

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

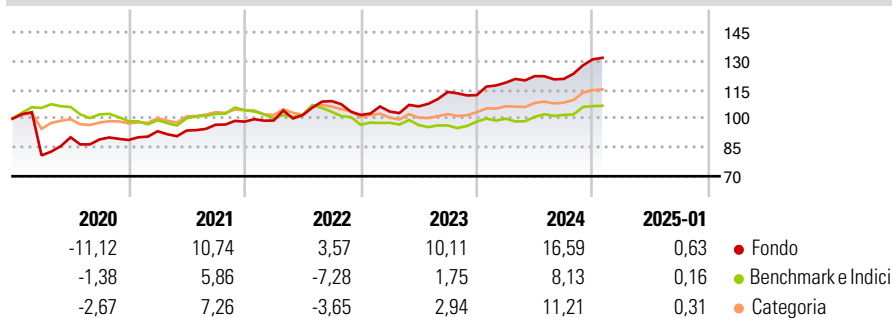
In circostanze normali, il Fondo investe principalmente in titoli ipotecari e altri titoli garantiti da attività. Il Fondo può investire sia in titoli aventi rating più elevati (Investment Grade) sia in titoli ad alto rendimento, aventi rating più basso (inferiore a Investment Grade) e, pertanto, in 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...

Misure di Rischio

3Y Alpha	3,76	3Y Sharpe Ratio	0,95
3Y Beta	0,22	3Y Std Dev	7,69
3Y R-Squared	18,06	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	1,26	5Y Risk	Alto
3Y Tracking Error	6,80	10Y Risk	Alto

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

Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	5,89	4,20	4,86	2025	-	-	-	-
6-Mesi	9,68	5,67	7,69	2025	5,79	2,86	-1,20	8,44
1-Anno	13,41	8,41	10,17	2024	1,72	2,60	7,04	-1,44
3-Anni Ann.ti	10,86	2,69	5,06	2023	0,59	2,84	7,19	-6,60
5-Anni Ann.ti	4,97	0,59	2,69	2022	5,14	0,38	3,25	1,63
10-Anni Ann.ti	5,12	2,28	3,49	2021				

Rendimenti aggiornati al 10/02/2025

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	Alto		
	Med		
Basso	Med		
	Alto		
Duration Effettiva		2,03	
Maturità effettiva		4,45	
Qualità Credito Media		BB	

Fondo

Credit Quality %

Fond	Credit Quality %	Fond	
0	0	0	
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 %

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

Coupon 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 %

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)	2,26 USD	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.	0,76%
Data di Partenza	20/02/2014	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	LU1021292880		
Data Inizio Gestione	01/01/2014				
NAV (10/02/2025)	EUR 22,67				

AB - Mortgage Income Portfolio I2 EUR Acc

Patrimonio Netto (Mln) 1.239,23 USD

(31/12/2024)