

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund H

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

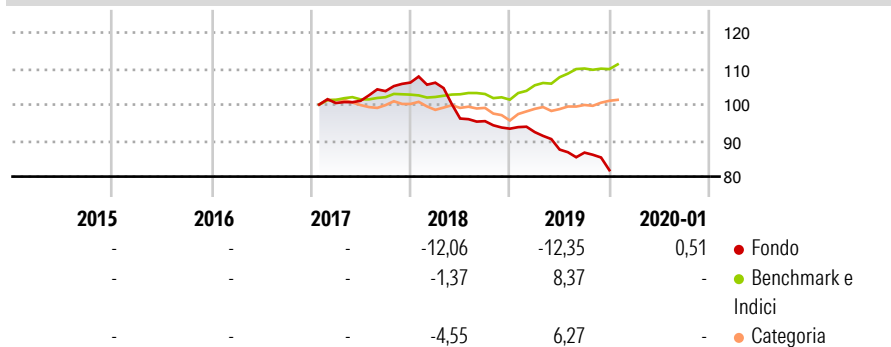
L'obiettivo è produrre rendimenti elevati, rettificati per il rischio, mantenendo al contempo una correlazione con i mercati tradizionali che si avvicina allo zero. Ciascuno Stile utilizza posizioni "long" e "short" (per beneficiare sia della performance positiva che di quella negativa) nell'ambito dei 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 valute.

Misure di Rischio

3Y Alpha	-6,01	3Y Sharpe Ratio	-1,09
3Y Beta	0,02	3Y Std Dev	5,44
3Y R-Squared	0,01	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-1,68	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	5,89	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rendimenti



Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-2,33	-0,14	0,71
6-Mesi	-3,71	0,61	3,77
1-Anno	-11,96	4,22	8,32
3-Anni Ann.ti	-6,26	4,56	6,30
5-Anni Ann.ti	-	1,13	4,11
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 18/02/2020

Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-	-	-	-
2024	-	-	-	-
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-

Portafoglio -

Asset Allocation %

Netta

Fixed Income Style Box™



Duration Effettiva

Maturità effettiva

Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

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

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
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	Patrimonio Classe (Mln)	18,02 USD	Investimento Min. Ingresso	80.000.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	(19/02/2020)		Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	23/01/2017	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,69%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	Inc/Acc	Inc		
NAV (18/02/2020)	EUR 83,68	ISIN	LU1278923344		
Patrimonio Netto (Mln)	-				