

# AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund H

## Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

## Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

N/A

## Morningstar Rating™

Senza rating

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

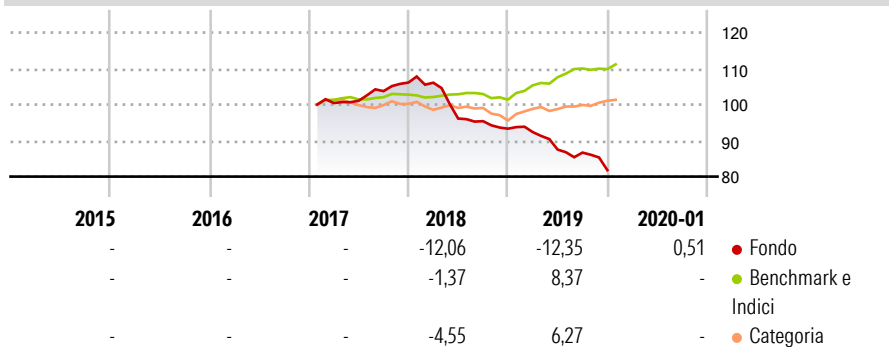
L'obiettivo è produrre rendimenti elevati, rettificati per il rischio, mantenendo al contempo una correlazione con i mercati tradizionali che si avvicina allo zero. Ciascuno Stile utilizza posizioni "long" e "short" (per beneficiare sia della performance positiva che di quella negativa) nell'ambito dei 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 Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

### Rendimenti



### Rend. Cumulati %

|                | Fondo  | Bmk  | Cat  |
|----------------|--------|------|------|
| 3-Mesi         | -2,33  | 1,00 | 0,95 |
| 6-Mesi         | -3,71  | 0,23 | 0,26 |
| 1-Anno         | -11,96 | 2,95 | 3,49 |
| 3-Anni Ann.ti  | -6,26  | 3,49 | 3,84 |
| 5-Anni Ann.ti  | -      | 1,00 | 3,52 |
| 10-Anni Ann.ti | -      | -    | -    |

Rendimenti aggiornati al 18/02/2020

### Rendimenti Trimestrali %

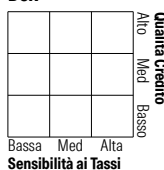
|      | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|----|----|----|----|
| 2025 | -  | -  | -  | -  |
| 2024 | -  | -  | -  | -  |
| 2023 | -  | -  | -  | -  |
| 2022 | -  | -  | -  | -  |
| 2021 | -  | -  | -  | -  |

### Portafoglio -

#### Asset Allocation %

Netta

#### Fixed Income Style Box™

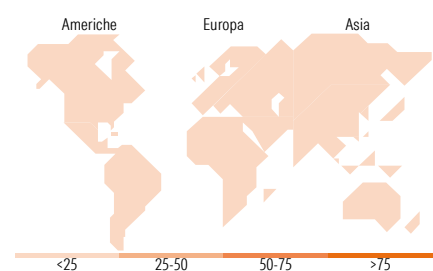


Duration Effettiva

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

### Anagrafica

|                        |                            |                         |              |                              |                |
|------------------------|----------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|----------------|
| Società di Gestione    | AQR Capital Management LLC | Patrimonio Classe (Mln) | 18,02 USD    | Investimento Min. Ingresso   | 80.000.000 EUR |
| Telefono               | 1 (203) 742-3600           | (19/02/2020)            |              | Investimento Min. Successivo | -              |
| Web                    | http://www.aqr.com/        | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                       | -              |
| Data di Partenza       | 23/01/2017                 | Valuta del Fondo        | EUR          | Spese correnti               | 0,69%          |
| Nome del Gestore       | -                          | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | 10,00%         |
| Data Inizio Gestione   | 01/10/2014                 | Inc/Acc                 | Inc          |                              |                |
| NAV (18/02/2020)       | EUR 83,68                  | ISIN                    | LU1278923344 |                              |                |
| Patrimonio Netto (Mln) | -                          |                         |              |                              |                |