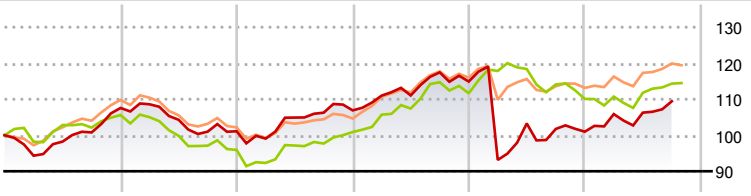
AB FCP I - Mortgage Income Portfolio C2X Acc

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Obbligazionari Flessibili USD	Morningstar US Core Bond TR USD Usato nel Report	Secured Overnight Financing Rate(SOFR)	Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

In circostanze normali, il Fundo 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



2016	2017	2018	2019	2020	2021-10	
7,58	-6,02	5,73	7,49	-12,11	8,51	Fondo
5,61	-9,18	5,18	10,65	-1,38	-	Benchmark e Indici
9,98	-6,66	2,73	11,02	-2,67	-	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	-2,70	3Y Sharpe Ratio	0,14
3Y Beta	0,83	3Y Std Dev	14,65
3Y R-Squared	4,02	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-0,34	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	13,58	10Y Risk	-

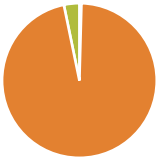
Basati su Morningstar US Core Bond TR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,85	0,36	0,53
6-Mesi	4,83	-0,85	-0,28
1-Anno	7,23	0,63	1,48
3-Anni Ann.ti	0,50	0,83	2,98
5-Anni Ann.ti	1,08	0,83	2,54
10-Anni Ann.ti	3,87	1,31	2,81

Rendimenti aggiornati al 19/10/2021

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-	-	-	-
2024	-	-	-	-
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-

Portafoglio 31/03/2026



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

Fixed Income Style Box™

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

Credit Quality %	Fondo	Credit Quality %	Fondo
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.
Telefono	+352 46 39 36 151
Web	www.abglobal.com
Data di Partenza	17/10/2005
Nome del Gestore	Michael Canter Charlie Choi Daniel Krup
Data Inizio Gestione	01/01/2014
NAV (19/10/2021)	USD 17,57
Patrimonio Classe (Mln) (20/10/2021)	0,07 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0231613380
Investimento Min. Ingresso	2.000 USD
Investimento Min. Successivo	750 USD
T.E.R.	-
Spese correnti	1,75%
Commissione di incentivo	-

© 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 C2X Acc

Patrimonio Netto (Mln)	1.714,08 USD
(31/03/2026)	

© 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.