

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund F GBP

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001009

Benchmark Morningstar

Morningstar UK Cautious Target Allocation N/A

NR GBP

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

Morningstar Rating™

★★★★

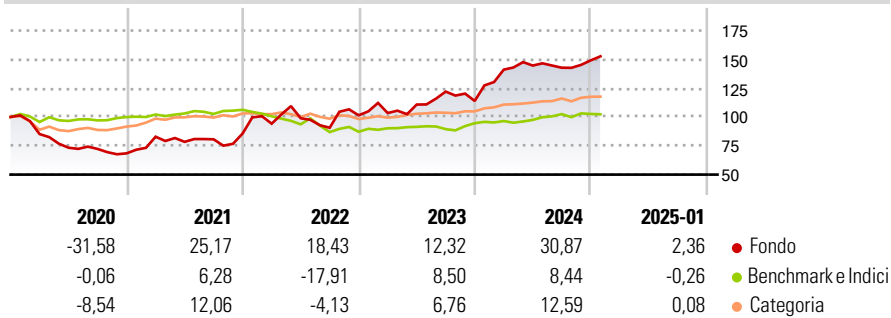
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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	11,43	3Y Sharpe Ratio	0,73
3Y Beta	-0,14	3Y Std Dev	18,73
3Y R-Squared	0,24	3Y Risk	Alto
3Y Info Ratio	0,85	5Y Risk	Alto
3Y Tracking Error	18,66	10Y Risk	Alto

Basati su Morningstar UK Cautious Target Allocation NR GBP (dove applicabile)

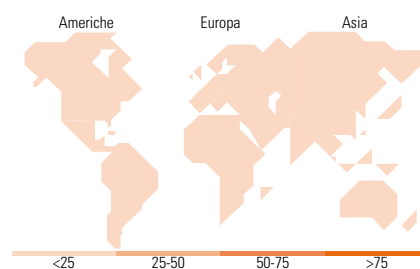
Rendimenti


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	5,84	2,59	3,33	2025	-	-	-	-
6-Mesi	8,98	3,90	5,91	2024	23,84	2,49	-1,30	4,47
1-Anno	18,95	7,77	10,19	2023	1,95	7,12	10,16	-6,63
3-Anni Ann.ti	15,45	0,19	4,75	2022	9,97	5,03	-8,37	11,90
5-Anni Ann.ti	9,25	0,24	4,67	2021	21,14	-5,41	2,82	6,24
10-Anni Ann.ti	2,51	0,68	1,17					

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Portafoglio -
Asset Allocation % Netta
Fixed Income
Style Box™


Sensibilità ai Tassi

Fondo
 Duration Effettiva -
 Maturity effettiva -
 Qualità Credito Media

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)	71,61 GBP	Investimento Min. Ingresso	70.000.000 GBP
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	100.000 GBP
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	GBP	T.E.R.	-
Data di Partenza	01/10/2014	UCITS	Si	Spese correnti	0,69%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1103259161		
NAV (04/02/2025)	GBP 145,61				
Patrimonio Netto (Mln)	-				