

# AB FCP I - Mortgage Income Portfolio I2 USD 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™**

★★★★★

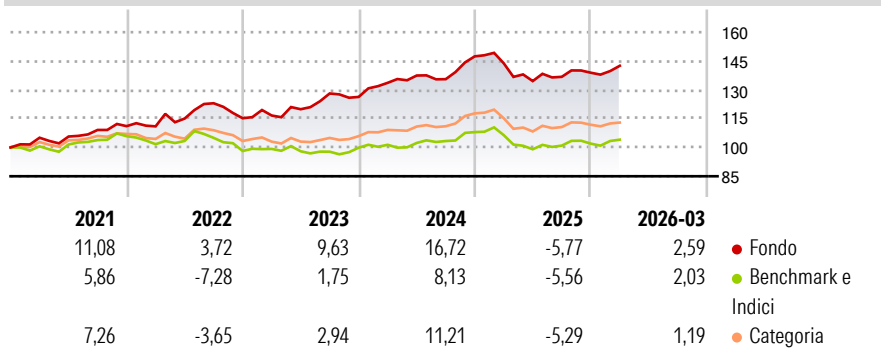
**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

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**

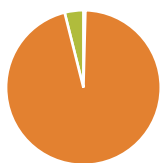
3Y Alpha	4,10	3Y Sharpe Ratio	0,57
3Y Beta	0,18	3Y Std Dev	7,10
3Y R-Squared	29,22	3Y Risk	Basso
3Y Info Ratio	1,14	5Y Risk	Basso
3Y Tracking Error	4,77	10Y Risk	Alto

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

**Rendimenti**


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-0,58	-1,03	-1,06	2026	2,59	-	-	-
6-Mesi	1,39	-0,34	0,53	2025	-2,44	-6,45	1,65	1,57
1-Anno	3,57	1,95	3,57	2024	5,82	2,84	-1,39	8,77
3-Anni Ann.ti	6,59	1,48	3,43	2023	1,24	2,80	6,84	-1,40
5-Anni Ann.ti	6,27	0,55	2,34	2022	-0,09	3,64	6,95	-6,35
10-Anni Ann.ti	4,44	1,26	2,81					

Rendimenti aggiornati al 16/04/2026

**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	4,70
Qualità Credito Media	BB

Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
	0		0
AAA	31,05	BBB	11,03
AA	10,11	BB	4,86
A	6,84	B	4,88
		Below B	11,96
		Not Rated	19,27

**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
<b>Coupon Range %</b>	<b>Fondo</b>
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)	343,85 USD	Investimento Min. Ingresso	1.000.000 USD
Telefono	+352 46 39 36 151	(16/04/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.abglobal.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,76%
Data di Partenza	20/02/2014	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	0,75%
Nome del Gestore	Michael Canter	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
	Charlie Choi	Inc/Acc	Acc		
	Daniel Krup	ISIN	LU1021292617		
Data Inizio Gestione	01/01/2014				
NAV (16/04/2026)	USD 25,01				

# AB FCP I - Mortgage Income Portfolio I2 USD Acc

Patrimonio Netto (Mln) 1.752,78 USD

(28/02/2026)