

# AB - Mortgage Income Portfolio I2 EUR Acc

**Categoria Morningstar™**  
Obbligazionari Flessibili USD

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

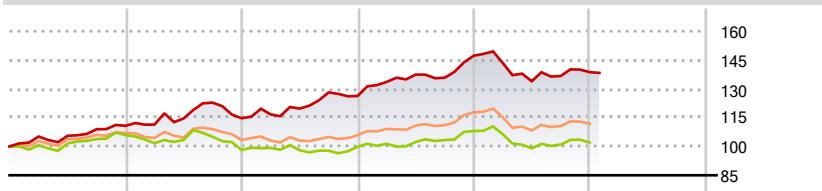
**Benchmark Dichiarato**  
Secured Overnight Financing Rate(SOFR)

**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...

## Rendimenti



2021	2022	2023	2024	2025	2026-01
10,74	3,57	10,11	16,59	-5,82	-0,29
5,86	-7,28	1,75	8,13	-5,56	-1,02
			11,21	-5,29	-0,76
7,26	-3,65	2,94			

## Misure di Rischio

3Y Alpha	4,40	3Y Sharpe Ratio	0,45
3Y Beta	0,14	3Y Std Dev	7,50
3Y R-Squared	12,42	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	1,08	5Y Risk	Basso
3Y Tracking Error	5,38	10Y Risk	Alto

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

## Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-1,13	-1,88	-1,21
6-Mesi	1,10	0,37	1,09
1-Anno	-7,11	-6,87	-6,17
3-Anni Ann.ti	5,93	0,74	2,69
5-Anni Ann.ti	6,23	0,13	2,27
10-Anni Ann.ti	4,23	1,15	2,94

Rendimenti aggiornati al 03/02/2026

## Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
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 30/11/2025



Asset Allocation %	Netta
• Azioni	0,50
• Obbligazioni	117,88
• Liquidità	-18,60
• Altro	0,21

## Fixed Income Style

Box™	Duration Effettiva	Fondo
Alto	2,01	
Med	4,70	
Basso	BB	

Bassa Med Alta Sensibilità ai Tassi

## Credit Quality %

Fond	Credit Quality %	Fond
0	AAA	BBB
1	AA	BB
2	A	B
3		Below B
4		Not Rated

## 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 %

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

Fondo
da 1 a 3
da 3 a 5
da 5 a 7
da 7 a 10
da 10 a 15
da 15 a 20
da 20 a 30
oltre 30

## Anagrafica

Società di Gestione	AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.	Patrimonio Classe (Mln)	1,78 USD	Investimento Min. Ingresso	1.000.000 EUR
Telefono	+352 46 39 36 151	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.abglobal.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,77%
Data di Partenza	20/02/2014	UCITS	Si	Spese correnti	0,75%
Nome del Gestore	Michael Canter	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	0,00%
	Charlie Choi	ISIN	LU1021292880		
	Daniel Krup				
Data Inizio Gestione	01/01/2014				
NAV (03/02/2026)	EUR 21,05				

## AB - Mortgage Income Portfolio I2 EUR Acc

Patrimonio Netto (Mln)

1.414,73 USD

(30/11/2025)