

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

Categoria Morningstar™
Bilanciati Flessibili EUR - Globali
Usato nel Report

Benchmark Morningstar
Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR

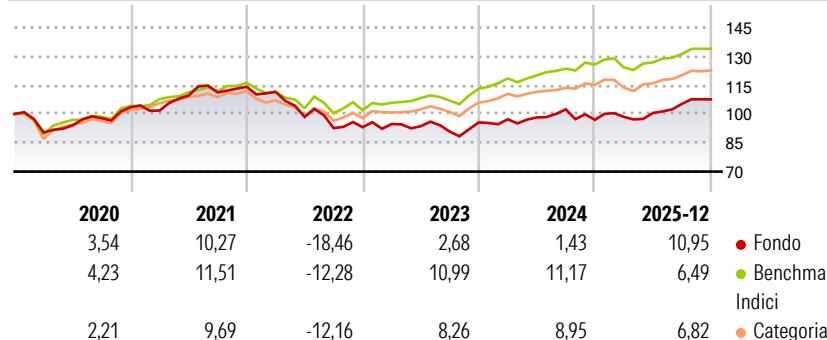
Benchmark Dichiarato
N/A

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).

Rendimenti



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 %

Periodo	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	2,18	1,19	2,73
6-Mesi	10,33	5,56	7,81
1-Anno	12,60	6,23	8,30
3-Anni Ann.ti	4,93	8,58	7,94
5-Anni Ann.ti	1,12	5,24	4,52
10-Anni Ann.ti	3,51	5,76	4,46

Rendimenti aggiornati al 28/01/2026

Rendimenti Trimestrali %

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	1,61	2,00	4,70	2,24
2024	1,70	1,01	4,27	-5,31
2023	1,79	-1,21	-3,00	5,26
2022	-2,28	-11,78	-5,88	0,50

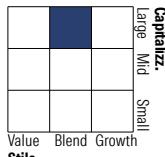
Portafoglio 30/06/2025



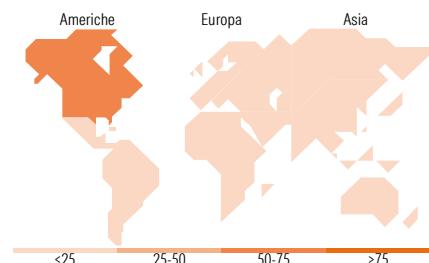
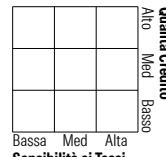
	Asset Allocation %	Netta
• Azioni	10,74	
• Obbligazioni	-72,12	
• Liquidità	161,35	
• Altro	0,03	

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
	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 - Emergenti	5,56

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln) (28/01/2026)	8,44 EUR	Investimento Min. Ingresso	100.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,50%
Data di Partenza	05/06/2015	UCITS	Si	Spese correnti	0,50%
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995952131		
NAV (28/01/2026)	EUR 136,94				
Patrimonio Netto (Mln)	548,97 USD				
(30/06/2025)					