## **AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund F GBP**

Categoria Morningstar™

Category\_EUCA001009

Benchmark Morningstar

Benchmark Dichiarato

Morningstar Rating™

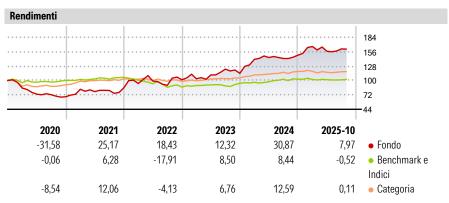
\*\*\*

Morningstar UK Cautious Target Allocation
NR GBP
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	0		
3Y Alpha	12,03	3Y Sharpe Ratio	0,86
3Y Beta	-0,62	3Y Std Dev	14,61
3Y R-Squared	4,56	3Y Risk	Alto
3Y Info Ratio	0,73	5Y Risk	Alto
3Y Tracking Error	15,20	10Y Risk	Alto
Basati su Morningstar UK C	autious Tard	net Allocation NR GBP (dove	applicabile



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,77	0,97	2,53	Trimestrali %				
6-Mesi	1,77	1,15	2,89	2025	11,35	-5,55	2,90	-
1-Anno	11,77	1,40	4,67	2024	23,84	2,49	-1,30	4,47
3-Anni Ann.ti	16,23	5,14	7,85	2023	1,95	7,12	10,16	-6,63
5-Anni Ann.ti	18,38	0,75	8,14	2022	9,97	5,03	-8,37	11,90
10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 04/11/2	1,96	0,06	0,83	2021	21,14	-5,41	2,82	6,24

Fondo

## **Portafoglio**

Asset Allocation %

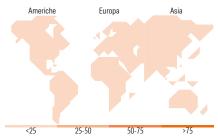
Netta



Fixed Income Sector Weightings %

**Fondo** Duration Effettiva -

Maturity effettiva Qualità Credito Media



litoli principali	0/
Nome Setto	ore %
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	0,00
Numero Complessivo di Titoli Azionari	
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionar	i -

0 coupon	0,00
Coupon Range %	Fondo
	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	0,00
Enti Locali	0,00
★ Cartolarizzazioni	0,00
Societario	0,00
<b>₩</b> Governativo	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	-

AQR Capital Management
LLC
1 (203) 742-3600
http://www.aqr.com/
01/10/2014
=
01/10/2014
GBP 162,81
-

Patrimonio Classe (MIn	) 25,26 GBF
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	GBF
UCITS	S
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU110325916′

Investimento Min. Ingresso	70.000.000 GBP
Investimento Min. Successivo	100.000 GBP
T.E.R.	1,37%
Spese correnti	0,66%
Commissione di incentivo	10,00%