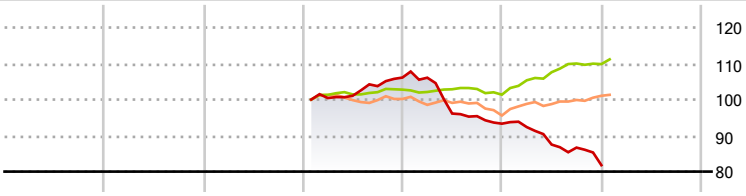
AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund H

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Alt - Multistrategy	Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report	N/A	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.

Rendimenti



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

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 Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-2,33	2,13	2,07
6-Mesi	-3,71	2,92	2,82
1-Anno	-11,96	6,10	5,95
3-Anni Ann.ti	-6,26	0,70	2,84
5-Anni Ann.ti	-	0,78	2,51
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 18/02/2020

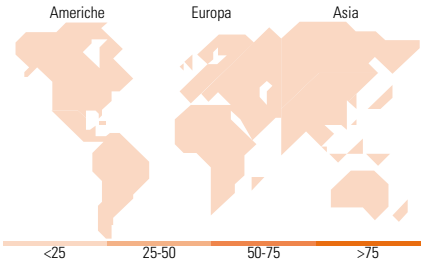
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	-	-	-	-
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-
2021	-	-	-	-

Portafoglio -

Asset Allocation %	Netta

Fixed Income Style Box™

Fixed Income	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
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 (Mln)	-

Patrimonio Classe (Mln) (19/02/2020)	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%

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.