AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class F EUR Inc

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

Benchmark Morningstar

Benchmark Dichiarato

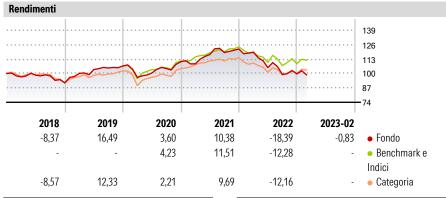
Morningstar Rating™

Senza rating

Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report

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	-3,86	3Y Sharpe Ratio	-0,08
3Y Beta	0,88	3Y Std Dev	10,81
3Y R-Squared	70,70	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-0,72	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	6,00	10Y Risk	-
Basati su Morningstar Euro applicabile)	Moderate	Global Target Allocation NF	EUR (dove

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,99	3,63	3,54	Trimestrali %				
6-Mesi	0,86	6,08	6,44	2025	-	-	-	-
1-Anno	-15,29	5,68	5,63	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	1,99	8,05	7,13	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	0,90	5,42	4,52	2022	-2,26	-11,77	-5,85	0,51
10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 24/03/2	- 2023	4,94	3,38	2021	-1,65	7,71	1,49	2,67

Portafoglio 31/12/2024

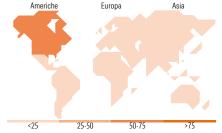




Distribuzione Settoriale %



Fondo



Titoli principali		
Nome Set	tore	%
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 Obbligaziona	ıri	85

(31/12/2024)

℃ 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 LLC	Patrimonio Classe (MIn) (24/03/2023)	44,76 USD	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo	100.000 EUR -
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,45%
Data di Partenza	09/12/2013	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Inc		
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995954426		
NAV (24/03/2023)	EUR 109,01				
Patrimonio Netto (MIn)	819,86 USD				