AQR Delphi Long-Short Equity UCITS Fund RAU1 Acc

Categoria Morningstar™

Alt - Long/Short Azionario Internazionale

Benchmark Morningstar

Morningstar Global Target Market Exposure NR USD Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

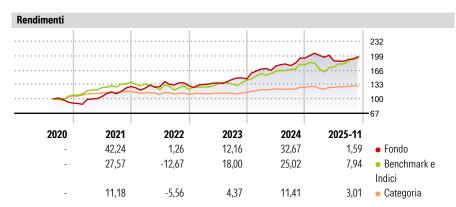
50% MSCI World 100% Hdg NR EUR, 50% ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

Morningstar Rating™

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The investment objective of the Fund is to provide investors with returns from potential gains from its long and short positions. The Fund seeks capital appreciation by investing on a long basis in attractively valued, high quality and low beta assets and on a short basis in expensive, low quality, and high beta assets, while following the approach. The Fund aims at targeting an average beta exposure of between 0.4 and 0.6 to a composite global equity market index, as defined for each Class of Shares in the table "Summary of Shares, Fees and Expenses" set out below (the "Benchmark"). There can be no assurance that the Fund will achieve its investment objective.

| Misure di Rischio |) | | |
|-----------------------------|--------------|------------------------------|--------------|
| 3Y Alpha | 10,34 | 3Y Sharpe Ratio | 0,91 |
| 3Y Beta | 0,10 | 3Y Std Dev | 10,72 |
| 3Y R-Squared | 1,90 | 3Y Risk | -Med |
| 3Y Info Ratio | -0,09 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 13,20 | 10Y Risk | - |
| Basati su Morningstar Globa | al Target Ma | rket Exposure NR USD (dove a | applicabile) |



| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti | Q1 | Q2 |
|---------------------------------|-------|-------|-------|---------------|-------|-------|
| 3-Mesi | 0,12 | 4,03 | -2,33 | Trimestrali % | | |
| 6-Mesi | -0,57 | 11,32 | -1,48 | 2025 | 3,22 | -6,35 |
| 1-Anno | -1,62 | 5,08 | -3,06 | 2024 | 15,37 | 4,13 |
| 3-Anni Ann.ti | 12,70 | 14,92 | 5,04 | 2023 | 2,32 | 2,62 |
| 5-Anni Ann.ti | 16,17 | 12,33 | 4,76 | 2022 | -2,77 | 2,59 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - | 2021 | 9,68 | 6,22 |
| Rendimenti aggiornati al 12/12/ | 2025 | | | | | |

Portafoglio 31/03/2025





| Mkt Cap % | Fondo |
|------------------|-------|
| Giant | 3,08 |
| Large | 17,52 |
| Medium | 32,84 |
| Small | 26,71 |
| Micro | 19,85 |
| Canitalizzazione | Fondo |





Q3

1,81

0,64

6,04

3,04 -1,47

6,24 14,92

Q4

9,73

0,73

| Titoli principali | | |
|---------------------------------------|---------|-------|
| Nome | Settore | % |
| United States Treasury Bills | _ | 5,61 |
| United States Treasury Bills | _ | 5,47 |
| United States Treasury Bills | _ | 4,73 |
| United States Treasury Bills | _ | 4,57 |
| United States Treasury Bills | _ | 4,00 |
| United States Treasury Bills | = | 3,76 |
| United States Treasury Bills | _ | 3,67 |
| United States Treasury Bills | _ | 3,21 |
| United States Treasury Bills | _ | 3,19 |
| United States Treasury Bills | _ | 2,84 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 41,05 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 3.820 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligaz | ionari | 26 |

| Distribuzione Settoriale % | Fondo |
|-----------------------------|-------|
| % Ciclico | 32,96 |
| A Materie Prime | 9,68 |
| 🔼 Beni di Consumo Ciclici | 13,55 |
| 🚅 Finanza | 8,22 |
| | 1,51 |
| ₩ Sensibile | 50,86 |
| Telecomunicazioni | 3,14 |
| Tenergia | 1,54 |
| 🜣 Beni Industriali | 21,75 |
| Tecnologia | 24,43 |
| → Difensivo | 16,18 |
| 🔚 Beni Difensivi | 2,02 |
| Salute | 12,63 |
| Servizi di Pubblica Utilità | 1,53 |

| Ripartizione Geografica % | Fondo | |
|-------------------------------|-------|--|
| America | 57,89 | |
| Stati Uniti | 54,12 | |
| Canada | 3,30 | |
| America Latina e Centrale | 0,47 | |
| Europa | 25,40 | |
| Regno Unito | 4,58 | |
| Europa Occidentale - Euro | 12,89 | |
| Europa Occidentale - Non Euro | 7,92 | |
| Europa dell'Est | 0,01 | |
| Africa | 0,00 | |
| Medio Oriente | 0,00 | |
| Asia | 16,71 | |
| Giappone | 13,72 | |
| Australasia | 2,12 | |
| Asia - Paesi Sviluppati | 0,83 | |
| Asia - Emergente | 0,04 | |

| - ^ | | - | | £: | ca |
|-----|----|----|----|----|----|
| Δ | ms | ın | га | ш | ca |
| | | | | | |

| Società di Gestione | AQR Capital Management |
|----------------------|------------------------|
| | LLC |
| Telefono | 1 (203) 742-3600 |
| Web | http://www.aqr.com/ |
| Data di Partenza | 20/08/2020 |
| Nome del Gestore | = |
| Data Inizio Gestione | 27/08/2018 |
| NAV (12/12/2025) | USD 186,46 |

| Patrimonio Classe (Mln) | 100,50 USD |
|-------------------------------|--------------------|
| Domicilio Valuta del Fondo | LUSSEMBURGO USD |
| UCITS Inc/Acc | Si Acc |
| ISIN | LU2165868832 |
| | |

| Investimento Min. Ingresso | 10.000 USD |
|------------------------------|------------|
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | 1,16% |
| Spese correnti | 0,49% |
| Commissione di incentivo | 20,00% |

AQR Delphi Long-Short Equity UCITS Fund RAU1 Acc

Patrimonio Netto (MIn)

702 22 110

(31/03/2025)

