,05                                     |
| <b>Estables</b>                        | <b>4,99</b>                        | <b>0,00</b>                              |
| Cash and Equivalents                   | 4,99                               | 0,00                                     |
| FI-Eurozone-Rates Sh. Term             | 0,00                               | 0,00                                     |
| <b>Compensaciones de efectivo</b>      | <b>-8,58</b>                       | <b>0,00</b>                              |

La rentabilidad pasado no es un indicador o una garantía de rentabilidades futuras.

**Exposición media de la cartera:** La exposición económica media durante el periodo para cada estrategia particular. Las figuras reflejan ciertos derivados de la cartera (o sus activos de referencia subyacentes) y podrían no totalizar el 100 % o podrían ser negativas debido a una aproximación, el uso de derivados, operaciones no liquidadas u otros factores.

**Contribución al rendimiento:** Estima cómo ha contribuido cada posición a la rentabilidad total de la cartera. La suma de todas las estimaciones puede ser diferente a la rentabilidad oficial de nivel superior de la cartera debido a varios factores, tales como la diferencia entre el precio del mercado real de los valores incluidos en el rendimiento y el precio al final del día usado para calcular los análisis.

## Definiciones

**De crecimiento:** Las estrategias de crecimiento suelen presentar una correlación positiva con los mercados de renta variable. Estos tipos de estrategias aspiran a ofrecer un crecimiento del capital a largo plazo generado por determinados mercados bursátiles o de renta fija. Con estas estrategias se pretende hallar oportunidades que presumiblemente albergan un alto potencial de crecimiento.

**Defensivas:** Las estrategias defensivas suelen presentar una correlación negativa con los mercados de renta variable. Estos tipos de estrategias tienen por objeto minimizar el riesgo de pérdida del principal. Con estas estrategias se pretende proteger a los inversores frente a pérdidas cuantiosas derivadas de fuertes correcciones del mercado.

**Estables:** Las estrategias estables suelen presentar una correlación escasa o nula con los mercados de renta variable. Estos tipos de estrategias tienen por objeto ofrecer rentabilidades sistemáticamente más altas que los mercados monetarios asumiendo al mismo tiempo un grado de riesgo ligeramente superior. Estas estrategias no dependen de la coyuntura económica (favorable o adversa) para generar ganancias, y pueden actuar como un buen diversificador.

**Compensaciones de efectivo:** Posiciones sintéticas de tesorería que se crean cuando utilizamos instrumentos financieros apalancados (como opciones y futuros) para obtener exposición al mercado.

**Tail Risk:** Riesgo de cola: Tipo de riesgo de cartera que surge cuando la posibilidad de que una inversión varíe más de tres veces su desviación estándar respecto a la media es superior a lo que se refleja en una distribución normal.

**Volatility:** Volatilidad: Mide el grado en que la rentabilidad de un fondo varía respecto a las rentabilidades anteriores o respecto a la rentabilidad media de todos los fondos similares. Cuanto mayor es la desviación estándar, mayor es la probabilidad (y el riesgo) de que el rendimiento del fondo fluctúe con respecto a la rentabilidad media.

## Información adicional del Fondo

## Mayores estrategias por exposición media

| Categoría              | % del Total |
|------------------------|-------------|
| EQ-Global-Multi Factor | 42,79       |
| FI-Eurozone-Rates      | 18,73       |
| FI-DM-Credit           | 14,73       |
| EQ-DM-Beta             | 13,15       |
| Cash and Equivalents   | 4,99        |
| Equity-Risk Reversal   | 3,54        |
| FI-Global-Rates        | 2,80        |
| FI-DM-Securitized      | 2,71        |
| EQ-Tail Risk Hedging   | 2,34        |
| FI-EM-Credit           | 2,08        |

## Medidas del Fondo

|                              |           |
|------------------------------|-----------|
| Rating Crediticio Medio      | A-        |
| Duración Media               | 6,36 Años |
| Vencimiento Medio Ponderado  | 7,81 Años |
| Desviación Estándar (3 Años) | 7,03%     |

## Exposiciones a clases de activos

|                            | % del Total |
|----------------------------|-------------|
| Renta Variable             | 62,88       |
| Renta Fija                 | 42,28       |
| Alternativos               | 2,32        |
| Commodity                  | 1,99        |
| Liquidez                   | 1,24        |
| Inversiones en divisas     | -0,49       |
| Compensaciones de efectivo | -10,21      |

## Exposición del área

| geográfica                  | % del Renta Fija | % De Renta Variable | % del Total |
|-----------------------------|------------------|---------------------|-------------|
| Norteamérica                | 21,31            | 60,62               | 44,99       |
| Europa menos el Reino Unido | 61,51            | 18,39               | 35,54       |
| Asia menos Japón            | 2,19             | 9,89                | 6,83        |
| Reino Unido                 | 6,85             | 2,41                | 4,18        |
| Japón                       | 0,29             | 4,87                | 3,05        |
| Australia                   | 3,13             | 1,95                | 2,42        |
| Latinoamérica               | 3,50             | 0,84                | 1,90        |
| Medio Este / África         | 1,15             | 1,03                | 1,08        |
| Otros                       | 0,07             | ND                  | 0,03        |

## Información de los derivados de los datos de la cartera

Las ponderaciones de la exposición media de la cartera, mayores estrategias por exposición media, exposición de clase de activo y exposición geográfica muestran algunos de los derivados incluidos en la cartera de valores (o los activos de referencia subyacentes) y podrían no sumar el 100% o ser negativos debido a aproximación, al uso de derivados, a operaciones no liquidadas o a otros factores.

## ¿Cuáles son los principales riesgos?

El valor de las acciones del Fondo y de los ingresos que se reciban de él pueden tanto subir como bajar, y los inversores podrían no recuperar todo el capital invertido. La rentabilidad también puede verse afectada por las fluctuaciones de la divisa. Las fluctuaciones de divisas pueden afectar al valor de las inversiones internacionales. El Fondo invierte de forma directa o indirecta (a través de instrumentos derivados financieros, productos estructurados o instituciones de inversión colectiva) en valores de renta variable y valores de renta fija, efectivo y equivalentes de efectivo y, únicamente de forma indirecta, en inversiones alternativas (incluidas las materias primas o propiedades), con el objetivo de ofrecer una exposición mixta entre valores y títulos de deuda a largo plazo. Dichos valores e instrumentos de inversión han estado históricamente sujetos a las variaciones de los precios, debido a factores como la volatilidad general del mercado de valores, los cambios repentinos en los tipos de interés, cambios en las perspectivas financieras o la solvencia crediticia de los emisores de valores o las fluctuaciones de precios en materias primas o valores inmobiliarios. Como resultado, la rentabilidad del Fondo puede fluctuar con el tiempo. El Fondo puede distribuir ingresos brutos de los gastos. Mientras que esto puede permitir que se distribuyan más ingresos, también podría causar una reducción del capital. Entre otros riesgos importantes se incluyen los siguientes: riesgo de crédito, riesgo de cambio, riesgo de derivados, riesgo de liquidez y riesgo de rentabilidad objetivo. Para obtener un análisis completo de todos los riesgos aplicables a este Fondo, consulte el apartado «Consideraciones sobre riesgos» del Fondo en el folleto actual de Franklin Templeton Investment Funds.

## Información importante

Con fecha 20.03.2015, todos los activos de FTSAF-Franklin Strategic Balanced Fund se transfirieron a FTIF-Franklin Diversified Balanced Fund, un fondo secundario creado específicamente bajo el mandato de FTIF para recibir los activos de FTSAF-Franklin Strategic Balanced Fund por medio de operaciones de fusión. Tal transferencia de activos permitió a FTIF-Franklin Diversified Balanced Fund mantener el rendimiento anterior de las acciones correspondientes de FTSAF-Franklin Strategic Balanced Fund desde su creación.

En los mercados emergentes, los riesgos pueden ser mayores que en los mercados desarrollados. Las inversiones en instrumentos derivados entrañan riesgos específicos, que se describen más detalladamente en el prospecto del Fondo y, si está disponible, en el documento de datos fundamentales para el inversor correspondiente. Las fluctuaciones de divisas pueden afectar al valor de las inversiones internacionales. Cuando se invierte en un fondo denominado en una divisa extranjera, su rentabilidad también puede verse afectada por las fluctuaciones que experimente dicha divisa.

© 2021 Franklin Templeton. Todos los derechos reservados. Emitido por Franklin Templeton International Services, S.à r.l. Franklin Templeton Investment Funds (el "Fondo") es una SICAV registrada en Luxemburgo. La fuente de los datos e información facilitados por Franklin Templeton corresponde a la que está vigente en la fecha de este documento, a menos que se indique lo contrario. El presente documento no constituye un asesoramiento jurídico o fiscal ni una recomendación de inversión u oferta para adquirir acciones del Fondo. Las suscripciones de acciones del Fondo sólo pueden realizarse a partir de la información recogida en el folleto completo o KIID vigente, acompañados del último informe anual y semestral auditados disponibles, a los que se puede acceder desde nuestro sitio web en [www.franklintempleton.com.es](http://www.franklintempleton.com.es); también pueden obtenerse, de forma gratuita, dirigiéndose a Franklin Templeton Investment Management Limited, Sucursal en España. Las acciones del Fondo no podrán ofrecerse ni venderse, directa o indirectamente, a residentes de los Estados Unidos de América. Las acciones del Fondo no se ofrecen ni distribuyen en todas las jurisdicciones, por lo que recomendamos a los inversores potenciales que consulten la disponibilidad de las mismas al representante local de Franklin Templeton antes de elaborar un plan de inversión. La inversión en el Fondo entraña riesgos, los cuales se describen en el Folleto del mismo. Algunas inversiones del Fondo puede que lleven aparejados riesgos especiales, por ejemplo, posiciones en ciertos tipos de valores, clases de activos, sectores, mercados, divisas o países, así como en el posible uso de derivados. Estos riesgos se describen con más detalle en el folleto del Fondo, el cual debe leerse con atención antes de invertir. Dentro de los requisitos normativos exigidos, el gestor del Fondo se reserva el derecho a no publicar información referente a las principales posiciones del fondo. La información es histórica y puede que no refleje las características actuales o futuras de la cartera. Todas las posiciones de las carteras son susceptibles de sufrir cambios. Publicado por Franklin Templeton Investment Management Limited, Sucursal en España - Profesional del Sector Financiero bajo la supervisión de la CNMV - José Ortega y Gasset 29, Madrid. Tel: +34 91 4263600 - Fax: +34 915771857.

Los datos relativos a índices de referencia facilitados por FactSet están actualizados hasta la fecha de este documento, a menos que se señale lo contrario.

**Datos del Fondo:** El rendimiento de distribución se basa en la distribución del mes más reciente y se muestra en porcentaje anualizado a la fecha indicada. No incluye ningún gasto preliminar y los inversores podrán tener que tributar por las distribuciones. La información es histórica y puede que no refleje las distribuciones actuales o futuras.

**Gestión del Fondo:** CFA® y Chartered Financial Analyst® son marcas comerciales propiedad de CFA Institute.

**Ratings:** © Morningstar, Inc. Todos los derechos reservados. La información contenida en este documento: (1) es propiedad de Morningstar y / o sus proveedores de contenido, (2) no puede ser copiada o distribuida y (3) no se garantiza que sea correcta, completa y oportuna. Ni Morningstar ni sus proveedores de contenidos responden de los daños o pérdidas derivados de cualquier uso de esta información.

**Información importante (continuación)**

**Medidas del Fondo:** La calificación de calidad crediticia media puede variar con el paso del tiempo. La cartera no ha sido calificada por una agencia independiente. La calificación, que puede basarse en calificaciones de bonos de diferentes agencias (o calificaciones internas para bonos sin calificar, efectivo y equivalentes), se facilita para indicar la calificación crediticia media de las inversiones subyacentes mantenidas por el fondo y, normalmente, varía desde AAA (máxima) a D (mínima). Para los bonos sin calificar, efectivo y equivalentes se pueden asignar calificaciones según las calificaciones del emisor, las calificaciones de las posiciones subyacentes de un vehículo de inversión colectiva u otros factores relevantes. La calidad crediticia media se determina a través de la asignación de un número entero secuencial a todas las calificaciones crediticias desde AAA a D, tomando una media ponderada simple de la inversiones según el valor del mercado y redondeándola a la categoría más cercana. El riesgo de incumplimiento aumenta a medida que la calificación disminuye, por lo que la calificación de calidad crediticia media no es una medición estadística del riesgo de incumplimiento de la cartera, ya que una media ponderada simple no mide el mayor nivel de riesgo de los bonos con una calificación menor. La calidad crediticia media puede ser inferior si el efectivo y los equivalentes se excluyen del cálculo. La calificación de calidad crediticia media solo se facilita a título informativo. No se reflejan las posiciones en derivados.