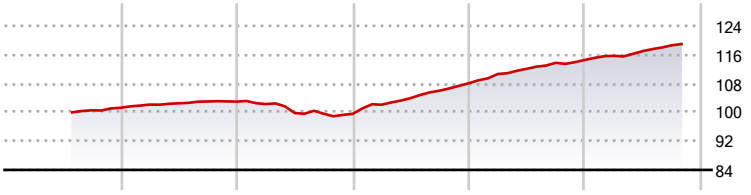
Schroder International Selection Fund Alternative Securitised Income K1 Accumulation EUR Hedged

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
[illegible]	[illegible] Usato nel Report	50% ICE BofA US ABS & CMBS TR USD, 50% JPM CLO TR USD	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



2020	2021	2022	2023	2024	2025-10	
-	1,68	-3,31	8,54	6,00	3,86	● Fondo

Misure di Rischio

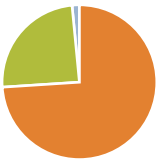
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	2,74
3Y Beta	-	3Y Std Dev	1,18
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	1,31
6-Mesi	2,98
1-Anno	4,86
3-Anni Ann.ti	6,54
5-Anni Ann.ti	3,42
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 03/11/2025

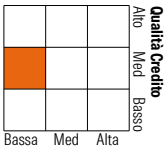
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	0,99	1,13	1,38	-
2024	2,38	1,31	1,49	0,70
2023	2,56	1,81	1,98	1,93
2022	-0,66	-2,42	-0,21	-0,04
2021	0,87	0,35	0,48	-0,03

Portafoglio 30/09/2025



Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	73,97
Liquidità	24,50
Altro	1,53

Fixed Income Style Box™



	Fondo
Duration Effettiva	0,22
Maturity effettiva	15,04
Qualità Credito Media	BBB

Credit Quality %	Fondo	Credit Quality %	Fondo
AAA	23,81	BBB	36,18
AA	8,78	BB	14,71
A	8,12	B	8,36
		Below B	0,04
		Not Rated	0,00

Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Bills...	—	3,27
United States Treasury Bills...	—	2,70
Government National Mortgage...	—	2,17
Government National Mortgage...	—	1,74
United States Treasury Bills...	—	1,58
Federal National Mortgage...	—	1,56
Schroder GAIA Cat Bond I Acc...	—	1,53
United States Treasury Bills...	—	1,26
HOME RE 2023-1 LTD 8.956%	—	1,19
EAGLE RE 2021-2 LTD 9.356%	—	1,19
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		18,18
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		294

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	-2,84
Societario	4,26
Cartolarizzazioni	83,93
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	14,65
Derivati	-0,01

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	14,77
Da 0 a 4 cedole	7,61
Da 4 a 6 cedole	33,38
Da 6 a 8 cedole	21,70
Da 8 a 10 cedole	18,01
Da 10 a 12 cedole	3,59
Oltre 12 cedole	0,94

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	0,00
da 3 a 5	3,98
da 5 a 7	4,10
da 7 a 10	16,48
da 10 a 15	29,97
da 15 a 20	7,14
da 20 a 30	30,52
oltre 30	6,32

Anagrafica

Società di Gestione	Schroder Investment Management (Europe) S.A.
Telefono	+352 341 342 202
Web	www.schroders.com
Data di Partenza	08/07/2020
Nome del Gestore	Michelle Russell-Dowe
Data Inizio Gestione	17/12/2019
NAV (03/11/2025)	EUR 119,14
Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2025)	1.549,45 USD

Patrimonio Classe (Mln) (03/11/2025)	1,37 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2196479997

Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,63%
Spese correnti	0,63%
Commissione di incentivo	0,00%

© 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 prodotto; (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.