

# 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 | -0,01 |
| 3Y Beta           | - | 3Y Std Dev      | 6,68  |
| 3Y R-Squared      | - | 3Y Risk         | -     |
| 3Y Info Ratio     | - | 5Y Risk         | -     |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk        | -     |

### Rend. Cumulati %

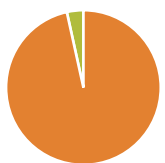
| Periodo        | Fondo |
|----------------|-------|
| 3-Mesi         | 0,33  |
| 6-Mesi         | 0,79  |
| 1-Anno         | 2,03  |
| 3-Anni Ann.ti  | 2,63  |
| 5-Anni Ann.ti  | -     |
| 10-Anni Ann.ti | -     |

Rendimenti aggiornati al 13/04/2026

### Rendimenti

| Periodo | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|---------|-------|-------|-------|-------|
| 2026    | 2,87  | -     | -     | -     |
| 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 28/02/2026



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| ● Azioni           | 0,00  |
| ● Obbligazioni     | 96,55 |
| ● Liquidità        | 3,45  |
| ● Altro            | 0,00  |

### Fixed Income Style

| Stile                 | Fondo |
|-----------------------|-------|
| Box™                  |       |
| Duration Effettiva    | 0,54  |
| Maturità effettiva    | 4,53  |
| Qualità Credito Media | BBB   |



### Credit Quality %

| Qualità | Fond  | Qualità   | Fond  |
|---------|-------|-----------|-------|
| AAA     | 9,31  | BBB       | 17,45 |
| AA      | 40,88 | BB        | 2,94  |
| A       | 26,56 | B         | 2,83  |
|         |       | Below B   | 0,37  |
|         |       | Not Rated | -0,35 |

### Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| Government National Mortgage...             | —       | 1,95  |
| Government National Mortgage...             | —       | 1,81  |
| Federal National Mortgage...                | —       | 1,47  |
| Federal Home Loan Mortgage...               | —       | 1,47  |
| MORGAN STANLEY RES TR...                    | —       | 1,05  |
| BALLYROCK CLO 29 LTD 5.62%                  | —       | 0,95  |
| GOLUB CAP PART 2016-16MR2 LP...             | —       | 0,95  |
| Bain Capital Credit Clo...                  | —       | 0,95  |
| BXP Trust 2017-CC 3.42%                     | —       | 0,92  |
| Aqueduct European CLO 8 DAC...              | —       | 0,92  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 12,42 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 459   |

### Fixed Income Sector Weightings %

| Settore                    | Fondo |
|----------------------------|-------|
| 🏛️ Governativo             | 0,00  |
| 🏠 Societario               | -0,36 |
| 🏡 Cartolarizzazioni        | 96,90 |
| 🏢 Enti Locali              | 0,00  |
| 🏠 Liquidità ed equivalenti | 3,80  |
| 📄 Derivati                 | -0,35 |

### Coupon Range %

| Range             | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon          | 2,87  |
| Da 0 a 4 cedole   | 24,41 |
| Da 4 a 6 cedole   | 51,84 |
| Da 6 a 8 cedole   | 18,42 |
| Da 8 a 10 cedole  | 1,46  |
| Da 10 a 12 cedole | 0,51  |
| Oltre 12 cedole   | 0,49  |

### Scadenze %

| Scadenza   | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3   | 0,47  |
| da 3 a 5   | 0,54  |
| da 5 a 7   | 0,72  |
| da 7 a 10  | 14,90 |
| da 10 a 15 | 34,39 |
| da 15 a 20 | 16,32 |
| da 20 a 30 | 16,54 |
| oltre 30   | 16,11 |

### 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 (13/04/2026)       | USD 113,30                       |                         |              |                              |       |
| Patrimonio Netto (Mln) | 425,82 USD                       |                         |              |                              |       |

(28/02/2026)