

# TCW Funds - TCW Emerging Markets Sustainable Income Fund AE

**Categoria Morningstar™**  
Obbligazionari Paesi Emergenti

**Benchmark Morningstar**  
Morningstar Emerging Markets Sovereign  
Bond GR USD  
Usato nel Report

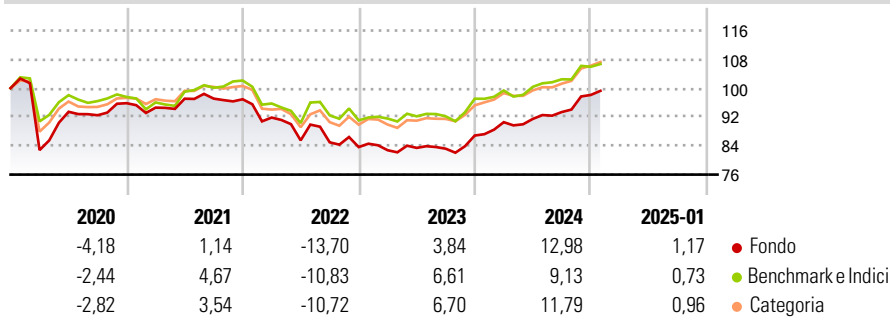
**Benchmark Dichiarato**  
JPM ESG EMBI Global Diversified TR EUR

**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 through a sustainable investment framework, including the reduction of the Sub-Fund's carbon intensity relative to the Emerging Market corporate and quasi-sovereign market.

## Rendimenti



## Misure di Rischio

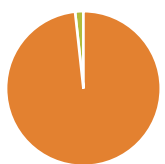
|                   |       |                 |       |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha          | -0,88 | 3Y Sharpe Ratio | -0,10 |
| 3Y Beta           | 0,97  | 3Y Std Dev      | 7,89  |
| 3Y R-Squared      | 96,43 | 3Y Risk         | Med   |
| 3Y Info Ratio     | -0,36 | 5Y Risk         | +Med  |
| 3Y Tracking Error | 2,06  | 10Y Risk        | Med   |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk  | Cat   | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|------------------|-------|------|-------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi           | 6,49  | 5,03 | 6,67  | 2025                     | -     | -     | -     | -     |
| 6-Mesi           | 8,40  | 5,68 | 8,66  | 2025                     | -     | -     | -     | -     |
| 1-Anno           | 13,43 | 9,54 | 12,69 | 2024                     | 4,27  | 0,99  | 2,10  | 5,08  |
| 3-Anni Ann.ti    | 2,12  | 2,99 | 4,52  | 2023                     | -1,05 | 0,79  | -0,27 | 4,39  |
| 5-Anni Ann.ti    | -0,72 | 0,68 | 1,73  | 2022                     | -5,24 | -6,89 | -0,63 | -1,56 |
| 10-Anni Ann.ti   | 2,69  | 3,48 | 3,56  | 2021                     | -1,28 | 2,61  | 0,02  | -0,18 |

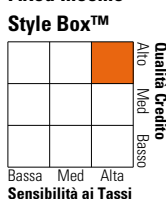
Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

## Portafoglio 31/12/2024



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| Azioni             | 0,00  |
| Obbligazioni       | 98,27 |
| Liquidità          | 1,73  |
| Altro              | 0,00  |

## Fixed Income Style Box™



|                       |       |
|-----------------------|-------|
| Duration Effettiva    | 7,00  |
| Maturità effettiva    | 11,62 |
| Qualità Credito Media | AA    |

| Credit Quality % | Fond  | Credit Quality % | Fond |
|------------------|-------|------------------|------|
| AAA              | 97,45 | BBB              | 0,89 |
| AA               | 0,09  | BB               | 0,85 |
| A                | 0,09  | B                | 0,33 |
|                  |       | Below B          | 0,30 |
|                  |       | Not Rated        | 0,00 |

## Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| India Green Power Holdings 4%               | —       | 2,84  |
| TAV Havalimanlari Holding AS...             | —       | 2,53  |
| Ukraine (Republic of) 7.75%                 | —       | 2,39  |
| BBVA Bancomer SA 5.125%                     | —       | 2,36  |
| Greenko Power II Limited 4.3%               | —       | 2,30  |
| Uruguay (Republic Of) 4.975%                | —       | 2,14  |
| Bothe Windfarm Development...               | —       | 1,99  |
| MVM Energetika Zartkoruen...                | —       | 1,71  |
| Gabonese (Republic of) 6.625%               | —       | 1,60  |
| Argentina (Republic Of) 5%                  | —       | 1,55  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 21,41 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 138   |

## Fixed Income Sector Weightings %

|                            | Fondo |
|----------------------------|-------|
| 🏛️ Governativo             | 72,56 |
| 🏠 Societario               | 25,70 |
| 🏢 Cartolarizzazioni        | 0,00  |
| 🏘️ Enti Locali             | 0,00  |
| 🏦 Liquidità ed equivalenti | 1,64  |
| 📄 Derivati                 | 0,09  |

| Coupon Range %    | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon          | 3,65  |
| Da 0 a 4 cedole   | 11,98 |
| Da 4 a 6 cedole   | 35,10 |
| Da 6 a 8 cedole   | 37,27 |
| Da 8 a 10 cedole  | 9,12  |
| Da 10 a 12 cedole | 1,80  |
| Oltre 12 cedole   | 1,07  |

## Scadenze %

|            | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3   | 4,50  |
| da 3 a 5   | 17,58 |
| da 5 a 7   | 11,46 |
| da 7 a 10  | 26,20 |
| da 10 a 15 | 9,54  |
| da 15 a 20 | 5,32  |
| da 20 a 30 | 21,19 |
| oltre 30   | 4,20  |

## Anagrafica

|                        |                                  |                         |              |                              |       |
|------------------------|----------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione    | TCW Investment Management Co LLC | Patrimonio Classe (Mln) | 2,05 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                   | Si           | Spese correnti               | 1,69% |
| Nome del Gestore       | -                                | Inc/Acc                 | Acc          | Commissione di incentivo     | -     |
| Data Inizio Gestione   | 01/07/2017                       | ISIN                    | LU0726518805 |                              |       |
| NAV (04/02/2025)       | EUR 166,34                       |                         |              |                              |       |
| Patrimonio Netto (Mln) | 40,65 USD                        |                         |              |                              |       |

(31/12/2024)