## **AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund N CHF**

Categoria Morningstar™

**Benchmark Morningstar** 

**Benchmark Dichiarato** 

Morningstar Rating™

Category\_EUCA001011

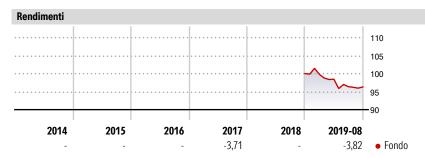
Not Categorized Usato nel Report

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



Misure di Rischio			
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,64
3Y Beta	-	3Y Std Dev	5,42
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-0.71	Trimestrali %	Ų	ŲΖ	QJ	Q4
3-IVIESI	-0,71	Trimestran %				
6-Mesi	-3,33	2025	-	-	-	-
1-Anno	-4,81	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-3,84	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	2021	-	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 11/09/2019						

## Portafoglio

**Asset Allocation %** Netta





Fondo **Duration Effettiva** Maturity effettiva Qualità Credito Media



Nome	Settore	%
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		0,00
Numero Complessivo di Titoli Azionari -		
Numero Complessivo di Titoli Obbliga:	zionari	-

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

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	01/02/2016
Nome del Gestore	=
Data Inizio Gestione	01/10/2014
NAV (11/09/2019)	CHF 83,86
Patrimonio Netto (MIn)	-

Patrimonio Classe (Mln)	4,78 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	CHF
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1322539435

Investimento Min. Ingresso	100.000.000 CHF
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	0,69%
Commissione di incentivo	10.00%