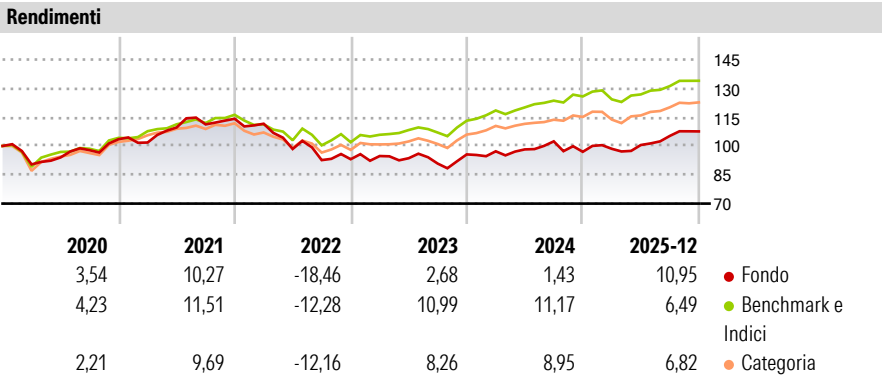


AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class B1 EUR Acc

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Bilanciati Flessibili EUR - Globali	Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report	N/A	★★

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).



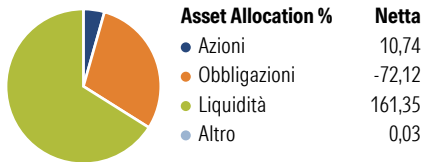
Misure di Rischio			
3Y Alpha	-4,81	3Y Sharpe Ratio	0,27
3Y Beta	1,10	3Y Std Dev	8,21
3Y R-Squared	60,90	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,88	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	5,18	10Y Risk	Med

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	2,18	1,19	2,73	2026	-	-	-	-
6-Mesi	10,33	5,56	7,81	2025	1,61	2,00	4,70	2,24
1-Anno	12,60	6,23	8,30	2024	1,70	1,01	4,27	-5,31
3-Anni Ann.ti	4,93	8,58	7,94	2023	1,79	-1,21	-3,00	5,26
5-Anni Ann.ti	1,12	5,24	4,52	2022	-2,28	-11,78	-5,88	0,50
10-Anni Ann.ti	3,51	5,76	4,46					

Rendimenti aggiornati al 28/01/2026

Portafoglio 30/06/2025



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
Numero Complessivo di Titoli Azionari		861
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		118

Distribuzione Settoriale %		Fondo
Ciclico		34,26
Sensibile		49,10
Difensivo		16,64

Fixed Income Sector Weightings %		Fondo
Governativo		-55,11
Societario		10,66
Cartolarizzazioni		0,00
Enti Locali		0,00
Liquidità ed equivalenti		180,22
Derivati		-35,78

Ripartizione Geografica %		Fondo
America		66,89
Stati Uniti		63,00
Canada		2,90
America Latina e Centrale		1,00
Europa		15,78
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
Asia		17,34
Giappone		4,82
Australasia		2,00
Asia - Paesi Sviluppati		4,95
Asia - Emergente		5,56

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	8,44 EUR	Investimento Min. Ingresso	100.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	(28/01/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,50%
Data di Partenza	05/06/2015	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,50%
Nome del Gestore	John Huss	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	Inc/Acc	Acc		
NAV (28/01/2026)	EUR 136,94	ISIN	LU0995952131		
Patrimonio Netto (Mln)	548,97 USD				

(30/06/2025)