

AB FCP I - Mortgage Income Portfolio I2 USD 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™

★★★★★

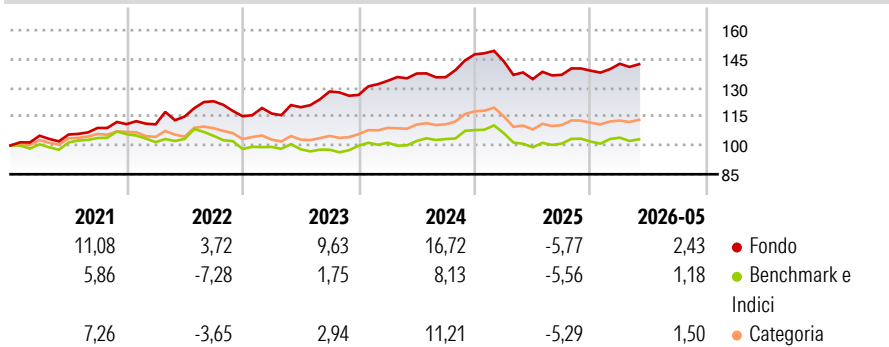
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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

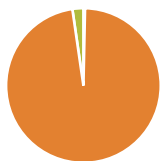
3Y Alpha	3,89	3Y Sharpe Ratio	0,41
3Y Beta	0,19	3Y Std Dev	6,72
3Y R-Squared	31,06	3Y Risk	Basso
3Y Info Ratio	1,04	5Y Risk	Basso
3Y Tracking Error	4,67	10Y Risk	Alto

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

Rendimenti


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,24	3,02	3,24	2026	2,59	-	-	-
6-Mesi	5,83	4,37	4,50	2025	-2,44	-6,45	1,65	1,57
1-Anno	8,63	7,16	7,43	2024	5,82	2,84	-1,39	8,77
3-Anni Ann.ti	6,97	2,58	4,33	2023	1,24	2,80	6,84	-1,40
5-Anni Ann.ti	6,91	1,17	2,77	2022	-0,09	3,64	6,95	-6,35
10-Anni Ann.ti	4,56	1,36	2,82					

Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

Portafoglio 30/04/2026


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,35
● Obbligazioni	102,04
● Liquidità	-2,40
● Altro	0,00

Fixed Income Style
Box™

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi
Alto	Basso	
		Bassa
		Med
		Alta

	Fondo
Duration Effettiva	2,01
Maturità effettiva	4,78
Qualità Credito Media	BB

Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
AAA	36,73	BBB	9,36
AA	8,34	BB	6,24
A	6,74	B	4,71
		Below B	10,32
		Not Rated	17,56

Titoli principali

Nome	Settore	%
FEDERAL HOME LN MTG CORP...	—	2,23
Federal National Mortgage...	—	1,42
Federal National Mortgage...	—	1,10
Federal National Mortgage...	—	1,08
Government National Mortgage...	—	0,89
JP MORGAN MTG 2025-CES2 5.055%	—	0,88
Federal National Mortgage...	—	0,87
Government National Mortgage...	—	0,83
Cross 2025-CES1 Mortgage...	—	0,71
Stort 2026-1A Inv 0%...	—	0,70
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		10,71
Numero Complessivo di Titoli Azionari		4
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		660

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏠 Governativo	4,70
🏢 Societario	1,76
🏠 Cartolarizzazioni	95,94
🏠 Enti Locali	0,00
🏠 Liquidità ed equivalenti	-2,41
🏠 Derivati	0,00
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	7,92
Da 0 a 4 cedole	16,88
Da 4 a 6 cedole	55,19
Da 6 a 8 cedole	11,69
Da 8 a 10 cedole	4,74
Da 10 a 12 cedole	1,75
Oltre 12 cedole	1,83

Scadenze %

	Fondo
da 1 a 3	1,48
da 3 a 5	2,49
da 5 a 7	2,16
da 7 a 10	7,46
da 10 a 15	26,21
da 15 a 20	7,35
da 20 a 30	26,24
oltre 30	18,84

Anagrafica

Società di Gestione	AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.	Patrimonio Classe (Mln)	361,86 USD	Investimento Min. Ingresso	1.000.000 USD
Telefono	+352 46 39 36 151	(26/06/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.abglobal.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,77%
Data di Partenza	20/02/2014	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	0,75%
Nome del Gestore	Michael Canter	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
	Charlie Choi	Inc/Acc	Acc		
	Daniel Krup	ISIN	LU1021292617		
Data Inizio Gestione	01/01/2014				
NAV (26/06/2026)	USD 25,29				

See disclosures for more details

© 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 prodotte; (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 USD Acc

Patrimonio Netto (Mln) 1.741,21 USD

(30/04/2026)