

AB - Mortgage Income Portfolio I2 USD Acc

Morningstar Medalist Rating™
Neutral

Morningstar Categorie Index
Morningstar US Core Bond TR USD
Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds
Secured Overnight Financing Rate(SOFR)

Morningstar Rating™
★★★★★

Morningstar Categorie™
Obligaties USD Flexibel

Beleggingsdoelstelling

This fund is for non U.S. investors seeking the highest level of current income, consistent with low volatility of net assets value, that is available from a portfolio consisting primarily of high quality mortgage-related securities. In addition, the Portfolio may invest in United States Government Treasury securities.

	2019	2020	2021	2022	2023	03/24	Rendement
	8.52	-11.27	11.08	3.72	9.63	5.82	Fonds
	-2.13	-9.89	5.21	11.00	7.88	4.30	+/- Index
	-2.50	-8.60	3.82	7.36	6.69	2.71	+/- Categorie
	72	97	8	7	2	4	Percentiel Score

Risicomaatstaven				Rendementen (26 apr 2024)				Kwartaalrendementen				
Alpha	3.56	Sharpe Ratio	0.92	Rend %	+/-Idx	+/-Cat		1e kw	2e kw	3e kw	4e kw	
Beta	0.23	Std Deviatie	7.81	3 Maanden	4.17	4.42	2.91	2024	5.82	-	-	-
R-kwadraat	22.57	3-jr Risico	Laag	6 Maanden	5.54	2.20	0.97	2023	1.24	2.80	6.84	-1.40
Informatie Ratio	1.27	5-jr Risico	Hoog	1 jaar	16.68	14.65	9.18	2022	-0.09	3.64	6.95	-6.35
Tracking Error	6.18	10-jr Risico	Hoog	3 jr gean.	9.75	9.32	6.55	2021	5.06	0.59	3.24	1.81
				5 jr gean.	4.41	3.69	1.86	2020	-18.72	11.10	-1.23	-0.51

Berekeningen met Morningstar US Core Bd TR USD (waar van toepassing)

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.98	0.00	0.98
Obligaties	97.75	12.95	84.81
Kas/ geldmarkt	15.32	1.11	14.21
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™

Hoog

Laag

Gem

Rentegevoeligheid

Tijdsduur

Effectieve Looptijd

Gem Krediet

Kwaliteit

-

-

BB

Kredietkwalite it

	% Oblg	% Oblg	
AAA	45.40	BBB	15.60
AA	4.97	BB	6.74
A	11.30	B	2.45
		Below B	3.09
		Geen Rating	10.45

Data per31 mrt 2024

Top 10 Onderliggende posities		% Port	Maturity-verdeling		% Oblg	Couponverdeling		% Oblg
Federal National Mortgage Association...		3.02	1 tot 3 jaar		0.58	0% PIK		4.35
Government National Mortgage Association.		2.99	3 tot 5 jaar		10.19	0% tot 4%		12.99
Government National Mortgage Association.		2.12	5 tot 7 jaar		4.48	4% tot 6%		19.79
PIKES PEAK CLO 8 LLC 6.7494%2034-07-20		1.21	7 tot 10 jaar		12.01	6% tot 8%		23.27
Federal Home Loan Mortgage Corp....		1.15	10 tot 15 jaar		16.66	8% tot 10%		14.31
Freddie Mac Stacr Remic Trust...		0.99	15 tot 20 jaar		15.09	10% tot 12%		7.32
GOLDENTREE LOAN OPPORTUNITIES XI Ltd/		0.96	20 tot 30 jaar		26.54	Meer dan 12%		17.97
Freddie Mac Stacr Remic Trust...		0.94	Meer dan 30 jaar		14.34			
Federal Home Loan Mortgage Corp....		0.91						
Federal Home Loan Mortgage Corp....		0.91						
Totaal Aantal Aandelen		6						
Totaal Aantal Obligaties		360						
% Van Vermogen In Top 10 Posities		15.21						

Fondsinformatie

Fondsgroep	AllianceBernstein...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	1,000,000
Telefoon	+352 46 39 36 151	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	www.abglobal.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	20 feb 2014	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Michael Canter	ISIN	LU1021292617		
Aanvangsdatum	1 jan 2014				
Koers (26 apr 2024)	USD 21.97				
Fondsvermogen (mln)	USD 195.38				

*To view the complete Morningstar Analyst Rating™ Research Report for this fund, please [Click here to read a detailed report on this fund.](#)

© 2024 Morningstar Benelux. Alle rechten voorbehouden. De informatie aangaande beleggingsfondsen en de fondsportefeuille in dit document weergegeven: (1) is eigendom van Morningstar en is in licentie verstrekt, (2) mag uitsluitend gebruikt worden conform de contractueel opgestelde licentievoorwaarden, (3) dient informatieve doeleinden en mag niet opgevat worden als beleggingsadvies van Morningstar, (4) is met grote zorg samengesteld maar kan desondanks onjuistheden bevatten. Morningstar aanvaardt geen enkele aansprakelijkheid voor beslissingen gebaseerd op de weergegeven informatie.