AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund W EUR

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Benchmark Dichiarato

Morningstar Rating™

Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report 7

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 Rischi	0		
3Y Alpha	11,00	3Y Sharpe Ratio	0,80
3Y Beta	-0,48	3Y Std Dev	12,84
3Y R-Squared	2,76	3Y Risk	Alto
3Y Info Ratio	0,61	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	14,22	10Y Risk	-
Basati su Morningstar Eur applicabile)	o Cautious	Global Target Allocation Ni	R EUR (dove

endimenti						
						172
					~~~	154
				الرسيم		136
						118
						100
						-82
2020	2021	2022	2023	2024	2025-11	
-	=	-	7,31	21,93	13,40	<ul><li>Fondo</li></ul>
-	-	-	7,12	5,19	3,85	<ul> <li>Benchmark e Indici</li> </ul>

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	2,92	1,28	2,37	Trimestrali %				
6-Mesi	1,21	2,70	3,20	2025	12,16	-3,75	4,33	-
1-Anno	11,13	2,28	4,22	2024	20,68	1,25	-3,45	3,36
3-Anni Ann.ti	14,63	4,30	4,74	2023	0,40	4,00	9,78	-6,39
5-Anni Ann.ti	=	-	-	2022	=	-	-6,95	12,36
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	-	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 05/12/20	)25							

## Portafoglio

ccat	Allac	ation	. 0/.	N	let
SSAT	AHO	:anor	1 %	- IN	нτ

Fixed Income Style



Da 6 a 8 cedole

Da 8 a 10 cedole

Da 10 a 12 cedole

Oltre 12 cedole

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media

**Fondo** 

0,00

0,00

0,00

0,00



Titoli principali		
Nome	Settore	%
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		0,00
Numero Complessivo di Titoli Aziona	ri	-
Numero Complessivo di Titoli Obbliga	zionari	-

<b>₩</b> 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

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	21/06/2022
Nome del Gestore	=
Data Inizio Gestione	01/10/2014
NAV (05/12/2025)	EUR 146,88
Patrimonio Netto (MIn)	=

Patrimonio Classe (MIn)	0,55 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1543584988

Investimento Min. Ingresso	100.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	1,54%
Spese correnti	0,81%
Commissione di incentivo	10,00%