AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund H

Allocation NR EUR Usato nel Report

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Benchmark Dichiarato

Morningstar Rating™

Senza 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 | -6,01 | 3Y Sharpe Ratio | -1,09 |
| 3Y Beta | 0,02 | 3Y Std Dev | 5,44 |
| 3Y R-Squared | 0,01 | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | -1,68 | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | 5,89 | 10Y Risk | - |
| Basati su Morningstar Euro applicabile) | Cautious | Global Target Allocation NR | EUR (dove |

| endimenti | | | | | | |
|-----------|------|------|--------|--------|--------------|--|
| | | | | . | | 120 |
| | | | | | <i>e</i> | 110 |
| | | | | · | - | 100 |
| | | | | ~ | | 90 |
| | | | | | | -80 |
| 2015 | 2016 | 2017 | 2018 | 2019 | 2020-01 | |
| - | - | - | -12,06 | -12,35 | 0,51 | Fondo |
| - | - | - | -1,37 | 8,37 | - | Benchmark e Indici |
| - | - | _ | -4.55 | 6.27 | - | Categoria |

| Danid O | Familia | Dl. | 0-4 | D di | 04 | | 02 | |
|---------------------------------|---------|------|------|---------------|----|----|----|----|
| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
| 3-Mesi | -2,33 | 1,28 | 2,37 | Trimestrali % | | | | |
| 6-Mesi | -3,71 | 2,70 | 3,20 | 2025 | - | - | - | - |
| 1-Anno | -11,96 | 2,28 | 4,22 | 2024 | - | - | - | - |
| 3-Anni Ann.ti | -6,26 | 4,30 | 4,74 | 2023 | - | - | - | - |
| 5-Anni Ann.ti | - | 0,91 | 4,02 | 2022 | - | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - | 2021 | - | - | - | - |
| Rendimenti aggiornati al 18/02/ | 2020 | | | | | | | |

Portafoglio

| ccat | ۸۱۱۸ | cation | 0/_ | Net |
|------|------|--------|-----|-----|
| SSET | AIIO | canon | 7/0 | Net |

Fixed Income Style



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 Obbligaz | ionari | - |

| 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 |

| | -, |
|-------------------|-------|
| 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 |
| Telefono | 1 (203) 742-3600 |
| Web | http://www.aqr.com/ |
| Data di Partenza | 23/01/2017 |
| Nome del Gestore | - |
| Data Inizio Gestione | 01/10/2014 |
| NAV (18/02/2020) | EUR 83,68 |
| Patrimonio Netto (MIn) | - |

| Patrimonio Classe (MIn) | 18,02 USD |
|-------------------------|--------------|
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | EUR |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Inc |
| ISIN | LU1278923344 |
| | |

| Investimento Min. Ingresso | 80.000.000 EUR |
|------------------------------|----------------|
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | - |
| Spese correnti | 0,69% |
| Commissione di incentivo | 10.00% |