# **AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class C1 GBP Acc**

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili GBP

**Benchmark Morningstar** 

Usato nel Report

Morningstar UK Moderate Target Allocation NR GBP

#### **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 Rischie	D		
3Y Alpha	-3,82	3Y Sharpe Ratio	0,32
3Y Beta	1,17	3Y Std Dev	9,77
3Y R-Squared	68,98	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,68	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	4,89	10Y Risk	+Med
Basati su Morningstar HK M	Inderate Tan	get Allocation NR GRP (dove	annlicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	4,18	3,52	2,77	Trimestrali %				
6-Mesi	7,34	4,81	3,64	2025	0,90	0,10	3,32	-
1-Anno	5,05	4,01	3,22	2024	3,42	2,19	6,53	-4,36
3-Anni Ann.ti	5,25	8,11	6,10	2023	3,20	1,45	-3,49	5,73
5-Anni Ann.ti	3,04	6,02	4,91	2022	-2,66	-13,12	-7,39	-0,12
10-Anni Ann.ti	1,69	3,85	2,12	2021	3,45	7,10	1,48	5,31
Rendimenti aggiornati al 28/11/2	2025							

### Portafoglio 31/12/2024



## Morningstar Style Box®



Distribuzione Settoriale %



Fondo

Americhe	Eu	ropa	Asia
	4		
1		7	
		7	
<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 (Irl) 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 Obbligaz	ionari	85

<ul><li>Ciclico</li><li>✓ Sensibile</li><li>Difensivo</li></ul>	32,95 48,55 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

23	23 30	0.3
Ripartizione Ge	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 Occiden	tale - Euro	6,35
Europa Occiden	tale - 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 Svil	uppati	4,49
Asia - Emergent	e	5,87

Anagrafica	
Società di Gestione	AQR Capital Management
	LLC
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	17/12/2012
Nome del Gestore	John Huss
Data Inizio Gestione	28/02/2012
NAV (28/11/2025)	GBP 149,21
Patrimonio Netto (MIn)	819,86 USD
(31/12/2024)	

Patrimonio Classe (MIn)	1,09 GBF
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	GBF
UCITS	S
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0995952644

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