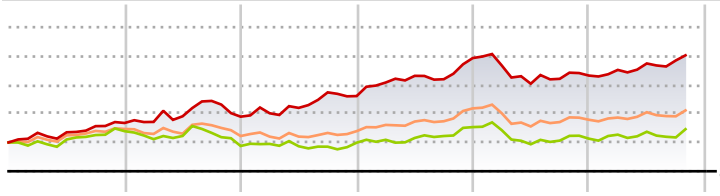
# AB FCP I - Mortgage Income Portfolio A2 EUR Acc

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Obbligazionari Flessibili USD | Morningstar US Core Bond TR USD<br>Usato nel Report | Secured Overnight Financing Rate(SOFR) | ★★★★ |

## 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 | 2026-10 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fondo | 10,12 | 2,98 | 9,47 | 15,92 | -6,32 | 7,81 |
| Benchmark e Indici | 5,86 | -7,28 | 1,75 | 8,13 | -5,56 | 4,81 |
| Categoria | 7,26 | -3,65 | 2,94 | 11,21 | -5,29 | 4,52 |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | 2,11 | 3Y Sharpe Ratio | 0,37 |
| 3Y Beta | 0,22 | 3Y Std Dev | 6,70 |
| 3Y R-Squared | 35,18 | 3Y Risk | Basso |
| 3Y Info Ratio | 0,35 | 5Y Risk | Basso |
| 3Y Tracking Error | 4,55 | 10Y Risk | Alto |

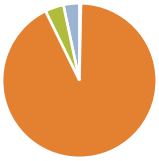
Basati su Morningstar US Core Bond TR USD (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | 4,72 | 2,99 | 2,86 |
| 6-Mesi | 7,44 | 4,53 | 4,97 |
| 1-Anno | 8,80 | 4,42 | 5,74 |
| 3-Anni Ann.ti | 5,63 | 3,26 | 4,13 |
| 5-Anni Ann.ti | 6,07 | 0,38 | 2,33 |
| 10-Anni Ann.ti | 3,77 | 1,30 | 2,54 |

Rendimenti aggiornati al 13/11/2026

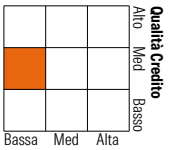
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | 2,18 | 2,43 | 1,11 | - |
| 2025 | -2,66 | -6,79 | 1,94 | 1,28 |
| 2024 | 5,67 | 2,66 | -1,32 | 8,29 |
| 2023 | 1,57 | 2,43 | 6,84 | -1,52 |
| 2022 | 0,50 | 2,66 | 7,04 | -6,75 |

## Portafoglio 30/09/2026



| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 0,32 |
| Obbligazioni | 92,44 |
| Liquidità | 3,90 |
| Altro | 3,34 |

**Fixed Income Style Box™**




| | Fondo |
|---|---|
| Duration Effettiva | 2,11 |
| Maturity effettiva | 5,30 |
| Qualità Credito Media | BB |

| Credit Quality % | Fondo | Credit Quality % | Fondo |
|---|---|---|---|
| AAA | 31,79 | BBB | 11,44 |
| AA | 7,87 | BB | 14,53 |
| A | 20,93 | B | 5,07 |
| | | Below B | 8,20 |
| | | Not Rated | 0,17 |

## Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| FEDERAL HOME LN MTG CORP... | — | 1,90 |
| Federal National Mortgage... | — | 1,00 |
| Federal National Mortgage... | — | 0,95 |
| CROSS 2025-H7 MORTGAGE TRUST... | — | 0,81 |
| Federal National Mortgage... | — | 0,80 |
| Government National Mortgage... | — | 0,78 |
| Federal National Mortgage... | — | 0,77 |
| Government National Mortgage... | — | 0,72 |
| JP MORGAN MTG 2025-CES2 5.055% | — | 0,72 |
| Verus Securitization Trust... | — | 0,64 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 9,09 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 3 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 742 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | -2,36 |
| Societario | 1,77 |
| Cartolarizzazioni | 96,54 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 4,04 |
| Derivati | 0,00 |

| Coupon Range % | Fondo |
|---|---|
| 0 coupon | 6,90 |
| Da 0 a 4 cedole | 16,12 |
| Da 4 a 6 cedole | 57,52 |
| Da 6 a 8 cedole | 12,08 |
| Da 8 a 10 cedole | 4,52 |
| Da 10 a 12 cedole | 1,36 |
| Oltre 12 cedole | 1,51 |

| Scadenze % | Fondo |
|---|---|
| da 1 a 3 | 1,98 |
| da 3 a 5 | 2,59 |
| da 5 a 7 | 1,96 |
| da 7 a 10 | 10,41 |
| da 10 a 15 | 26,01 |
| da 15 a 20 | 10,68 |
| da 20 a 30 | 23,08 |
| oltre 30 | 18,40 |

## 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<br>Charlie Choi<br>Daniel Krup |
| Data Inizio Gestione | 01/01/2014 |
| NAV (13/11/2026) | EUR 21,51 |
| Patrimonio Classe (Mln) (13/11/2026) | 3,03 USD |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | EUR |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | LU1021288268 |
| Investimento Min. Ingresso | 2.000 EUR |
| Investimento Min. Successivo | 750 EUR |
| T.E.R. | 1,31% |
| Spese correnti | 1,30% |
| Commissione di incentivo | 0,00% |

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 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 A2 EUR Acc

| | |
|---|---|
| Patrimonio Netto (Mln) | 1.848,87 USD |
| (30/09/2026) | |

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 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.

MORNINGSTAR