

AB FCP I - Mortgage Income Portfolio I2 EUR H Acc

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Altro

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

Secured Overnight Financing Rate(SOFR)

Morningstar Rating™

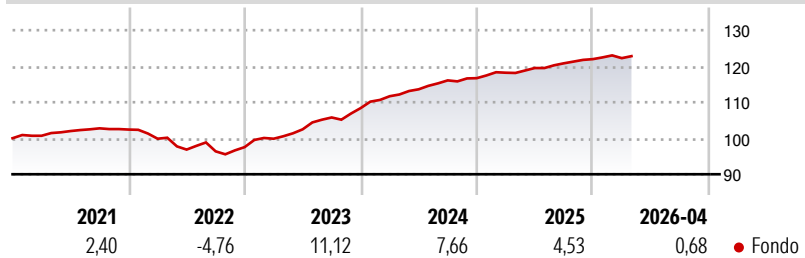
Senza rating

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...

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	2,08
3Y Beta	-	3Y Std Dev	1,91
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

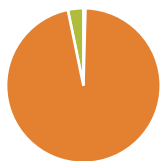
Rendimenti

Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	0,06
6-Mesi	1,13
1-Anno	3,95
3-Anni Ann.ti	6,72
5-Anni Ann.ti	3,89
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 12/05/2026

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	0,23	-	-	-
2025	1,29	1,10	1,09	0,97
2024	3,04	1,72	2,18	0,53
2023	2,39	2,61	3,22	2,47
2022	-2,48	-3,02	-0,50	1,21

Portafoglio 31/03/2026


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,45
● Obbligazioni	103,01
● Liquidità	-3,46
● Altro	0,00

Fixed Income Style

Stile	Fondo
Box™	
Duration Effettiva	2,01
Maturity effettiva	4,78
Qualità Credito Media	BB


Credit Quality %

Qualità	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...	—	2,29
Federal National Mortgage...	—	1,44
Federal National Mortgage...	—	1,16
Federal National Mortgage...	—	1,10
JP MORGAN MTG 2025-CES2 5.055%	—	0,92
Government National Mortgage...	—	0,90
Federal National Mortgage...	—	0,88
Government National Mortgage...	—	0,85
ANGEL OAK MORTGAGE TRUST...	—	0,84
Cross 2025-CES1 Mortgage...	—	0,75
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		11,12
Numero Complessivo di Titoli Azionari		4
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		647

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
🏛️ Governativo	4,53
🏢 Societario	0,30
🏠 Cartolarizzazioni	98,67
🏡 Enti Locali	0,00
🏢 Liquidità ed equivalenti	-3,51
📄 Derivati	0,00

Coupon Range %

Range	Fondo
0 coupon	7,10
Da 0 a 4 cedole	16,46
Da 4 a 6 cedole	56,13
Da 6 a 8 cedole	11,42
Da 8 a 10 cedole	4,52
Da 10 a 12 cedole	1,89
Oltre 12 cedole	2,48

Scadenze %

Scadenza	Fondo
da 1 a 3	5,92
da 3 a 5	2,69
da 5 a 7	2,83
da 7 a 10	6,45
da 10 a 15	24,74
da 15 a 20	8,06
da 20 a 30	24,96
oltre 30	21,13

Anagrafica

Società di Gestione	AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l.	Patrimonio Classe (Mln)	58,05 EUR	Investimento Min. Ingresso	1.000.000 EUR
Telefono	+352 46 39 36 151	(12/05/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.abglobal.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,77%
Data di Partenza	17/10/2017	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	LU1699968225		
Data Inizio Gestione	01/01/2014				
NAV (12/05/2026)	EUR 17,89				

AB FCP I - Mortgage Income Portfolio I2 EUR H Acc

Patrimonio Netto (Mln) 1.714,08 USD

(31/03/2026)