

# Schroder International Selection Fund Alternative Securitised Income IZ

Categoria Morningstar™  
**Accumulation USD**

Benchmark Morningstar  
Not Categorized  
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato  
50% JP CLOIE TR USD, 50% ICE BofA CABS  
TR USD

Morningstar Rating™  
Senza rating

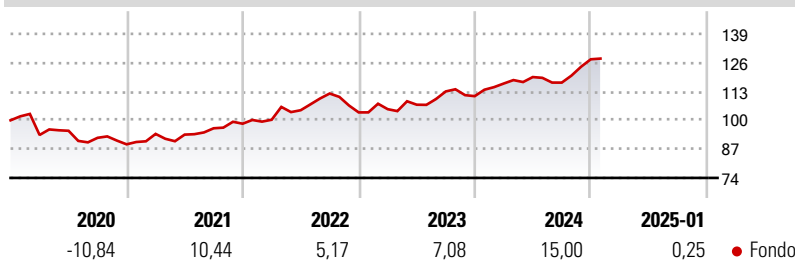
## Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Fund aims to provide income and capital growth of ICE BofA 3 Month US Treasury Bill Index +3.5% before fees have been deducted\* over a three to five year period by investing in securitised assets issued by entities worldwide. The Fund is actively managed and invests at least two-thirds of its assets in fixed and floating rate securitised investments including, but not limited to, asset-backed securities (ABS), agency and non-agency residential mortgage-backed securities (MBS) including forward-settling securities such as to be announced (TBA) trades, commercial mortgage-backed securities (CMBS), collateralised loan obligations (CLOs) and credit risk transfer securities (CRTs). Underlying assets of the asset-backed securities may...

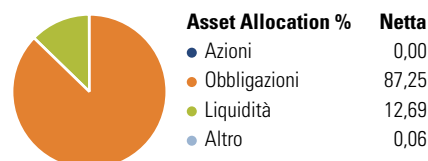
## Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,80
3Y Beta	-	3Y Std Dev	7,62
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

## Rendimenti



## Portafoglio 31/12/2024



## Rend. Cumulati %

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	6,97
6-Mesi	8,50
1-Anno	11,52
3-Anni Ann.ti	9,27
5-Anni Ann.ti	4,61
10-Anni Ann.ti	-

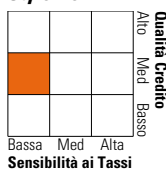
Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

## Rendimenti

Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
<b>Trimestrali %</b>				
2025	-	-	-	-
2024	5,14	2,49	-2,09	9,00
2023	1,40	1,93	5,58	-1,88
2022	1,81	4,29	7,20	-7,60
2021	5,26	-0,34	3,05	2,15

## Fixed Income

### Style Box™



Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva	Fondo
0,49	
Maturità effettiva	Fondo
15,68	
Qualità Credito Media	Fondo
A	

## Credit Quality %

Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
AAA	42,96	BBB	36,26
AA	8,50	BB	0,00
A	12,19	B	0,00
		Below B	0,10
		Not Rated	0,00

## Titoli principali

Nome	Settore	%
Government National Mortgage...	-	3,25
United States Treasury Bills...	-	2,13
Schroder GAIA Cat Bond I Acc...	-	2,13
BELLEMEADE RE 2022-2 LTD...	-	1,60
Government National Mortgage...	-	1,50
United States Treasury Bills...	-	1,50
Saluda Grade Alternative Mtg...	-	1,32
HOME RE 2023-1 LTD 9.1601%	-	1,30
Perpetual Limited As Trustee...	-	1,29
EAGLE RE 2023-1 LTD 8.5101%	-	1,28
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		17,30
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		235

## Fixed Income Sector Weightings %

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	-2,66
Societario	6,34
Cartolarizzazioni	87,04
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	7,58
Derivati	1,70

## Coupon Range %

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	11,95
Da 0 a 4 cedole	5,85
Da 4 a 6 cedole	25,01
Da 6 a 8 cedole	24,47
Da 8 a 10 cedole	20,84
Da 10 a 12 cedole	7,63
Oltre 12 cedole	4,24

## Scadenze %

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	4,29
da 3 a 5	5,58
da 5 a 7	5,93
da 7 a 10	23,42
da 10 a 15	16,17
da 15 a 20	6,18
da 20 a 30	25,15
oltre 30	12,68

## Anagrafica

Società di Gestione	Schroder Investment Management (Europe) S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	10,67 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000.000 EUR
Telefono	+352 341 342 202	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	20.000.000 USD
Web	www.schroders.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	0,55%
Data di Partenza	17/12/2019	UCITS	Si	Spese correnti	0,54%
Nome del Gestore	Michelle Russell-Dowe	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	0,00%
Data Inizio Gestione	17/12/2019	ISIN	LU2084127286		
NAV (04/02/2025)	USD 118,44				
Patrimonio Netto (Mln)	1.030,50 USD				

(31/12/2024)

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotte; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

MORNINGSTAR®