

# AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class A1 USD Acc

## Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili USD

## Benchmark Morningstar

Morningstar EAA USD Mod Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

N/A

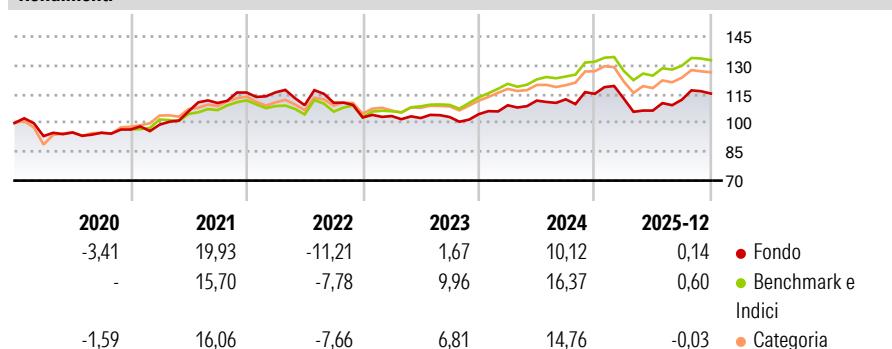
## Morningstar Rating™

★★★

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Nell'allocatione degli attivi tra le varie classi, tra cui azioni, titoli di stato e indici ammissibili di materie prime diversificati, il Fondo si avvale di un approccio "risk parity". L'appuccio "risk parity" all'allocazione degli attivi mira a bilanciare l'allocazione del rischio tra le varie tipologie di investimento (classi di attivi).

### Rendimenti



### Misure di Rischio

|                   |       |                 |      |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | -4,84 | 3Y Sharpe Ratio | 0,14 |
| 3Y Beta           | 1,04  | 3Y Std Dev      | 8,31 |
| 3Y R-Squared      | 78,00 | 3Y Risk         | Med  |
| 3Y Info Ratio     | -1,30 | 5Y Risk         | Med  |
| 3Y Tracking Error | 3,90  | 10Y Risk        | Med  |

Basati su Morningstar EAA USD Mod Target Allocation NR USD (dove applicabile)

### Rend. Cumulati %

| Periodo        | Fondo | Bmk   | Cat   |
|----------------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi         | 0,29  | 0,01  | 1,65  |
| 6-Mesi         | 8,76  | 4,97  | 6,92  |
| 1-Anno         | 0,49  | -0,02 | -0,46 |
| 3-Anni Ann.ti  | 3,80  | 7,84  | 5,20  |
| 5-Anni Ann.ti  | 3,45  | 6,36  | 5,31  |
| 10-Anni Ann.ti | 4,78  | 6,46  | 5,14  |

Rendimenti aggiornati al 28/01/2026

### Rendimenti Trimestrali %

| Trimestre | Q1    | Q2    | Q3   | Q4    |
|-----------|-------|-------|------|-------|
| 2026      | -     | -     | -    | -     |
| 2025      | -2,14 | -5,54 | 5,30 | 2,87  |
| 2024      | 4,44  | 2,22  | 0,60 | 2,54  |
| 2023      | 0,71  | -0,98 | 0,50 | 1,45  |
| 2022      | 0,09  | -5,77 | 1,16 | -6,94 |

### Portafoglio 30/06/2025

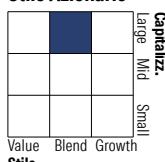


#### Asset Allocation %

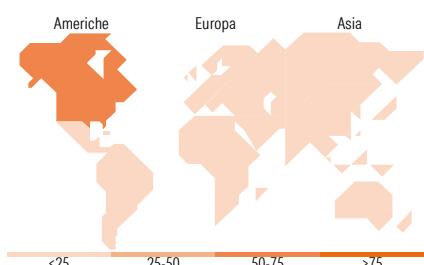
|                |        |
|----------------|--------|
| • Azioni       | 10,74  |
| • Obbligazioni | -72,12 |
| • Liquidità    | 161,35 |
| • Altro        | 0,03   |

#### Morningstar Style Box®

##### Stile Azionario



#### Reddito Fisso



### Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| United States Treasury Notes...             | —       | 8,57  |
| United States Treasury Notes...             | —       | 7,16  |
| United States Treasury Notes...             | —       | 6,02  |
| United States Treasury Notes...             | —       | 5,62  |
| UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...              | —       | 4,87  |
| Star Compass PLC                            | —       | 4,76  |
| Star Helios Plc                             | —       | 4,76  |
| France (Republic Of) 0,1%                   | —       | 2,99  |
| United Kingdom of Great...                  | —       | 2,24  |
| United Kingdom of Great...                  | —       | 1,97  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 48,96 |
| Numeri Complessivo di Titoli Azionari       |         | 861   |
| Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 118   |

### Distribuzione Settoriale %

#### Fondo

|             |       |
|-------------|-------|
| ● Ciclico   | 34,26 |
| ● Sensibile | 49,10 |
| ● Difensivo | 16,64 |

### Fixed Income Sector Weightings %

| Fondo                    |
|--------------------------|
| Governativo              |
| Societario               |
| Cartolarizzazioni        |
| Enti Locali              |
| Liquidità ed equivalenti |
| Derivati                 |

### Ripartizione Geografica %

#### Fondo

|                               |              |
|-------------------------------|--------------|
| <b>America</b>                | <b>66,89</b> |
| Stati Uniti                   | 63,00        |
| Canada                        | 2,90         |
| America Latina e Centrale     | 1,00         |
| <b>Europa</b>                 | <b>15,78</b> |
| Regno Unito                   | 2,86         |
| Europa Occidentale - Euro     | 6,93         |
| Europa Occidentale - Non Euro | 4,70         |
| Europa dell'Est               | 0,20         |
| Africa                        | 0,31         |
| Medio Oriente                 | 0,76         |
| <b>Asia</b>                   | <b>17,34</b> |
| Giappone                      | 4,82         |
| Australasia                   | 2,00         |
| Asia - Paesi Sviluppati       | 4,95         |
| Asia - Emergenti              | 5,56         |

### Anagrafica

|                        |                            |   |              |                              |             |
|------------------------|----------------------------|---|--------------|------------------------------|-------------|
| Società di Gestione    | AQR Capital Management LLC | Patrimonio Classe (Mln)<br>(28/01/2026) | 30,95 USD    | Investimento Min. Ingresso   | 100.000 USD |
| Telefono               | 1 (203) 742-3600           | Domicilio                               | LUSSEMBURGO  | Investimento Min. Successivo | -           |
| Web                    | http://www.aqr.com/        | Valuta del Fondo                        | USD          | T.E.R.                       | 0,50%       |
| Data di Partenza       | 28/08/2012                 | UCITS                                   | Si           | Spese correnti               | 0,50%       |
| Nome del Gestore       | John Huss                  | Inc/Acc                                 | Acc          | Commissione di incentivo     | -           |
| Data Inizio Gestione   | 28/02/2012                 | ISIN                                    | LU0995951752 |                              |             |
| NAV (28/01/2026)       | USD 168,58                 |   |              |                              |             |
| Patrimonio Netto (Mln) | 548,97 USD                 |   |              |                              |             |

(30/06/2025)

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.