

TCW Funds - TCW Global Securitised Fund AU

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Altro

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

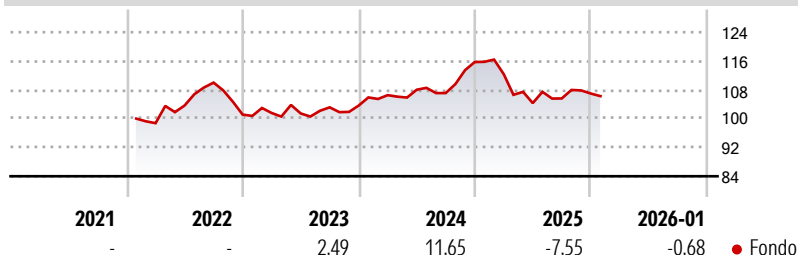
Bloomberg US Treasury Bill 1-3 M TR USD

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	-0,15
3Y Beta	-	3Y Std Dev	6,70
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

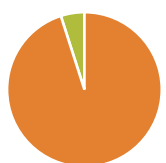
Rend. Cumulati %

	Fondo
3-Mesi	-0,82
6-Mesi	0,53
1-Anno	-8,33
3-Anni Ann.ti	1,32
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2026	-	-	-	-
2025	-2,90	-7,15	1,23	1,30
2024	2,78	1,42	-0,86	8,04
2023	0,44	-0,13	1,68	0,48
2022	-	4,96	6,13	-8,07

Portafoglio 31/12/2025

Asset Allocation %

Azioni	0,00
Obbligazioni	95,06
Liquidità	4,94
Altro	0,00

Fixed Income Style
Box™

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva	0,66
Maturity effettiva	4,52
Qualità Credito Media	BBB

Credit Quality %

	Fond	Credit Quality %	Fond
	o		o
AAA	11,23	BBB	18,85
AA	40,21	BB	1,74
A	25,41	B	2,13
		Below B	0,40
		Not Rated	0,03

Titoli principali

Nome	Settore	%
Government National Mortgage...	—	2,08
Government National Mortgage...	—	2,03
OBX 2025-NQM8 TRUST 6.39%	—	1,33
WOODWARD CAPITAL MANAGEMENT...	—	1,28
CVC Cordatus Loan Fund XXXV...	—	1,19
Arbour Clo XII Designated...	—	1,17
Rockford Tower Europe Clo...	—	1,17
Arbour CLO V Designated...	—	1,17
MORGAN STANLEY RES TR...	—	1,10
Sequoia Logistics 2025-1 DAC...	—	1,10
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		13,61
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		417

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	0,00
Societario	0,61
Cartolarizzazioni	94,45
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	4,91
Derivati	0,03

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	5,41
Da 0 a 4 cedole	26,11
Da 4 a 6 cedole	38,95
Da 6 a 8 cedole	26,13
Da 8 a 10 cedole	0,51
Da 10 a 12 cedole	0,94
Oltre 12 cedole	1,95

Scadenze %

	Fondo
da 1 a 3	0,00
da 3 a 5	0,13
da 5 a 7	0,80
da 7 a 10	15,00
da 10 a 15	37,25
da 15 a 20	15,28
da 20 a 30	19,23
oltre 30	12,31

Anagrafica

Società di Gestione	TCW Investment Management Co LLC	Patrimonio Classe (Mln)	0,00 USD	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	-	Valuta del Fondo	USD	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	LU2411445005		
NAV (11/02/2026)	USD 113,00				
Patrimonio Netto (Mln)	405,21 USD				

(31/12/2025)