

AB FCP I - Mortgage Income Portfolio A2 Acc

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Flessibili USD

Benchmark Morningstar

Morningstar US Core Bond TR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Secured Overnight Financing Rate(SOFR)

Morningstar Rating™

★★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

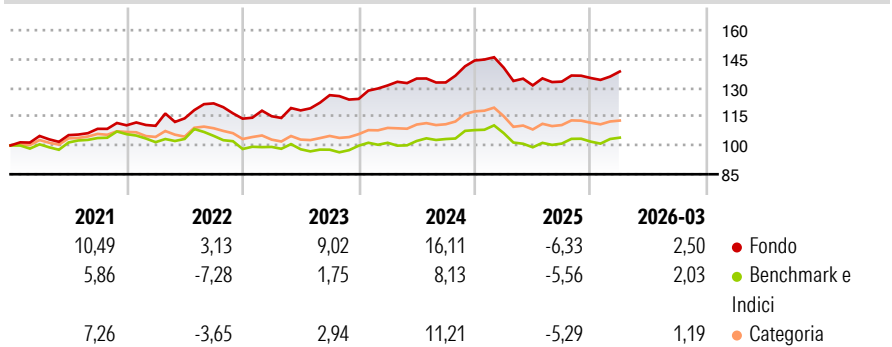
In circostanze normali, il Fondo investe principalmente in titoli ipotecari e altri titoli garantiti da attività. Il Fondo può investire sia in titoli aventi rating più elevati (Investment Grade) sia in titoli ad alto rendimento, aventi rating più basso (inferiore a Investment Grade) e, pertanto, in titoli di debito più rischiosi. Non si prevede che gli investimenti in titoli di debito con rating inferiore a Investment Grade eccedano il 50% del patrimonio netto del Fondo. Il Fondo manterrà una duration media ponderata effettiva non superiore a 8 anni. Inoltre, in circostanze normali, il Fondo coprirà la propria esposizione in valute diverse dal dollaro statunitense al fine di mantenere un'esposizione massima del 5%. Il Fondo può utilizzare...

Misure di Rischio

3Y Alpha	3,55	3Y Sharpe Ratio	0,49
3Y Beta	0,18	3Y Std Dev	7,10
3Y R-Squared	28,83	3Y Risk	Basso
3Y Info Ratio	1,01	5Y Risk	Basso
3Y Tracking Error	4,78	10Y Risk	Alto

Basati su Morningstar US Core Bond TR USD (dove applicabile)

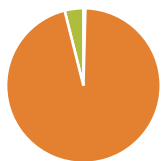
Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,26	0,96	0,79	2026	2,50	-	-	-
6-Mesi	1,26	-0,18	0,52	2025	-2,60	-6,56	1,50	1,40
1-Anno	3,28	2,45	3,57	2024	5,65	2,72	-1,51	8,63
3-Anni Ann.ti	6,08	1,72	3,71	2023	1,11	2,64	6,71	-1,55
5-Anni Ann.ti	5,94	0,79	2,56	2022	-0,24	3,51	6,84	-6,52
10-Anni Ann.ti	3,87	1,32	2,77					

Rendimenti aggiornati al 24/04/2026

Portafoglio 28/02/2026



Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,44
● Obbligazioni	103,81
● Liquidità	-4,25
● Altro	0,00

Fixed Income Style

Box™

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi
Alto	Basso	
		Bassa
		Med
		Alta

	Fondo
Duration Effettiva	2,01
Maturità effettiva	4,78
Qualità Credito Media	BB

Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
AAA	36,73	BBB	9,36
AA	8,34	BB	6,24
A	6,74	B	4,71
		Below B	10,32
		Not Rated	17,56

Titoli principali

Nome	Settore	%
FEDERAL HOME LN MTG CORP...	—	2,28
Federal National Mortgage...	—	2,01
Federal National Mortgage...	—	1,67
Ginnie Mae (Ze) 5.0729%	—	1,15
JP MORGAN MTG 2025-CES2 5.055%	—	0,92
Government National Mortgage...	—	0,89
Government National Mortgage...	—	0,85
ANGEL OAK MORTGAGE TRUST...	—	0,83
Cross 2025-CES1 Mortgage...	—	0,75
VERUS SECURITIZATION TRUST...	—	0,74
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		12,09
Numero Complessivo di Titoli Azionari		4
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		653

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏠 Governativo	5,59
🏢 Societario	0,31
🏠 Cartolarizzazioni	98,40
🏠 Enti Locali	0,00
🏠 Liquidità ed equivalenti	-4,30
🏠 Derivati	0,00

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	7,73
Da 0 a 4 cedole	15,25
Da 4 a 6 cedole	56,67
Da 6 a 8 cedole	11,19
Da 8 a 10 cedole	4,48
Da 10 a 12 cedole	1,95
Oltre 12 cedole	2,73

Scadenze %

	Fondo
da 1 a 3	7,27
da 3 a 5	2,74
da 5 a 7	2,54
da 7 a 10	6,38
da 10 a 15	22,52
da 15 a 20	7,47
da 20 a 30	25,08
oltre 30	22,89

Anagrafica

Società di Gestione	AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.	Patrimonio Classe (Mln)	220,04 USD	Investimento Min. Ingresso	2.000 EUR
Telefono	+352 46 39 36 151	(24/04/2026)		Investimento Min. Successivo	750 EUR
Web	www.abglobal.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,31%
Data di Partenza	20/02/2014	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,36%
Nome del Gestore	Michael Canter	UCITS	Si	Commissione di incentivo	0,00%
	Charlie Choi	Inc/Acc	Acc		
	Daniel Krup	ISIN	LU1021288185		
Data Inizio Gestione	01/01/2014				
NAV (24/04/2026)	USD 23,44				

AB FCP I - Mortgage Income Portfolio A2 Acc

Patrimonio Netto (Mln) 1.752,78 USD

(28/02/2026)