

# TCW Funds - TCW Emerging Markets Income Fund AEHE

## Categoria Morningstar™

Obbligazionari Paesi Emergenti EUR

## Benchmark Morningstar

Morningstar Emerging Markets Sovereign Bond GR Hedged EUR  
Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

JPM ESG EMBI Global Diversified TR EUR

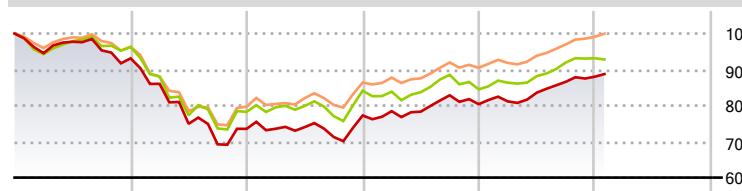
## Morningstar Rating™

★

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund seeks high total return provided by current income and capital appreciation by investing mainly in fixed income securities and instruments giving exposure to emerging markets. To achieve this objective, the Sub-Fund invests (except when maintaining a temporary defensive position) directly at least 80% of its net assets in bonds (including Rule 144A securities) and money market instruments issued by governments of Emerging Market Countries, their public local authorities and/or companies of Emerging Market Countries, and in derivative instruments that provide investment exposure to such securities.

### Rendimenti



2021 2022 2023 2024 2025 2026-01

|       | Fondo  | Bmk  | Cat  |       | Q1    | Q2 | Q3 | Q4 |
|-------|--------|------|------|-------|-------|----|----|----|
| -6,90 | -21,01 | 5,04 | 4,06 | 9,49  | 0,83  |    |    |    |
| -3,71 | -18,74 | 7,53 | 0,43 | 10,22 | -0,37 |    |    |    |
| -3,50 | -17,21 | 8,51 | 4,91 | 9,89  | 0,85  |    |    |    |

### Misure di Rischio

|                   |       |                 |      |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | 0,69  | 3Y Sharpe Ratio | 0,40 |
| 3Y Beta           | 0,90  | 3Y Std Dev      | 6,65 |
| 3Y R-Squared      | 92,55 | 3Y Risk         | Med  |
| 3Y Info Ratio     | 0,27  | 5Y Risk         | Med  |
| 3Y Tracking Error | 1,95  | 10Y Risk        | +Med |

Basati su Morningstar Emerging Markets Sovereign Bond GR Hedged EUR (dove applicabile)

### Rend. Cumulati %

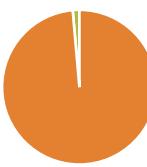
|                | Fondo | Bmk   | Cat   |
|----------------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi         | 1,16  | -0,24 | 2,15  |
| 6-Mesi         | 4,93  | 4,22  | 6,33  |
| 1-Anno         | 9,09  | 8,88  | 10,33 |
| 3-Anni Ann.ti  | 5,20  | 4,58  | 6,88  |
| 5-Anni Ann.ti  | -2,14 | -1,23 | 0,42  |
| 10-Anni Ann.ti | 1,04  | 1,46  | 2,23  |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2026

### Rendimenti Trimestrali %

|      | Q1    | Q2     | Q3    | Q4    |
|------|-------|--------|-------|-------|
| 2026 | -     | -      | -     | -     |
| 2025 | 0,97  | 2,98   | 3,62  | 1,63  |
| 2024 | 1,55  | -0,17  | 5,79  | -2,97 |
| 2023 | 0,02  | 0,62   | -3,70 | 8,38  |
| 2022 | -7,60 | -12,90 | -7,61 | 6,23  |

### Portafoglio 31/12/2025



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| • Azioni           | 0,00  |
| • Obbligazioni     | 98,61 |
| • Liquidità        | 1,39  |
| • Altro            | 0,00  |

### Fixed Income Style

| Box™  | Duration Effettiva    | Fondo |
|-------|-----------------------|-------|
|       | Maturity effettiva    | 6,19  |
|       | Qualità Credito Media | 9,86  |
| Alto  |                       | BB    |
| Med   |                       |       |
| Basso |                       |       |

Sensibilità ai Tassi

### Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| Saudi Arabia (Kingdom of)...                | —       | 5,40  |
| Melco Resorts Finance...                    | —       | 2,31  |
| Poland (Republic of) 5,5%                   | —       | 2,29  |
| Romania (Republic Of) 6,375%                | —       | 2,26  |
| Egypt (Arab Republic of) 0%                 | —       | 2,26  |
| Port of Spain Waterfront...                 | —       | 2,03  |
| Turk Telekomunikasyon A.S....               | —       | 2,00  |
| Uruguay (Republic Of) 4,975%                | —       | 1,95  |
| EnfraGen Energia Sur S A...                 | —       | 1,88  |
| Istanbul Buyuksehir...                      | —       | 1,87  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 24,25 |
| Numeri Complessivo di Titoli Azionari       | 0       |       |
| Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari | 123     |       |

### Fixed Income Sector Weightings %

|                          | Fondo |
|--------------------------|-------|
| Governativo              | 75,07 |
| Societario               | 23,54 |
| Cartolarizzazioni        | 0,00  |
| Enti Locali              | 0,00  |
| Liquidità ed equivalenti | 1,42  |
| Derivati                 | -0,03 |

### Coupon Range %

|                   | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon          | 4,22  |
| Da 0 a 4 cedole   | 12,10 |
| Da 4 a 6 cedole   | 28,02 |
| Da 6 a 8 cedole   | 42,80 |
| Da 8 a 10 cedole  | 9,41  |
| Da 10 a 12 cedole | 3,47  |
| Oltre 12 cedole   | 0,00  |

### Scadenze %

|            | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3   | 7,62  |
| da 3 a 5   | 7,27  |
| da 5 a 7   | 17,38 |
| da 7 a 10  | 31,20 |
| da 10 a 15 | 12,40 |
| da 15 a 20 | 5,38  |
| da 20 a 30 | 15,38 |
| oltre 30   | 1,03  |

### Anagrafica

|                        |                                  |   |              |                              |       |
|------------------------|----------------------------------|---|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione    | TCW Investment Management Co LLC | Patrimonio Classe (Mln)<br>(03/02/2026) | 0,46 EUR     | Investimento Min. Ingresso   | 1 EUR |
| Telefono               | -                                | Domicilio                               | LUSSEMBURGO  | Investimento Min. Successivo | -     |
| Web                    | -                                | Valuta del Fondo                        | EUR          | T.E.R.                       | 1,85% |
| Data di Partenza       | 30/12/2011                       | UCITS                                   |              | Spese correnti               | 1,69% |
| Nome del Gestore       | -                                | Inc/Acc                                 | Acc          | Commissione di incentivo     | -     |
| Data Inizio Gestione   | 01/07/2017                       | ISIN                                    | LU0726519019 |                              |       |
| NAV (03/02/2026)       | EUR 117,99                       |   |              |                              |       |
| Patrimonio Netto (Mln) | 29,58 USD                        |   |              |                              |       |
| (31/12/2025)           |                                  |   |              |                              |       |