

PRINCIPAIS CARACTERÍSTICAS

Início do Fundo: 23 de dezembro de 1998
Tipo ANBIMA: Ações Livre
Índice de Referência: Ibovespa
Taxa de Administração: 2,00% a.a.
Taxa de Administração Máxima: 2,30% a.a.
Taxa de Performance: 20% sobre o que exceder o Ibovespa
Investimento Inicial Mínimo: R\$ 5.000,00
Movimentação Mínima: R\$ 1.000,00
Saldo Mínimo: R\$ 1.000,00
Público Alvo: Investidores em geral

Gestor: Franklin Templeton Investimentos (Brasil) Ltda.
Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A.
Custodiante: BNY Mellon Banco S.A.

Cota de Aplicação: D+1
Cota de Resgate: D+1
Liquidação: D+3 subsequente à ordem de resgate
Carência: Não há
Tributação: 15% sobre o ganho nominal recolhido no momento do resgate

Classificação Morningstar®: ★★★★★

OBJETIVO DO INVESTIMENTO

Propiciar ganhos de capital de longo prazo, focando investimentos em empresas subavaliadas pelo mercado, com qualidades operacionais não reconhecidas, considerando-se sua administração, ativos e práticas de governança corporativa.

ESTRATÉGIA DE INVESTIMENTO

O processo de investimento é rigoroso e leva em conta critérios qualitativos e quantitativos. A qualidade das informações financeiras, histórico do grupo controlador, demanda setorial, competitividade internacional e liquidez da ação são alguns dos muitos pontos que consideramos em nossas análises. Cada analista é responsável por um grupo de ações e, nas reuniões semanais, apresentam suas ideias de investimento, que são debatidas pela equipe de gestão dos fundos. As decisões de investimento são determinadas pelos mandatos específicos de cada fundo e conseqüentemente por suas restrições legais, variáveis de liquidez e condições de mercado.

Código ANBIMA: 61311
Conta Cetip: 02.53.9.00.5
ISIN: BRTLPTCTF011

DADOS BANCÁRIOS

Favorecido: Franklin Valor e Liquidez FVL FIC FIA
CNPJ: 02.895.694/0001-06
Banco: BNY Mellon Banco (017)
Agência: 001
Conta Corrente: 3162-3

DADOS PATRIMONIAIS

Cota: 3876,61428949
 Patrimônio Líquido: R\$ 283.013.324,06
 Patrimônio Líquido Médio¹: R\$ 348.906.205,98

Rentabilidade (%)	No Ano	12 Meses	2019	2018	2017	2016	2015	Desde o Início
Franklin FVL FIC FIA	-14,33	-8,29	34,10	15,28	32,97	36,47	-9,62	5119,43
Ibovespa	-5,84	0,61	31,58	15,03	26,86	38,94	-13,31	1418,10
Prêmio sobre o Ibovespa	-8,49	-8,90	2,51	0,25	6,11	-2,46	3,70	3701,33

Rentabilidade - Últimos 12 Meses (%)	nov/20	out/20	set/20	ago/20	jul/20	jun/20	mai/20	abr/20	mar/20	fev/20	jan/20	dez/19
Franklin FVL FIC FIA	10,28	-0,91	-4,50	-3,69	8,45	7,22	6,84	10,51	-31,99	-8,72	0,01	7,05
Ibovespa	15,90	-0,69	-4,80	-3,44	8,27	8,76	8,57	10,25	-29,90	-8,43	-1,63	6,85
Prêmio sobre o Ibovespa	-5,63	-0,22	0,30	-0,25	0,18	-1,54	-1,72	0,26	-2,09	-0,29	1,64	0,20

Rentabilidade passada não é garantia de rendimentos futuros

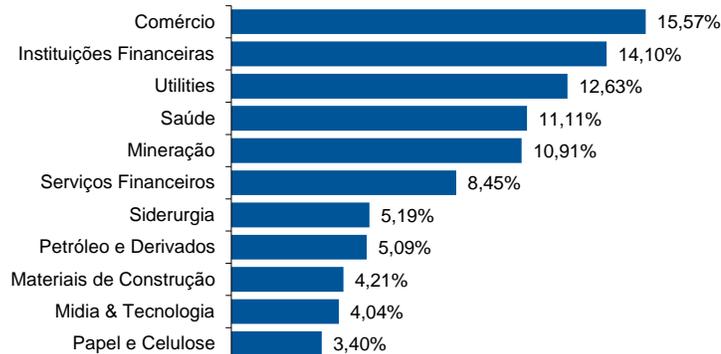
Rentabilidade Acumulada (%)

(desde o início do fundo)

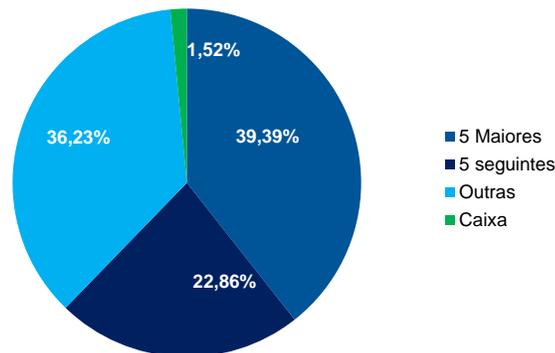


Distribuição Setorial

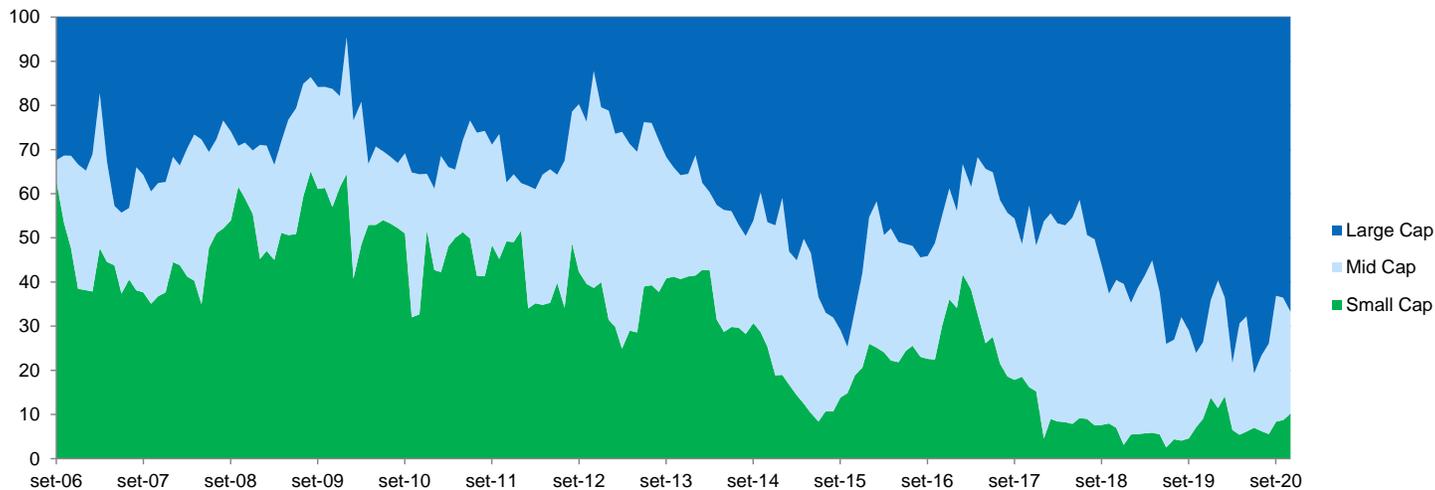
Em 30 de Novembro de 2020



Principais Investimentos - Concentração da Carteira (%)



Alocação por Capitalização de Mercado



Análise de Eficiência

Desde o início

Estatística	Acima do Ibovespa	Abaixo do Ibovespa	Total	Hit Rate (%)	Average Excess
Mercado de Alta	51	97	148	34,46%	-2,21%
Mercado de baixa	102	13	115	88,70%	3,49%
Total	153	110	263	58,17%	0,28%
Average Excess	3,24%	-3,83%			

Fonte: Franklin Templeton

Análise Estatística

Estatística	1 Ano	3 Anos	5 Anos
Volatilidade (anual)	42,72	28,8	24,99
Information Ratio	-1,47	-0,4	-0,09
Tracking Error	9,26	7,38	8,21
Jensen's Alpha (%)	-11,05	-2,35	0,9
Beta	1,01	1	0,93

Fonte: Economática

O Fundo Franklin Valor e Liqueidez FVL FIC FIA (Classificação Anbima: Ações Livre) utiliza estratégias que podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus cotistas. Descrição do tipo ANBIMA disponível no formulário de informações complementares. Em função da sua estratégia o Fundo pode ter significativa concentração em poucos ativos. A conversão de cotas se dá em data diferente do resgate. O Fundo paga resgate em data diferente do pedido de resgate. O conteúdo dos cálculos não está isento de eventuais erros de aproximações. Hit Rate é o percentual das vezes que o fundo superou o benchmark no Mercado de Alta e/ou no Mercado de Baixa. O Tracking Error é o desvio padrão da diferença entre o retorno do fundo e o do benchmark. Alfa é o prêmio sobre o benchmark. O Information Ratio do fundo é a razão entre o Alfa e o Tracking Error do fundo. O Beta é a sensibilidade da rentabilidade do fundo em relação ao seu benchmark. Jensen's Alfa é a medida da habilidade do gestor da carteira em gerar um retorno maior que o esperado baseado na sensibilidade da carteira para o mercado. Administrador: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A. Av. Presidente Wilson, nº 231, 11º andar – Rio de Janeiro, RJ (21-3219-2500) - www.bnymellon.com.br/sf. 1. Patrimônio Líquido Médio refere-se aos últimos 12 meses. Referências ao índice são feitas somente para comparação. Um índice não é gerido, portanto não se pode investir diretamente num índice. Material Publicitário.

*Em outubro de 2020. A metodologia da classificação Morningstar pode ser encontrada em <http://www.morningstarbr.com/br/funds/help/methodology.aspx>. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO – FGC. LEIA O FORMULÁRIO DE INFORMAÇÕES COMPLEMENTARES, A LÂMINA DE INFORMAÇÕES ESSENCIAIS E O REGULAMENTO ANTES DE INVESTIR EM FUNDOS. RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA.

A lâmina de informações essenciais e o regulamento podem ser encontrados no endereço: www.bnymellon.com.br/sf. Material publicitário.

Franklin Templeton Investimentos (Brasil) Ltda. não realiza a distribuição ou venda de quotas dos Fundos. Se você tiver qualquer dúvida sobre a forma de aquisição de cotas, procure um distribuidor habilitado. Este material é meramente informativo e não deve ser considerado como recomendação de investimento ou oferta para a aquisição de cotas de fundos ou outros investimentos, nem deve servir como única base para tomada de decisões de investimento. Opiniões aqui expressas são dos gestores de investimento e podem mudar a qualquer momento.

© 2020 Franklin Templeton. Todos os direitos reservados.

