

AB - 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

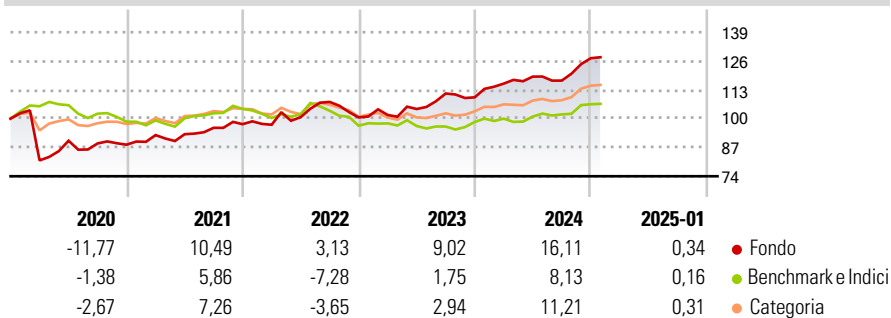
In circostanze normali, il Fondo investe principalmente in titoli ipotecari e altri titoli garantiti da attività. Il Fondo può investire sia in titoli aventi rating più elevati (Investment Grade) sia in titoli ad alto rendimento, aventi rating più basso (inferiore a Investment Grade) e, pertanto, in 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 | 3,08 | 3Y Sharpe Ratio | 0,85 |
| 3Y Beta | 0,22 | 3Y Std Dev | 7,72 |
| 3Y R-Squared | 23,98 | 3Y Risk | -Med |
| 3Y Info Ratio | 1,19 | 5Y Risk | Alto |
| 3Y Tracking Error | 6,52 | 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 | 6,31 | 4,73 | 5,47 | 2025 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 9,16 | 5,59 | 7,67 | 2025 | 5,65 | 2,72 | -1,51 | 8,63 |
| 1-Anno | 12,10 | 7,45 | 9,49 | 2024 | 1,11 | 2,64 | 6,71 | -1,55 |
| 3-Anni Ann.ti | 10,06 | 2,23 | 4,98 | 2023 | -0,24 | 3,51 | 6,84 | -6,52 |
| 5-Anni Ann.ti | 4,41 | 0,63 | 2,79 | 2022 | 4,92 | 0,43 | 3,11 | 1,69 |
| 10-Anni Ann.ti | 4,52 | 2,25 | 3,55 | 2021 | | | | |

Rendimenti aggiornati al 07/02/2025

Portafoglio 31/12/2024



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|--------|
| ● Azioni | 0,54 |
| ● Obbligazioni | 106,93 |
| ● Liquidità | -7,47 |
| ● Altro | 0,00 |

Fixed Income Style Box™

| | | Qualità Credito | |
|-----------------------|-------|-----------------|-------|
| | | Alto | Basso |
| Sensibilità ai Tassi | Alto | | |
| | Med | | |
| | Basso | | |
| Duration Effettiva | | | 2,03 |
| Maturità effettiva | | | 4,45 |
| Qualità Credito Media | | | BB |

Fondo

| Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
|------------------|-------|------------------|-------|
| AAA | 29,65 | BBB | 14,46 |
| AA | 7,82 | BB | 5,22 |
| A | 9,55 | B | 1,93 |
| | | Below B | 7,33 |
| | | Not Rated | 24,04 |

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Federal National Mortgage... | — | 3,25 |
| Government National Mortgage... | — | 2,01 |
| Government National Mortgage... | — | 1,41 |
| Federal Home Loan Mortgage... | — | 1,10 |
| Federal National Mortgage... | — | 1,00 |
| Federal National Mortgage... | — | 0,81 |
| Federal Home Loan Mortgage... | — | 0,80 |
| Federal Home Loan Mortgage... | — | 0,76 |
| BALLYROCK CLO 14 LTD 5.6732% | — | 0,71 |
| Federal Home Loan Mortgage... | — | 0,70 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 12,55 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 4 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 494 |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|----------------------------|-------|
| 🏠 Governativo | 9,82 |
| 🏢 Societario | 0,54 |
| 🏠 Cartolarizzazioni | 97,15 |
| 🏠 Enti Locali | 0,00 |
| 🏠 Liquidità ed equivalenti | -7,51 |
| 🏠 Derivati | 0,00 |

Coupon Range %

| | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon | 6,88 |
| Da 0 a 4 cedole | 13,36 |
| Da 4 a 6 cedole | 36,67 |
| Da 6 a 8 cedole | 18,59 |
| Da 8 a 10 cedole | 10,05 |
| Da 10 a 12 cedole | 4,30 |
| Oltre 12 cedole | 10,15 |

Scadenze %

| | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 9,16 |
| da 3 a 5 | 8,33 |
| da 5 a 7 | 6,80 |
| da 7 a 10 | 8,62 |
| da 10 a 15 | 20,27 |
| da 15 a 20 | 13,43 |
| da 20 a 30 | 23,34 |
| oltre 30 | 9,25 |

Anagrafica

| | | | | | |
|----------------------|---|-------------------------|--------------|------------------------------|-----------|
| Società di Gestione | AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. | Patrimonio Classe (Mln) | 200,30 USD | Investimento Min. Ingresso | 2.000 EUR |
| Telefono | +352 46 39 36 151 | (07/02/2025) | | Investimento Min. Successivo | 750 EUR |
| Web | www.abglobal.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 1,30% |
| 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 (07/02/2025) | USD 21,99 | | | | |

AB - Mortgage Income Portfolio A2 Acc

Patrimonio Netto (Mln) 1.239,23 USD

(31/12/2024)