

# AB FCP I - Mortgage Income Portfolio AT EUR H

**Categoria Morningstar™**  
Obbligazionari Flessibili USD

**Benchmark Morningstar**  
Morningstar US Core Bond TR USD  
Usato nel Report

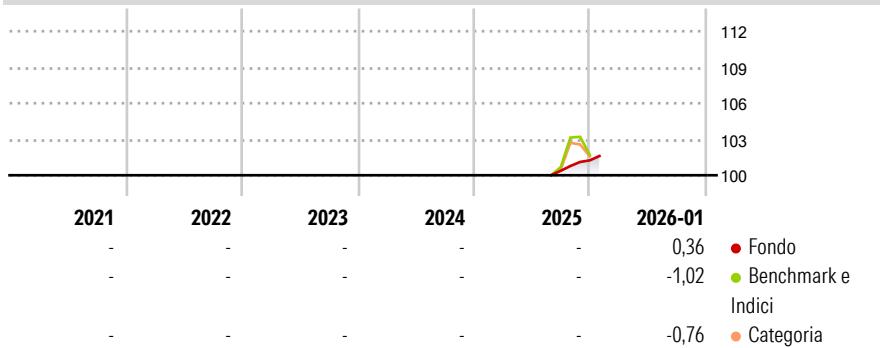
**Benchmark Dichiarato**  
Secured Overnight Financing Rate(SOFR)

**Morningstar Rating™**  
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 | - |
| 3Y Beta           | - | 3Y Std Dev      | - |
| 3Y R-Squared      | - | 3Y Risk         | - |
| 3Y Info Ratio     | - | 5Y Risk         | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk        | - |

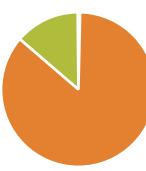
Basati su Morningstar US Core Bond TR USD (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk   | Cat   |
|------------------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi           | 0,82  | -1,88 | -1,21 |
| 6-Mesi           | -     | 0,37  | 1,09  |
| 1-Anno           | -     | -     | -     |
| 3-Anni Ann.ti    | -     | -     | -     |
| 5-Anni Ann.ti    | -     | -     | -     |
| 10-Anni Ann.ti   | -     | -     | -     |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2026

| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4   |
|--------------------------|----|----|----|------|
| 2026                     | -  | -  | -  | -    |
| 2025                     | -  | -  | -  | 0,87 |
| 2024                     | -  | -  | -  | -    |
| 2023                     | -  | -  | -  | -    |
| 2022                     | -  | -  | -  | -    |

## Portafoglio 30/11/2025



| Fixed Income Style Box™ | Duration Effettiva | Fondo |
|-------------------------|--------------------|-------|
| Alto                    | 2,01               |       |
| Med                     | 4,70               |       |
| Basso                   | BB                 |       |

## Titoli principali

| Nome  | Settore | %    |
|---|---------|------|
| Government National Mortgage...             | -       | 2,87 |
| Federal National Mortgage...                | -       | 1,79 |
| Ginnie Mae (Ze) 5.3177%                     | -       | 1,42 |
| FEDERAL HOME LN MTG CORP...                 | -       | 1,18 |
| Government National Mortgage...             | -       | 1,04 |
| FEDERAL HOME LN MTG CORP...                 | -       | 0,87 |
| Federal Home Loan Mortgage...               | -       | 0,85 |
| SANTANDER MORTGAGE ASSET...                 | -       | 0,82 |
| Towd Point Mortgage Trust...                | -       | 0,71 |
| SANTANDER MORTGAGE ASSET...                 | -       | 0,71 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            | 12,26   |      |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       | 4       |      |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | 589     |      |

## Fixed Income Sector Weightings %

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo  |
|----------------------------------|--------|
| Governativo                      | 21,24  |
| Societario                       | 0,42   |
| Cartolarizzazioni                | 97,07  |
| Enti Locali                      | 0,00   |
| Liquidità ed equivalenti         | -18,73 |
| Derivati                         | 0,00   |

## Coupon Range %

| Coupon Range %    | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon          | 7,82  |
| Da 0 a 4 cedole   | 16,60 |
| Da 4 a 6 cedole   | 48,00 |
| Da 6 a 8 cedole   | 15,36 |
| Da 8 a 10 cedole  | 5,85  |
| Da 10 a 12 cedole | 2,00  |
| Oltre 12 cedole   | 4,36  |

## Scadenze %

| Scadenze % | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3   | 16,44 |
| da 3 a 5   | 6,57  |
| da 5 a 7   | 3,57  |
| da 7 a 10  | 5,23  |
| da 10 a 15 | 21,31 |
| da 15 a 20 | 7,63  |
| da 20 a 30 | 25,38 |
| oltre 30   | 10,51 |

## Anagrafica

|                      |   |   |              |                              |           |
|----------------------|---|---|--------------|------------------------------|-----------|
| Società di Gestione  | AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. | Patrimonio Classe (Mln)<br>(03/02/2026) | 0,01 EUR     | Investimento Min. Ingresso   | 2.000 EUR |
| Telefono             | +352 46 39 36 151                       | Domicilio                               | LUSSEMBURGO  | Investimento Min. Successivo | 750 EUR   |
| Web                  | www.abglobal.com                        | Valuta del Fondo                        | EUR          | T.E.R.                       | -         |
| Data di Partenza     | 04/08/2025                              | UCITS                                   | Si           | Spese correnti               | 1,33%     |
| Nome del Gestore     | Michael Canter                          | Inc/Acc                                 | Inc          | Commissione di incentivo     | -         |
|                      | Charlie Choi                            | ISIN                                    | LU1684388421 |                              |           |
|                      | Daniel Krup                             |   |              |                              |           |
| Data Inizio Gestione | 01/01/2014                              |   |              |                              |           |
| NAV (03/02/2026)     | EUR 14,87                               |   |              |                              |           |

# AB FCP I - Mortgage Income Portfolio AT EUR H

Patrimonio Netto (Mln)

1.414,73 USD

(30/11/2025)