AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund H

Allocation NR EUR Usato nel Report

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Benchmark Dichiarato

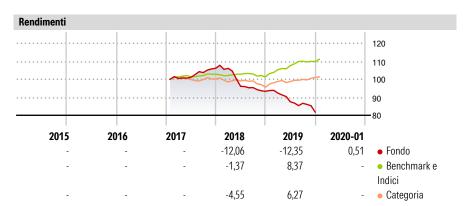
Morningstar Rating™

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)			



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-2,33	1,38	2,50	Trimestrali %				
6-Mesi	-3,71	3,16	4,14	2025	=	-	-	-
1-Anno	-11,96	3,73	5,14	2024	=	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-6,26	4,81	4,96	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	0,98	4,12	2022	=	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	-	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 18/02/2	2020							

Portafoglio

Asset Allocation % Netta

tta 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 %

Prondo

Duration Effettiva

Maturity effettiva

Qualità Credito Media

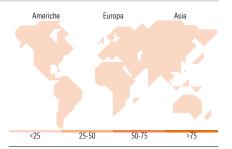
Fondo

0,00

0,00

0,00

0,00



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

₩ 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
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	23/01/2017
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014
NAV (18/02/2020)	EUR 83,68
Patrimonio Netto (MIn)	-

Patrimonio Classe (MIn)	18,02 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Inc
ISIN	LU1278923344

Investimento Min. Ingresso	80.000.000 EUR
Investimento Min. Successivo	=
T.E.R.	-
Spese correnti	0,69%
Commissione di incentivo	10,00%