

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund RAEF EUR Accumulation

Categoria Morningstar™

Alt - Multistrategy

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target
Allocation NR EUR
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

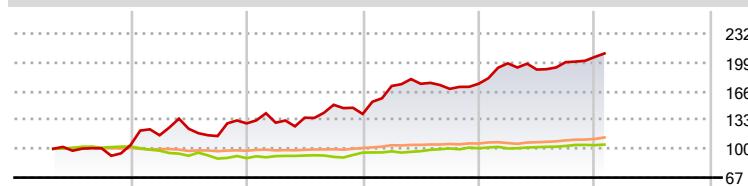
Morningstar Rating™

★★★★

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.

Rendimenti



2021	2022	2023	2024	2025	2026-01	Fondo
-	23,71	8,33	24,79	17,57	1,94	● Fondo
-	-12,96	7,12	5,19	3,58	0,62	● Benchmark e Indici
-	-2,50	3,59	5,57	4,99	1,53	● Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	14,93	3Y Sharpe Ratio	0,97
3Y Beta	-1,01	3Y Std Dev	13,64
3Y R-Squared	8,25	3Y Risk	Alto
3Y Info Ratio	0,77	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	15,20	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %

Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	5,21	0,54
6-Mesi	10,66	2,87
1-Anno	17,43	3,46
3-Anni Ann.ti	17,36	4,33
5-Anni Ann.ti	-	5,81
10-Anni Ann.ti	-	-

Rendimenti aggiornati al 03/02/2026

Rendimenti Trimestrali %

Q1	Q2	Q3	Q4
-	-	-	-
2026	2025	2024	2023
13,40	-3,62	4,47	2,97
22,99	1,42	-3,34	3,50
0,62	4,38	10,90	-6,99
10,65	6,51	-6,82	12,65

Portafoglio -

Asset Allocation %

Netta

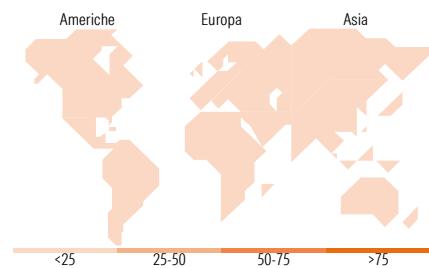
Fixed Income Style

Box™



Duration Effettiva
Maturity 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 %

■ Governativo	0,00
■ Societario	0,00
■ Cartolarizzazioni	0,00
■ Enti Locali	0,00
■ Liquidità ed equivalenti	0,00
■ Derivati	0,00

Fondo

Coupon Range %

Fondo
0 coupon
Da 0 a 4 cedole
Da 4 a 6 cedole
Da 6 a 8 cedole
Da 8 a 10 cedole
Da 10 a 12 cedole
Oltre 12 cedole

Ripartizione Geografica %

Fondo
America
Stati Uniti
Canada
America Latina e Centrale
Europa
Regno Unito
Europa Occidentale - Euro
Europa Occidentale - Non Euro
Europa dell'Est
Africa
Medio Oriente
Asia
Giappone
Australasia
Asia - Paesi Sviluppati
Asia - Emergenti

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln) (03/02/2026)	1,82 EUR	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,26%
Data di Partenza	01/04/2021	UCITS	Si	Spese correnti	0,26%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1662505368		
NAV (03/02/2026)	EUR 210,03				
Patrimonio Netto (Mln)	-				