

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

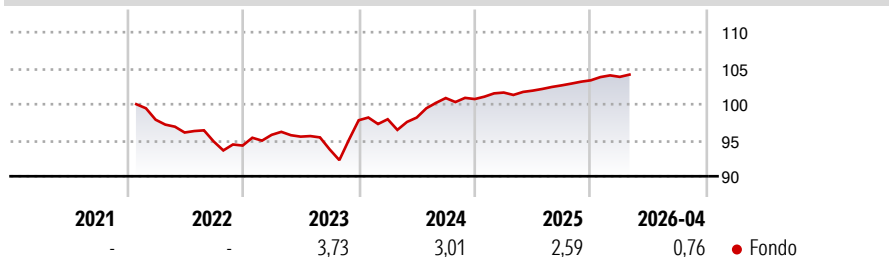
Morningstar Rating™

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. Benchmark: Bloomberg US Treasury Bill: 1-3 Months Index The use of this benchmark is for comparison purposes only and it is not used for tracking or super performing purposes.

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,06
3Y Beta	-	3Y Std Dev	3,30
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

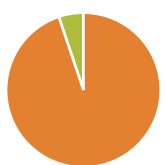
Periodo	Fondo
3-Mesi	0,19
6-Mesi	0,91
1-Anno	2,94
3-Anni Ann.ti	2,59
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 12/05/2026

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	0,46	-	-	-
2025	0,90	0,26	0,72	0,68
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

Portafoglio 31/03/2026



Asset Allocation %

Categoria	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	94,82
Liquidità	5,18
Altro	0,00

Fixed Income Style

Box™

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Alto			
Med			
Basso			

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva

Fondo 0,58

Maturità effettiva 4,51

Qualità Credito Media BBB

Credit Quality %

Fond	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %
o	o	o	o
AAA	8,56	BBB	16,46
AA	41,48	BB	2,95
A	27,36	B	2,31
		Below B	0,37
		Not Rated	0,51

Titoli principali

Nome	Settore	%
Federal National Mortgage...	-	1,49
Federal Home Loan Mortgage...	-	1,45
Government National Mortgage...	-	1,21
GOLUB CAP PART 2016-16MR2 LP...	-	0,97
Bain Capital Credit Clo...	-	0,97
BXP Trust 2017-CC 3.54%	-	0,94
Aqueduct European CLO 8 DAC...	-	0,91
Adagio X EUR CLO Designated...	-	0,91
Tully Park Clo Designated...	-	0,91
BXP Trust 2017-CC 3.67%	-	0,89
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		10,64
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		463

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
Governativo	0,00
Societario	-0,01
Cartolarizzazioni	94,83
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	4,67
Derivati	0,51
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	2,52
Da 0 a 4 cedole	24,64
Da 4 a 6 cedole	52,27
Da 6 a 8 cedole	17,84
Da 8 a 10 cedole	1,69
Da 10 a 12 cedole	0,54
Oltre 12 cedole	0,51

Scadenze %

Periodo	Fondo
da 1 a 3	0,35
da 3 a 5	0,56
da 5 a 7	1,57
da 7 a 10	15,21
da 10 a 15	34,43
da 15 a 20	16,76
da 20 a 30	17,83
oltre 30	13,16

Anagrafica

Società di Gestione	TCW Investment Management Co LLC	Patrimonio Classe (Mln)	0,48 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 (12/05/2026)	EUR 104,18				
Patrimonio Netto (Mln)	415,71 USD				

(31/03/2026)