

AB - Mortgage Income Portfolio I2 EUR H Acc

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Altro

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Secured Overnight Financing Rate(SOFR)

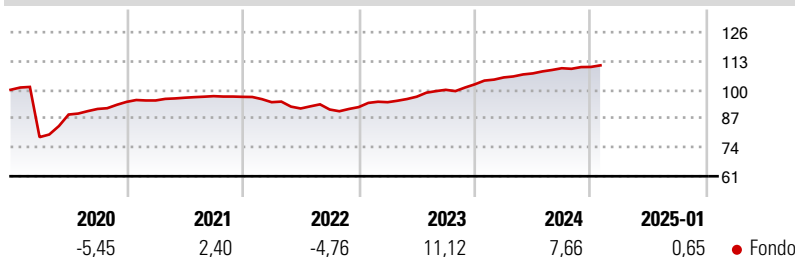
Morningstar Rating™

Senza 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...

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,68
3Y Beta	-	3Y Std Dev	3,66
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	1,42
6-Mesi	2,64
1-Anno	6,60
3-Anni Ann.ti	4,95
5-Anni Ann.ti	1,93
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 10/02/2025

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	3,04	1,72	2,18	0,53
2023	2,39	2,61	3,22	2,47
2022	-2,48	-3,02	-0,50	1,21
2021	0,69	1,30	0,74	-0,33

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	Bassa		
	Med		
	Alta		
Duration Effettiva			2,03
Maturità effettiva			4,45
Qualità Credito Media			BB

Fondo

Credit Quality %

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 %

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

Coupon Range %

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 %

Scadenza	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)	35,03 EUR	Investimento Min. Ingresso	1.000.000 EUR
Telefono	+352 46 39 36 151	(10/02/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.abglobal.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,75%
Data di Partenza	17/10/2017	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,75%
Nome del Gestore	Michael Canter	UCITS	Si	Commissione di incentivo	0,00%
	Charlie Choi	Inc/Acc	Acc		
	Daniel Krup	ISIN	LU1699968225		
Data Inizio Gestione	01/01/2014				
NAV (10/02/2025)	EUR 17,13				

AB - Mortgage Income Portfolio I2 EUR H Acc

Patrimonio Netto (Mln) 1.239,23 USD

(31/12/2024)