## **AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund RAE EUR Accumulation**

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

**Benchmark Dichiarato** 

Morningstar Rating™

\*\*\*

Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR

## **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 Rischi   | 0     |                 |       |
|--|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha   | 11,82 | 3Y Sharpe Ratio | 0,84  |
| 3Y Beta  | -0,39 | 3Y Std Dev      | 13,08 |
| 3Y R-Squared   | 1,89  | 3Y Risk         | Alto  |
| 3Y Info Ratio  | 0,60  | 5Y Risk         | Alto  |
| 3Y Tracking Error  | 14,42 | 10Y Risk        | -     |
| Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile) |       |                 |       |

Rendimenti 146 123 100 77 2024 2020 2021 2022 2023 2025-10 -28,29 16,58 22,92 7,08 22,18 12,88 Fondo Benchmark e 3,75 2,55 -12,96 7,12 5,19 3,80 Indici -1,13 4,15 -2,50 3,59 5,57 4,24 Categoria

| Rend. Cumulati %                | Fondo | Bmk  | Cat  | Rendimenti    | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|---------------------------------|-------|------|------|---------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi                          | 3,83  | 1,38 | 2,50 | Trimestrali % |       |       |       |       |
| 6-Mesi                          | 3,83  | 3,16 | 4,14 | 2025          | 12,18 | -3,76 | 4,31  | -     |
| 1-Anno                          | 14,64 | 3,73 | 5,14 | 2024          | 21,02 | 1,22  | -3,49 | 3,34  |
| 3-Anni Ann.ti                   | 15,26 | 4,81 | 4,96 | 2023          | 0,45  | 4,14  | 9,76  | -6,74 |
| 5-Anni Ann.ti                   | 16,12 | 0,98 | 4,12 | 2022          | 10,50 | 6,31  | -6,95 | 12,47 |
| 10-Anni Ann.ti                  | -     | -    | -    | 2021          | 15,13 | -4,81 | 2,70  | 3,58  |
| Rendimenti aggiornati al 14/11/ | 2025  |      |      |               |       |       |       |       |

## Portafoglio

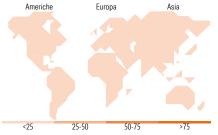
Asset Allocation % Netta

a 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 Azionar  | i       | -    |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligaz | ionari  | -    |

| 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 |  |
| •                                |       |  |

|                   | 0,00  |
|-------------------|-------|
| 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       | 19/10/2017             |
| Nome del Gestore       | =                      |
| Data Inizio Gestione   | 01/10/2014             |
| NAV (14/11/2025)       | EUR 121,31             |
| Patrimonio Netto (MIn) | -                      |

| 2,80 EUR     |
|--------------|
| USSEMBURGO   |
| EUR          |
| Si           |
| Acc          |
| LU1662506093 |
|              |
|              |

| nvestimento Min. Ingresso   | 10.000 EUR |
|-----------------------------|------------|
| nvestimento Min. Successivo | -          |
| Г.Е.R.                      | 1,78%      |
| Spese correnti              | 0,86%      |
| Commissione di incentivo    | 10,00%     |
|                             |            |