

AB FCP I - Mortgage Income Portfolio I2 EUR H Acc

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Altro

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

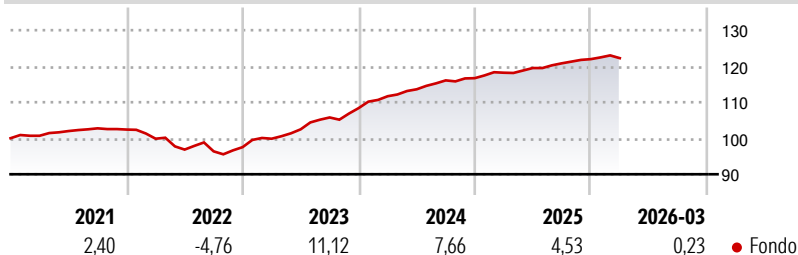
Secured Overnight Financing Rate(SOFR)

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	2,10
3Y Beta	-	3Y Std Dev	1,91
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

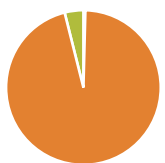
Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	0,51
6-Mesi	1,25
1-Anno	4,80
3-Anni Ann.ti	6,96
5-Anni Ann.ti	3,98
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 16/04/2026

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	0,23	-	-	-
2025	1,29	1,10	1,09	0,97
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

Portafoglio 28/02/2026

Asset Allocation %

Azioni	0,44
Obbligazioni	103,81
Liquidità	-4,25
Altro	0,00

Fixed Income Style

Stile	Fondo
Box™	
Duration Effettiva	2,01
Maturità effettiva	4,70
Qualità Credito Media	BB

Sensibilità ai Tassi

Credit Quality %

Qualità	Fond	Credit Quality %	Fond
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 %

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

Coupon Range %

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 %

Scadenza	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)	57,01 EUR	Investimento Min. Ingresso	1.000.000 EUR
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	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 (16/04/2026)	EUR 17,89				

AB FCP I - Mortgage Income Portfolio I2 EUR H Acc

Patrimonio Netto (Mln) 1.752,78 USD

(28/02/2026)