

# Schroder International Selection Fund Alternative Securitised Income C

Categoria Morningstar™

**Accumulation EUR Hedged**

Benchmark Morningstar

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

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

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

TR USD

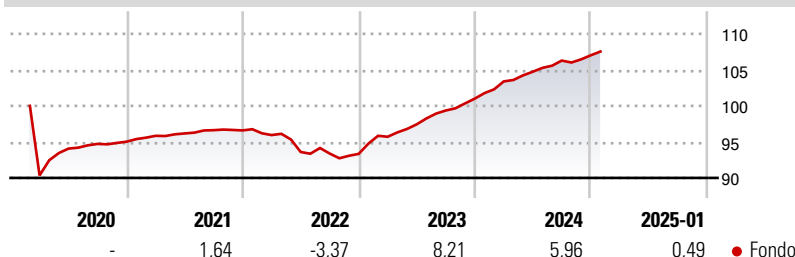
Morningstar Rating™

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...

## Rendimenti



## Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,62
3Y Beta	-	3Y Std Dev	2,25
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

## Rend. Cumulati %

Periodo	Rend. Cumulati %
3-Mesi	1,45
6-Mesi	2,20
1-Anno	5,34
3-Anni Ann.ti	3,58
5-Anni Ann.ti	1,47
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

## Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	2,37	1,30	1,48	0,69
2023	2,55	1,80	1,97	1,66
2022	-0,66	-2,45	-0,23	-0,05
2021	0,86	0,34	0,47	-0,04

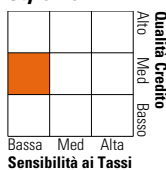
## Portafoglio 31/12/2024



Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	87,25
Liquidità	12,69
Altro	0,06

## Fixed Income

### Style Box™



Sensibilità ai Tassi

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

## Credit Quality %

Qualità Credito	Fondo	Qualità Credito	Fondo
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 %

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

## Coupon Range %

Intervallo	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 %

Intervallo	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)	0,06 USD	Investimento Min. Ingresso	1.000 EUR
Telefono	+352 341 342 202	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	1.000 USD
Web	www.schroders.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,66%
Data di Partenza	04/02/2020	UCITS	Si	Spese correnti	0,67%
Nome del Gestore	Michelle Russell-Dowe	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	0,00%
Data Inizio Gestione	17/12/2019	ISIN	LU2107321015		
NAV (04/02/2025)	EUR 107,55				
Patrimonio Netto (Mln)	1.030,50 USD				

(31/12/2024)