

TCW Funds - TCW Global Securitized Fund AU

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Altro

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

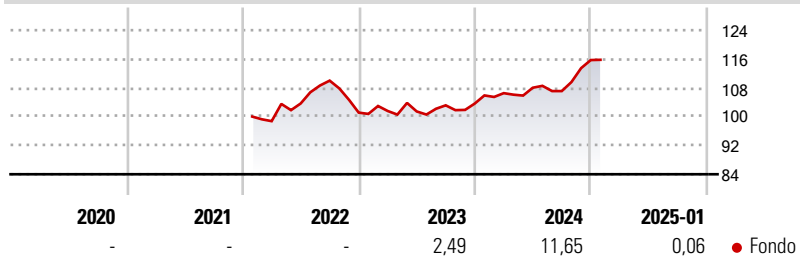
Bloomberg US Treasury Bill 1-3 M TR USD

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	0,42
3Y Beta	-	3Y Std Dev	6,62
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

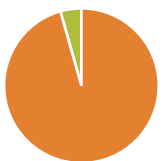
Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	6,18
6-Mesi	7,26
1-Anno	9,19
3-Anni Ann.ti	5,88
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

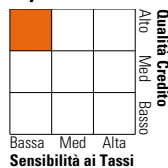
Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
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
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 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 (04/02/2025)	USD 107,42				
Patrimonio Netto (Mln)	34,68 USD				

(31/12/2024)