

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund A USD Acc

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001010

Benchmark Morningstar

Morningstar US Conservative Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

Morningstar Rating™

★★★★★

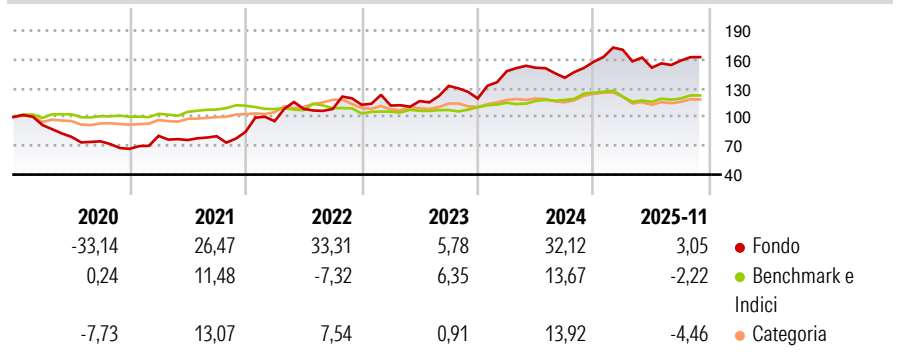
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

L'obiettivo è produrre rendimenti elevati, rettificati per il rischio, mantenendo al contempo una correlazione con i mercati tradizionali che si avvicina allo zero. Ciascuno Stile utilizza posizioni "long" e "short" (per beneficiare sia della performance positiva che di quella negativa) nell'ambito dei seguenti gruppi di attivi (Gruppi di Attivi): azioni (principalmente emesse da società ad alta e media capitalizzazione), obbligazioni (compresi i titoli di stato USA e i titoli di debito sovrano emessi da altri paesi sviluppati), tassi di interesse e valute.

Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha | 11,63 | 3Y Sharpe Ratio | 0,53 |
| 3Y Beta | -0,45 | 3Y Std Dev | 16,32 |
| 3Y R-Squared | 4,37 | 3Y Risk | Alto |
| 3Y Info Ratio | 0,47 | 5Y Risk | Alto |
| 3Y Tracking Error | 15,17 | 10Y Risk | Alto |

Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rendimenti


| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|-------|--------|-------|-------|
| 3-Mesi | 4,31 | 2,79 | 3,80 | 2025 | 7,90 | -10,95 | 4,84 | - |
| 6-Mesi | 0,72 | 4,55 | 2,93 | 2024 | 23,82 | 2,43 | -6,90 | 11,88 |
| 1-Anno | 2,98 | -2,48 | -2,75 | 2023 | -0,73 | 4,15 | 13,60 | -9,94 |
| 3-Anni Ann.ti | 13,01 | 4,48 | 4,14 | 2022 | 13,03 | 13,41 | -0,04 | 4,04 |
| 5-Anni Ann.ti | 19,18 | 3,99 | 8,97 | 2021 | 20,15 | -5,45 | 5,28 | 5,74 |
| 10-Anni Ann.ti | 3,53 | 3,89 | 3,30 | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 05/12/2025

Portafoglio -
Asset Allocation %
Netta
Fixed Income Style
Box™

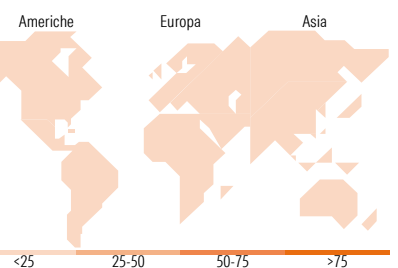
| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |
| | | | | |

Qualità Credito: Alto, Med, Basso
Sensibilità ai Tassi: Basso, Med, Alto

Duration Effettiva

Maturità effettiva

Qualità Credito Media

Fondo

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|------|
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 0,00 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | - |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | - |

Fixed Income Sector Weightings %
Fondo

| | |
|--------------------------|------|
| Governativo | 0,00 |
| Societario | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 0,00 |
| Derivati | 0,00 |

Coupon Range %
Fondo

| | |
|-------------------|------|
| 0 coupon | 0,00 |
| Da 0 a 4 cedole | 0,00 |
| Da 4 a 6 cedole | 0,00 |
| Da 6 a 8 cedole | 0,00 |
| Da 8 a 10 cedole | 0,00 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,00 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

Ripartizione Geografica %
Fondo

| | |
|-------------------------------|-------------|
| America | 0,00 |
| Stati Uniti | - |
| Canada | - |
| America Latina e Centrale | - |
| Europa | 0,00 |
| Regno Unito | - |
| Europa Occidentale - Euro | - |
| Europa Occidentale - Non Euro | - |
| Europa dell'Est | - |
| Africa | - |
| Medio Oriente | - |
| Asia | 0,00 |
| Giappone | - |
| Australasia | - |
| Asia - Paesi Sviluppati | - |
| Asia - Emergente | - |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|----------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------------|
| Società di Gestione | AQR Capital Management LLC | Patrimonio Classe (Mln) | 12,50 USD | Investimento Min. Ingresso | 100.000 USD |
| Telefono | 1 (203) 742-3600 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | http://www.aqr.com/ | Valuta del Fondo | USD | T.E.R. | 1,73% |
| Data di Partenza | 21/01/2015 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,76% |
| Nome del Gestore | - | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | 10,00% |
| Data Inizio Gestione | 01/10/2014 | ISIN | LU1103258601 | | |
| NAV (05/12/2025) | USD 165,67 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | - | | | | |