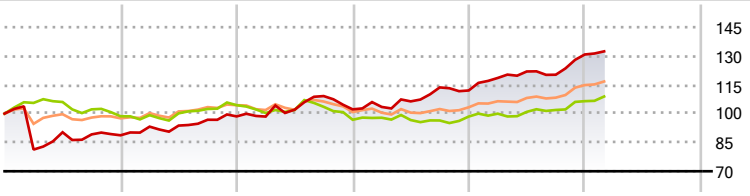
AB - Mortgage Income Portfolio I2 USD Acc

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Obbligazionari Flessibili USD	Morningstar US Core Bond TR USD Usato nel Report	Secured Overnight Financing Rate(SOFR)	★★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

In circostanze normali, il Fundo 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...

Rendimenti



2020	2021	2022	2023	2024	2025-02	
-11,27	11,08	3,72	9,63	16,72	1,25	Fondo
-1,38	5,86	-7,28	1,75	8,13	2,28	Benchmark e Indici
-2,67	7,26	-3,65	2,94	11,21	1,65	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	3,88	3Y Sharpe Ratio	1,00
3Y Beta	0,22	3Y Std Dev	7,64
3Y R-Squared	24,24	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	1,20	5Y Risk	Alto
3Y Tracking Error	6,60	10Y Risk	Alto

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-2,39	-3,23	-3,00
6-Mesi	3,76	-0,44	1,73
1-Anno	8,29	4,19	5,68
3-Anni Ann.ti	7,95	0,08	2,74
5-Anni Ann.ti	4,82	-0,03	2,82
10-Anni Ann.ti	3,83	1,15	2,32

Rendimenti aggiornati al 11/03/2025

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	5,82	2,84	-1,39	8,77
2023	1,24	2,80	6,84	-1,40
2022	-0,09	3,64	6,95	-6,35
2021	5,06	0,59	3,24	1,81

Portafoglio 31/01/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,52
Obbligazioni	98,79
Liquidità	0,69
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	2,03
Maturity effettiva	4,45
Qualità Credito Media	BB

Credit Quality %	Fondo	Credit Quality %	Fondo
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...	—	3,14
Government National Mortgage...	—	1,94
Government National Mortgage...	—	1,37
Federal Home Loan Mortgage...	—	1,07
Federal National Mortgage...	—	0,96
Federal National Mortgage...	—	0,78
Federal Home Loan Mortgage...	—	0,76
Federal National Mortgage...	—	0,76
Federal Home Loan Mortgage...	—	0,73
Federal Home Loan Mortgage...	—	0,67
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		12,18
Numero Complessivo di Titoli Azionari		4
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		505

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	1,25
Societario	0,53
Cartolarizzazioni	97,52
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	0,69
Derivati	0,00

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	7,86
Da 0 a 4 cedole	12,96
Da 4 a 6 cedole	39,11
Da 6 a 8 cedole	16,74
Da 8 a 10 cedole	9,82
Da 10 a 12 cedole	4,15
Oltre 12 cedole	9,37

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	6,12
da 3 a 5	5,97
da 5 a 7	7,31
da 7 a 10	6,39
da 10 a 15	23,09
da 15 a 20	15,09
da 20 a 30	23,94
oltre 30	11,26

Anagrafica

Società di Gestione	AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.
Telefono	+352 46 39 36 151
Web	www.abglobal.com
Data di Partenza	20/02/2014
Nome del Gestore	Michael Canter Charlie Choi Daniel Krup
Data Inizio Gestione	01/01/2014
NAV (11/03/2025)	USD 23,53
Patrimonio Classe (Mln) (12/03/2025)	292,68 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1021292617
Investimento Min. Ingresso	1.000.000 USD
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,75%
Spese correnti	0,75%
Commissione di incentivo	-

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

AB - Mortgage Income Portfolio I2 USD Acc

Patrimonio Netto (Mln) (31/01/2025)	1.284,09 USD

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.