

TCW Funds - TCW Global Securitised Fund AEHE

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Altro

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Bloomberg US Treasury Bill 1-3 M TR USD

Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund seeks to achieve above average total return consistent with prudent investment management over a full market cycle. To achieve this objective, the Sub-Fund invests (except when maintaining a temporary defensive position) at least 65% of its net assets in residential mortgage-backed securities, commercial mortgage-backed securities and other asset-backed securities and in derivative instruments that provide investment exposure to such securities. The Sub-Fund investments may have interest rates that are fixed, variable or floating. The Sub-Fund may invest in securities denominated in any currency and the Investment Manager intends to hedge any non-USD denominated instruments back into USD.

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,51
3Y Beta	-	3Y Std Dev	3,88
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	0,73
6-Mesi	1,12
1-Anno	3,24
3-Anni Ann.ti	0,44
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	0,14	0,24	2,76	-0,14
2023	1,58	-0,26	-1,86	4,32
2022	-	-1,82	-1,28	-0,61
2021	-	-	-	-

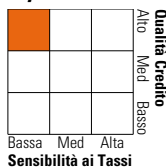
Portafoglio 31/12/2024



Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	104,81
● Liquidità	-4,81
● Altro	0,00

Fixed Income

Style Box™



Duration Effettiva	1,62
Maturità effettiva	4,89
Qualità Credito Media	AAA

Credit Quality %

Fond	Credit Quality %	Fond	
0	0	0	
AAA	99,58	BBB	0,06
AA	0,22	BB	0,03
A	0,08	B	0,00
		Below B	0,03
		Not Rated	0,00

Titoli principali

Nome	Settore	%
Government National Mortgage...	-	2,73
Government National Mortgage...	-	2,17
Government National Mortgage...	-	1,56
Government National Mortgage...	-	1,55
Government National Mortgage...	-	1,46
Federal Home Loan Mortgage...	-	1,40
Federal Home Loan Mortgage...	-	1,31
Contego Clo XIII Designated...	-	1,06
Government National Mortgage...	-	1,05
Federal Home Loan Mortgage...	-	1,05
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		15,35
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		344

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
🏛️ Governativo	0,00
⚙️ Societario	0,73
🏠 Cartolarizzazioni	104,08
🏢 Enti Locali	0,00
🏦 Liquidità ed equivalenti	-6,31
📄 Derivati	1,51

Coupon Range %

Intervallo	Fondo
0 coupon	2,80
Da 0 a 4 cedole	28,48
Da 4 a 6 cedole	47,94
Da 6 a 8 cedole	20,11
Da 8 a 10 cedole	0,67
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Scadenze %

Intervallo	Fondo
da 1 a 3	0,10
da 3 a 5	1,02
da 5 a 7	11,08
da 7 a 10	15,02
da 10 a 15	29,09
da 15 a 20	3,10
da 20 a 30	33,63
oltre 30	6,95

Anagrafica

Società di Gestione	TCW Investment Management Co LLC	Patrimonio Classe (Mln)	0,00 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	-	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	1,45%
Data di Partenza	27/01/2022	UCITS	Si	Spese correnti	1,30%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	18/02/2020	ISIN	LU2411445187		
NAV (04/02/2025)	EUR 101,10				
Patrimonio Netto (Mln)	34,68 USD				

(31/12/2024)