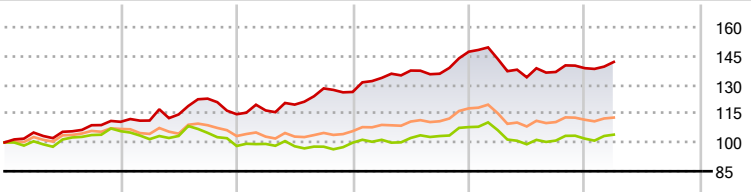
AB FCP I - Mortgage Income Portfolio I2 EUR Acc

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



2021	2022	2023	2024	2025	2026-03	
10,74	3,57	10,11	16,59	-5,82	2,33	Fondo
5,86	-7,28	1,75	8,13	-5,56	2,03	Benchmark e Indici
7,26	-3,65	2,94	11,21	-5,29	1,19	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	3,98	3Y Sharpe Ratio	0,54
3Y Beta	0,21	3Y Std Dev	7,10
3Y R-Squared	23,27	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	1,08	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	4,84	10Y Risk	Alto

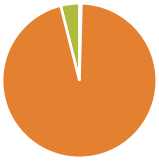
Basati su Morningstar US Core Bond TR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-0,61	-1,03	-1,06
6-Mesi	1,43	-0,34	0,53
1-Anno	3,56	1,95	3,57
3-Anni Ann.ti	6,56	1,48	3,43
5-Anni Ann.ti	6,27	0,55	2,34
10-Anni Ann.ti	4,43	1,26	2,81

Rendimenti aggiornati al 16/04/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	2,33	-	-	-
2025	-2,55	-6,66	2,07	1,45
2024	5,79	2,86	-1,20	8,44
2023	1,72	2,60	7,04	-1,44
2022	0,59	2,84	7,19	-6,60

Portafoglio 28/02/2026



Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,44
Obbligazioni	103,81
Liquidità	-4,25
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	2,01
Maturity effettiva	4,70
Qualità Credito Media	BB

Credit Quality %	Fondo	Credit Quality %	Fondo
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

Coupon 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 %	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.
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 (16/04/2026)	EUR 21,25
Patrimonio Classe (Mln) (16/04/2026)	1,80 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1021292880
Investimento Min. Ingresso	1.000.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,77%
Spese correnti	0,75%
Commissione di incentivo	0,00%

© 2026 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 FCP I - Mortgage Income Portfolio I2 EUR Acc

Patrimonio Netto (Mln)	1.752,78 USD
(28/02/2026)	

© 2026 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.