# **AQR Delphi Long-Short Equity UCITS Fund RAU1 Acc**

## Categoria Morningstar™

Alt - Long/Short Azionario Internazionale

### Benchmark Morningstar

Morningstar Global Target Market Exposure NR USD Usato nel Report

#### **Benchmark Dichiarato**

50% MSCI World 100% Hdg NR EUR, 50% ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

# Morningstar Rating™

++++

## **Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

The investment objective of the Fund is to provide investors with returns from potential gains from its long and short positions. The Fund seeks capital appreciation by investing on a long basis in attractively valued, high quality and low beta assets and on a short basis in expensive, low quality, and high beta assets, while following the approach. The Fund aims at targeting an average beta exposure of between 0.4 and 0.6 to a composite global equity market index, as defined for each Class of Shares in the table "Summary of Shares, Fees and Expenses" set out below (the "Benchmark"). There can be no assurance that the Fund will achieve its investment objective.

| Misure di Rischio                                                             |       |                 |       |  |  |
|-------------------------------------------------------------------------------|-------|-----------------|-------|--|--|
| 3Y Alpha                                                                      | 11,09 | 3Y Sharpe Ratio | 0,93  |  |  |
| 3Y Beta                                                                       | 0,16  | 3Y Std Dev      | 10,81 |  |  |
| 3Y R-Squared                                                                  | 6,21  | 3Y Risk         | -Med  |  |  |
| 3Y Info Ratio                                                                 | -0,22 | 5Y Risk         | Med   |  |  |
| 3Y Tracking Error                                                             | 13,06 | 10Y Risk        | -     |  |  |
| Basati su Morningstar Global Target Market Exposure NR USD (dove applicabile) |       |                 |       |  |  |

#### Rendimenti 199 166 133 100 2024 2020 2021 2022 2023 2025-09 42,24 12,16 32,67 -1,59 Fondo 1,26 27,57 -12,67 18,00 25,02 4,22 Benchmark e Indici 11,18 -5,56 4,37 11,41 2,06 Categoria

| Rend. Cumulati %                  | Fondo | Bmk   | Cat  | Rendimenti    | Q1    | Q2    | Q3   | Q4    |
|-----------------------------------|-------|-------|------|---------------|-------|-------|------|-------|
| 3-Mesi                            | 2,37  | 5,83  | 0,38 | Trimestrali % |       |       |      |       |
| 6-Mesi                            | -3,36 | 21,53 | 3,52 | 2025          | 3,22  | -6,35 | 1,81 | -     |
| 1-Anno                            | -0,08 | 8,46  | 1,76 | 2024          | 15,37 | 4,13  | 0,64 | 9,73  |
| 3-Anni Ann.ti                     | 11,44 | 15,38 | 4,84 | 2023          | 2,32  | 2,62  | 6,04 | 0,73  |
| 5-Anni Ann.ti                     | 12,44 | 12,95 | 4,35 | 2022          | -2,77 | 2,59  | 3,04 | -1,47 |
| 10-Anni Ann.ti                    | -     | -     | -    | 2021          | 9,68  | 6,22  | 6,24 | 14,92 |
| Rendimenti aggiornati al 17/10/20 | 125   |       |      |               |       |       |      |       |

### Portafoglio

Asset Allocation % Netta



Mkt Cap % Fondo
Capitalizzazione media di mercato
Ave Mkt Cap



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

| Distribuzione Settoriale %  | Fondo |
|-----------------------------|-------|
| <b>%</b> Ciclico            | 0,00  |
| 📤 Materie Prime             | -     |
| 🕰 Beni di Consumo Ciclici   | -     |
| 🚅 Finanza                   | -     |
| <b>☆</b> Immobiliare        | -     |
| <b>₩</b> Sensibile          | 0,00  |
| Telecomunicazioni           | -     |
| <b>♦</b> Energia            | -     |
| 🌣 Beni Industriali          | -     |
| 且 Tecnologia                | -     |
| → Difensivo                 | 0,00  |
| 📜 Beni Difensivi            | -     |
| 🛟 Salute                    | -     |
| Servizi di Pubblica Utilità | -     |

| Fond | Ripartizione Geografica %     |
|------|-------------------------------|
| 0,0  | America                       |
|      | Stati Uniti                   |
|      | Canada                        |
|      | America Latina e Centrale     |
| 0,0  | Europa                        |
|      | Regno Unito                   |
|      | Europa Occidentale - Euro     |
|      | Europa Occidentale - Non Euro |
|      | Europa dell'Est               |
|      | Africa                        |
|      | Medio Oriente                 |
| 0,0  | Asia                          |
|      | Giappone                      |
|      | Australasia                   |
|      | Asia - Paesi Sviluppati       |
|      | Asia - Emergente              |

| Anagrafica           |                               |                                         |              |                                                            |            |
|----------------------|-------------------------------|-----------------------------------------|--------------|------------------------------------------------------------|------------|
| Società di Gestione  | AQR Capital Management<br>LLC | Patrimonio Classe (MIn)<br>(17/10/2025) | 97,57 USD    | Investimento Min. Ingresso<br>Investimento Min. Successivo | 10.000 USD |
| Telefono             | 1 (203) 742-3600              | Domicilio                               | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                                                     | 2,58%      |
| Web                  | http://www.aqr.com/           | Valuta del Fondo                        | USD          | Spese correnti                                             | 0,56%      |
| Data di Partenza     | 20/08/2020                    | UCITS                                   | Si           | Commissione di incentivo                                   | 20,00%     |
| Nome del Gestore     | -                             | Inc/Acc                                 | Acc          |                                                            |            |
| Data Inizio Gestione | 27/08/2018                    | ISIN                                    | LU2165868832 |                                                            |            |
| NAV (17/10/2025)     | USD 180,56                    |                                         |              |                                                            |            |

# **AQR Delphi Long-Short Equity UCITS Fund RAU1 Acc**

Patrimonio Netto (MIn)

