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

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili USD

Benchmark Morningstar

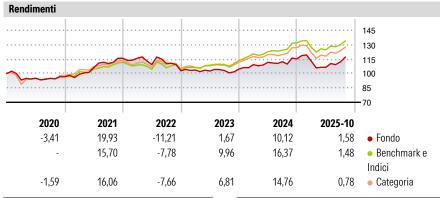
Morningstar EAA USD Mod Target Allocation NR USD Usato nel Report **Benchmark Dichiarato**

N/A

Morningstar Rating™

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Nell'allocazione 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'approccio "risk parity" all'allocazione degli attivi mira a bilanciare l'allocazione del rischio tra le varie tipologie di investimento (classi di attivi).



Misure di Rischio)		
3Y Alpha	-5,18	3Y Sharpe Ratio	-0,07
3Y Beta	0,99	3Y Std Dev	9,07
3Y R-Squared	78,01	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,44	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	4,04	10Y Risk	Med
Basati su Morningstar EAA USD Mod Target Allocation NR USD (dove applicabile)			

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	6,31	4,50	4,79	Trimestrali %				
6-Mesi	9,31	6,24	6,21	2025	-2,14	-5,54	5,30	-
1-Anno	0,88	1,62	-0,23	2024	4,44	2,22	0,60	2,54
3-Anni Ann.ti	2,56	6,97	4,34	2023	0,71	-0,98	0,50	1,45
5-Anni Ann.ti	3,78	6,74	5,20	2022	0,09	-5,77	1,16	-6,94
10-Anni Ann.ti	3,96	5,62	3,97	2021	2,61	7,02	4,08	4,93
Rendimenti aggiornati al 28/11/2	2025							

Portafoglio 31/12/2024



Morningstar Style Box®



Distribuzione Settoriale %



Fondo

Bassa Med Alta Sensibilità ai Tassi

Americhe	Eu	ropa	Asia
<25	25-50	50-75	>75

Titoli principali		
Nome	Settore	%
United States Treasury Notes	_	6,93
United States Treasury Notes	_	6,51
Star Compass PLC	_	5,41
Star Helios Plc	_	5,41
France (Republic Of) 0.1%	_	4,04
UBS (IrI) Sel Money Mkt USD	_	2,25
France (Republic Of) 0.1%	_	2,21
France (Republic Of) 0.1%	_	1,99
United Kingdom of Great	_	1,75
France (Republic Of) 0.1%	_	1,72
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		38,23
Numero Complessivo di Titoli Azionari		899
Numero Complessivo di Titoli Obbliga	zionari	85

♣ Ciclico	32,95	
✓ Sensibile	48,55	
→ Difensivo	18,50	
Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	
₩ Governativo	-32,08	
Societario	14,76	
★ Cartolarizzazioni	0,00	
Enti Locali	0,00	
🚅 Liquidità ed equivalenti	177,63	
Derivati	-60,31	

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	68,50
Stati Uniti	64,57
Canada	2,99
America Latina e Centrale	0,94
Europa	14,28
Regno Unito	2,45
Europa Occidentale - Euro	6,35
Europa Occidentale - Non Euro	4,31
Europa dell'Est	0,16
Africa	0,33
Medio Oriente	0,69
Asia	17,22
Giappone	4,96
Australasia	1,90
Asia - Paesi Sviluppati	4,49
Asia - Emergente	5,87

Anagrafica		
Società di Gestione	AQR Capital Management	Patrimoni
Talafana	LLC	(28/11/2025)
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del
Data di Partenza	28/08/2012	UCITS
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN
NAV (28/11/2025)	USD 162,78	
Patrimonio Netto (MIn)	819,86 USD	
(31/12/2024)		

Patrimonio Classe (Mln) (28/11/2025)	29,88 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0995951752

Investimento Min. Ingresso	100.000 USD
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,50%
Spese correnti	0,50%
Commissione di incentivo	-

(511 1212024)