

AB FCP I - Short Duration Bond Portfolio I2-ACCU

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Globali USD-Hedged

Benchmark Morningstar

Morningstar Global Core Bond GR Hedged USD
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Bloomberg Gbl Treasury GDP 1-3Y TR HUSD

Morningstar Rating™

★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

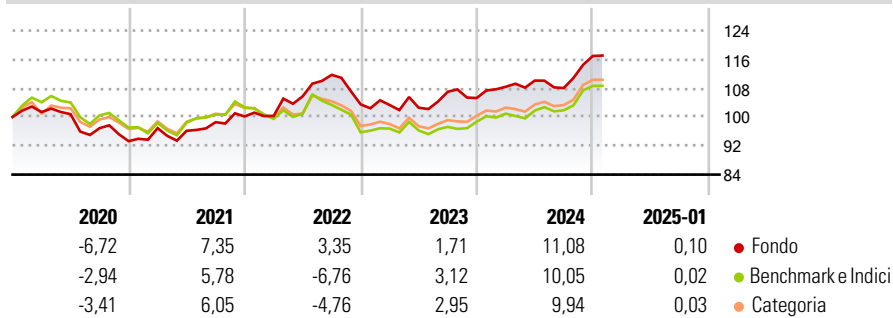
L'obiettivo del Fondo è conseguire un rendimento complessivo elevato investendo in un portafoglio globale di titoli a reddito fisso con rating investment grade. Per le posizioni denominate in valute diverse dal dollaro americano può essere prevista un'acopertura in dollari americani al fine di minimizzare i rischi delle fluttuazioni della valuta. Nel valutare i titoli, il Responsabile dell'investimento si avvale di analisi del credito interne e di informazioni finanziarie ed economiche ottenute da altre fonti.

Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha | -0,71 | 3Y Sharpe Ratio | 0,40 |
| 3Y Beta | 0,26 | 3Y Std Dev | 6,95 |
| 3Y R-Squared | 79,65 | 3Y Risk | Basso |
| 3Y Info Ratio | 0,64 | 5Y Risk | Basso |
| 3Y Tracking Error | 4,51 | 10Y Risk | Basso |

Basati su Morningstar Global Core Bond GR Hedged USD (dove applicabile)

Rendimenti



| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|------|------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | 6,27 | 5,95 | 6,12 | 2025 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 7,18 | 5,98 | 6,45 | 2025 | - | - | - | - |
| 1-Anno | 8,73 | 8,48 | 8,49 | 2024 | 2,96 | 1,58 | -1,88 | 8,24 |
| 3-Anni Ann.ti | 5,87 | 3,18 | 3,65 | 2023 | -0,17 | -0,72 | 4,31 | -1,62 |
| 5-Anni Ann.ti | 2,82 | 1,08 | 1,57 | 2022 | 0,13 | 5,45 | 5,64 | -7,34 |
| 10-Anni Ann.ti | 2,36 | 2,68 | 2,39 | 2021 | 3,87 | -0,75 | 2,48 | 1,61 |

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Portafoglio 31/12/2024



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| Azioni | 0,00 |
| Obbligazioni | 93,79 |
| Liquidità | 6,21 |
| Altro | 0,00 |

Fixed Income Style Box™

| | |
|-----------------------|------|
| Duration Effettiva | 1,88 |
| Maturità effettiva | 2,41 |
| Qualità Credito Media | AA |

Sensibilità ai Tassi

Fondo

Credit Quality %

| Fond | Credit Quality % | Fond | |
|------|------------------|-----------|------|
| 0 | 0 | 0 | |
| AAA | 52,27 | BBB | 8,59 |
| AA | 19,29 | BB | 0,13 |
| A | 19,72 | B | 0,00 |
| | | Below B | 0,00 |
| | | Not Rated | 0,00 |

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| United States Treasury Notes | — | 9,64 |
| United States Treasury Notes | — | 7,47 |
| United States Treasury Bonds | — | 7,29 |
| United States Treasury Notes | — | 5,18 |
| Japan (Government Of) | — | 4,09 |
| United Kingdom of Great... | — | 4,02 |
| France (Republic Of) | — | 3,61 |
| United States Treasury Notes | — | 3,42 |
| United States Treasury Notes | — | 3,27 |
| Japan (Government Of) | — | 2,99 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 51,00 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 151 |

Fixed Income Sector Weightings %

| Fondo | |
|--------------------------|-------|
| Governativo | 63,67 |
| Societario | 19,36 |
| Cartolarizzazioni | 11,56 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 5,40 |
| Derivati | 0,00 |

Coupon Range %

| Fondo | |
|-------------------|-------|
| 0 coupon | 0,44 |
| Da 0 a 4 cedole | 25,79 |
| Da 4 a 6 cedole | 60,01 |
| Da 6 a 8 cedole | 13,32 |
| Da 8 a 10 cedole | 0,42 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,03 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

Scadenze %

| Fondo | |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 67,03 |
| da 3 a 5 | 16,96 |
| da 5 a 7 | 1,69 |
| da 7 a 10 | 1,02 |
| da 10 a 15 | 0,81 |
| da 15 a 20 | 0,66 |
| da 20 a 30 | 4,52 |
| oltre 30 | 0,00 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---|-------------------------|--------------|------------------------------|---------------|
| Società di Gestione | AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. | Patrimonio Classe (Mln) | 8,55 USD | Investimento Min. Ingresso | 1.000.000 USD |
| Telefono | +352 46 39 36 151 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.abglobal.com | Valuta del Fondo | USD | T.E.R. | 0,58% |
| Data di Partenza | 02/11/2006 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,58% |
| Nome del Gestore | John Taylor | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| | Scott DiMaggio | ISIN | LU0249551507 | | |
| | Nicholas Sanders | | | | |
| Data Inizio Gestione | 01/01/2017 | | | | |
| NAV (04/02/2025) | USD 14,20 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 418,18 USD | | | | |

(31/12/2024)