

AQR UCITS Funds II - AQR Sustainable Style Premia Global Equity UCITS C2 GBP

Categoria Morningstar™

Azionari Internazionali Large Cap Value

Benchmark Morningstar

Morningstar Global Value Target Market

Exposure NR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

MSCI World NR EUR

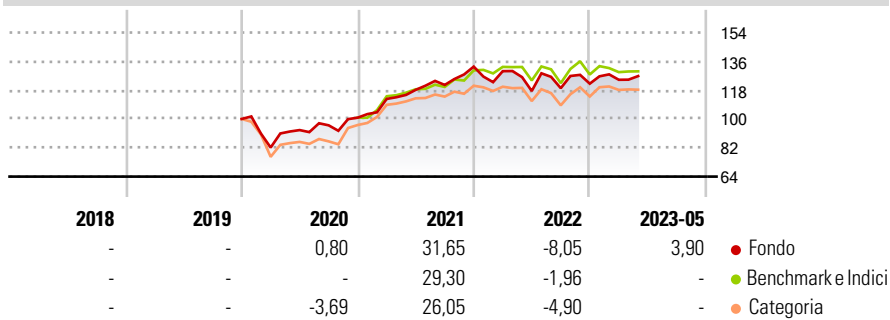
Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The investment objective of the Fund is to outperform the MSCI World Index (total return net dividends, unhedged) (the "Benchmark"), on a risk adjusted basis, while promoting environmental and social characteristics. There can be no assurance that the Fund will achieve its investment objective.

Rendimenti



Misure di Rischio

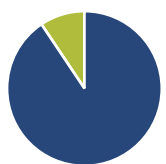
3Y Alpha	-0,64	3Y Sharpe Ratio	0,85
3Y Beta	0,85	3Y Std Dev	13,52
3Y R-Squared	83,91	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-0,35	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	6,76	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Global Value Target Market Exposure NR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	7,34	7,36	6,30	2025	-	-	-	-
6-Mesi	6,95	12,92	10,46	2024	-	-	-	-
1-Anno	9,22	20,39	16,84	2023	2,01	-	-	-
3-Anni Ann.ti	13,16	10,87	8,56	2022	-2,14	-9,56	1,51	2,35
5-Anni Ann.ti	-	10,58	9,27	2021	11,62	5,03	2,60	9,45
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 15/06/2023

Portafoglio 30/06/2024



Asset Allocation %	Netta
● Azioni	90,61
● Obbligazioni	0,00
● Liquidità	9,39
● Altro	0,00

Style Box

Azionaria

Style	Capitalizz.
Value	Large
Blend	Mid
Growth	Small

Value Blend Growth

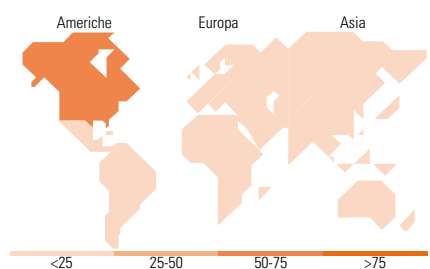
Style

Mkt Cap %

Mkt Cap %	Fondo
Giant	23,52
Large	39,29
Medium	35,17
Small	2,02
Micro	0,00

Capitalizzazione media di mercato

Capitalizzazione media di mercato	Fondo
Ave Mkt Cap USD	79.311,27



Titoli principali

Nome	Settore	%
NVIDIA Corp	📄	3,63
Microsoft Corp	📄	3,42
Apple Inc	📄	3,21
Alphabet Inc Class A	📄	2,61
Amazon.com Inc	📄	1,33
The Cigna Group	🏠	1,29
Cisco Systems Inc	📄	1,29
McKesson Corp	🏠	1,27
Zoom Video Communications Inc	📄	1,21
Cardinal Health Inc	🏠	1,20
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		20,45
Numero Complessivo di Titoli Azionari		208
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

Distribuzione Settoriale %

Distribuzione Settoriale %	Fondo
Ciclico	30,14
🏠 Materie Prime	2,49
🏠 Beni di Consumo Ciclici	6,74
🏠 Finanza	20,71
🏠 Immobiliare	0,20
Sensibile	49,24
📄 Telecomunicazioni	6,46
🏠 Energia	3,87
🏠 Beni Industriali	11,88
📄 Tecnologia	27,02
Difensivo	20,63
🏠 Beni Difensivi	5,69
🏠 Salute	14,76
🏠 Servizi di Pubblica Utilità	0,18

Ripartizione Geografica %

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	72,59
Stati Uniti	70,35
Canada	2,23
America Latina e Centrale	0,00
Europa	18,67
Regno Unito	4,32
Europa Occidentale - Euro	10,44
Europa Occidentale - Non Euro	3,91
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	8,75
Giappone	6,70
Australasia	1,26
Asia - Paesi Sviluppati	0,46
Asia - Emergente	0,33

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	7,78 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 GBP
Telefono	1 (203) 742-3600	(15/06/2023)		Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	17/10/2019	Valuta del Fondo	GBP	Spese correnti	0,35%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	08/09/2015	Inc/Acc	Acc		
NAV (15/06/2023)	GBP 135,70	ISIN	LU1285432792		
Patrimonio Netto (Mln)	346,66 USD				

(30/06/2024)