

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund Class E EUR Acc

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target
Allocation NR EUR
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

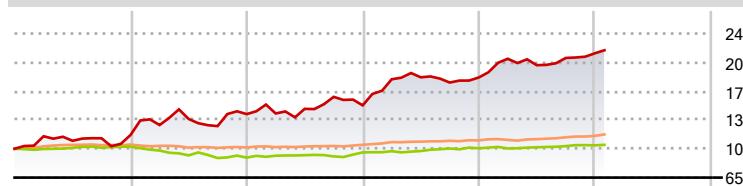
Morningstar Rating™

★★★

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.

Rendimenti



2021	2022	2023	2024	2025	2026-01	Fondo
16,83	21,65	7,46	22,16	15,75	1,73	● Fondo
2,55	-12,96	7,12	5,19	3,58	0,62	● Benchmark e Indici
		4,15	-2,50	5,57	4,99	● Categorie

Misure di Rischio

3Y Alpha	13,15	3Y Sharpe Ratio	0,92
3Y Beta	-0,92	3Y Std Dev	12,62
3Y R-Squared	8,01	3Y Risk	Alto
3Y Info Ratio	0,71	5Y Risk	Alto
3Y Tracking Error	14,19	10Y Risk	Alto

Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,60	0,59	2,78	2026				
6-Mesi	8,39	2,44	5,76	2025	12,18	-3,72	4,37	2,68
1-Anno	14,37	3,24	6,35	2024	20,76	1,29	-3,41	3,40
3-Anni Ann.ti	15,37	4,47	5,50	2023	0,54	3,92	9,83	-6,35
5-Anni Ann.ti	16,50	0,93	4,27	2022	10,27	5,75	-6,38	11,43
10-Anni Ann.ti	2,69	2,13	2,25					

Rendimenti aggiornati al 04/02/2026

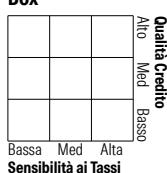
Portafoglio -

Asset Allocation %

Netta

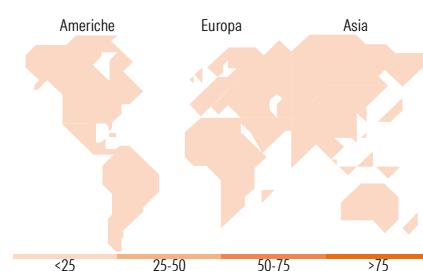
Fixed Income Style

Box™



Duration Effettiva
Maturity 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

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 - Emergenti	-

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln) (04/02/2026)	267,39 EUR	Investimento Min. Ingresso	80.000.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	1,70%
Data di Partenza	03/12/2014	UCITS	Si	Spese correnti	0,66%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1103259088		
NAV (04/02/2026)	EUR 146,63				
Patrimonio Netto (Mln)	-				