AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund Class B EUR Acc

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Benchmark Dichiarato

Morningstar Rating™

Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR

Usato nel Report

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	12,46	3Y Sharpe Ratio	0,85		
3Y Beta	-0,45	3Y Std Dev	13,54		
3Y R-Squared	2,28	3Y Risk	Alto		
3Y Info Ratio	0,61	5Y Risk	Alto		
3Y Tracking Error	14,91	10Y Risk	Alto		
Basati su Morningstar Euro applicabile)	o Cautious	Global Target Allocation NF	EUR (dove		

ndimenti						
						169
					<u> </u>	146
			/			123
						100
	~~~~~					77
						<b>-</b> 54
2020	2021	2022	2023	2024	2025-10	
<b>2020</b> -28,24	<b>2021</b> 16,71	<b>2022</b> 23,08	<b>2023</b> 7,79	<b>2024</b> 23,00	- 1	
					2025-10	<b>-</b> 54

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	4,36	1,51	2,37	Trimestrali %				
6-Mesi	3,93	3,26	3,39	2025	12,11	-3,74	4,34	-
1-Anno	14,45	4,03	5,50	2024	21,69	1,26	-3,43	3,36
3-Anni Ann.ti	14,19	5,33	5,22	2023	0,50	4,26	10,75	-7,11
5-Anni Ann.ti	16,17	1,10	4,52	2022	10,51	6,37	-6,93	12,50
10-Anni Ann.ti	2,84	1,95	1,45	2021	15,18	-4,80	2,72	3,62

## Portafoglio

**Asset Allocation %** Netta **Fixed Income Style** 



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



Titoli principali		
Nome	Settore	%
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		0,00
Numero Complessivo di Titoli Azionari Numero Complessivo di Titoli Obbligazi		-

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

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
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	15/10/2014
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014
NAV (07/11/2025)	EUR 143,44
Patrimonio Netto (MIn)	-

Patrimonio Classe (MIn)	114,90 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1103258783

Investimento Min. Ingresso	100.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	2,58%
Spese correnti	0,76%
Commissione di incentivo	10,00%