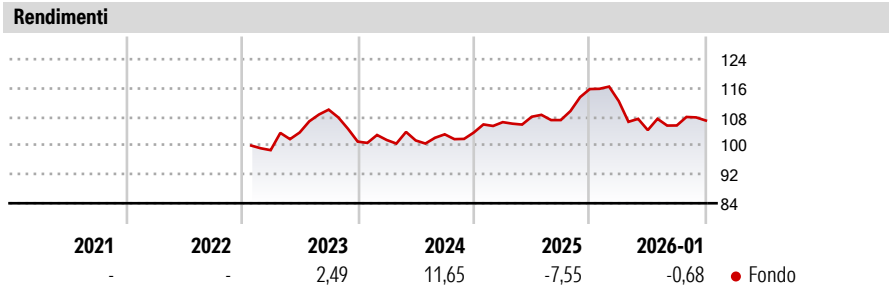


TCW Funds - TCW Global Securitised Fund AU

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Obbligazionari Altro	Not Categorized Usato nel Report	Bloomberg US Treasury Bill 1-3 M TR USD	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.



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	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-1,68	Trimestrali %	-	-	-	-
6-Mesi	0,61	2026	-	-	-	-
1-Anno	-8,96	2025	-2,90	-7,15	1,23	1,30
3-Anni Ann.ti	1,16	2024	2,78	1,42	-0,86	8,04
5-Anni Ann.ti	-	2023	0,44	-0,13	1,68	0,48
10-Anni Ann.ti	-	2022	-	4,96	6,13	-8,07

Rendimenti aggiornati al 10/02/2026

Portafoglio 31/12/2025



Fixed Income Style	Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
Box™	0,66	o	o		
Duration Effettiva	4,52	AAA	11,23	BBB	18,85
Maturity effettiva	BBB	AA	40,21	BB	1,74
Qualità Credito Media		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	—	1,28
MANAGEMENT...	—	1,19
CVC Cordatus Loan Fund XXXV...	—	1,17
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	Scadenze %	Fondo
Governativo	0,00	da 1 a 3	0,00
Societario	0,61	da 3 a 5	0,13
Cartolarizzazioni	94,45	da 5 a 7	0,80
Enti Locali	0,00	da 7 a 10	15,00
Liquidità ed equivalenti	4,91	da 10 a 15	37,25
Derivati	0,03	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	-	(10/02/2026)	-	Investimento Min. Successivo	-
Web	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,45%
Data di Partenza	27/01/2022	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,30%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	18/02/2020	Inc/Acc	Acc		
NAV (10/02/2026)	USD 113,00	ISIN	LU2411445005		
Patrimonio Netto (Mln)	405,21 USD				

(31/12/2025)