

AB FCP I - 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

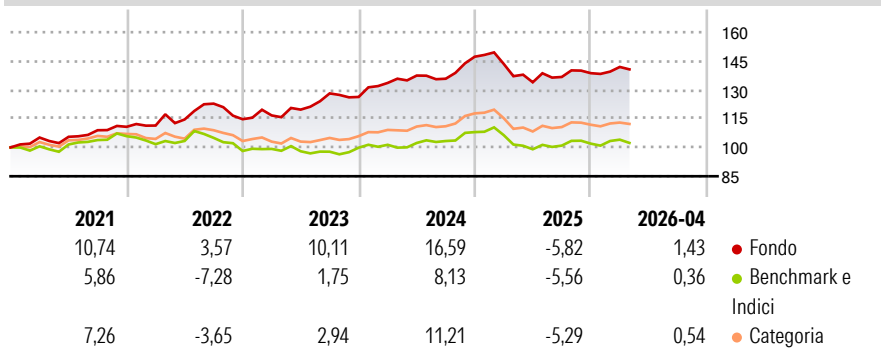
In circostanze normali, il Fondo investe principalmente in titoli ipotecari e altri titoli garantiti da attività. Il Fondo può investire sia in titoli aventi rating più elevati (Investment Grade) sia in titoli ad alto rendimento, aventi rating più basso (inferiore a Investment Grade) e, pertanto, in 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	4,08	3Y Sharpe Ratio	0,54
3Y Beta	0,21	3Y Std Dev	7,11
3Y R-Squared	23,08	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	1,13	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	4,84	10Y Risk	Alto

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

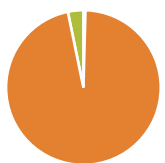
Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,57	0,19	0,72	2026	2,33	-	-	-
6-Mesi	0,80	-1,00	-0,24	2025	-2,55	-6,66	2,07	1,45
1-Anno	0,38	-0,29	0,26	2024	5,79	2,86	-1,20	8,44
3-Anni Ann.ti	5,95	0,84	2,84	2023	1,72	2,60	7,04	-1,44
5-Anni Ann.ti	6,42	0,77	2,39	2022	0,59	2,84	7,19	-6,60
10-Anni Ann.ti	4,49	1,31	2,77					

Rendimenti aggiornati al 12/05/2026

Portafoglio 31/03/2026



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

Fixed Income Style

Box™

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi
Alto	Med	
		Alto
		Med
		Basso

	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...	—	2,29
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 %

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

Coupon 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 %

	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)	1,81 USD	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	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 (12/05/2026)	EUR 21,35				

AB FCP I - Mortgage Income Portfolio I2 EUR Acc

Patrimonio Netto (Mln) 1.714,08 USD

(31/03/2026)