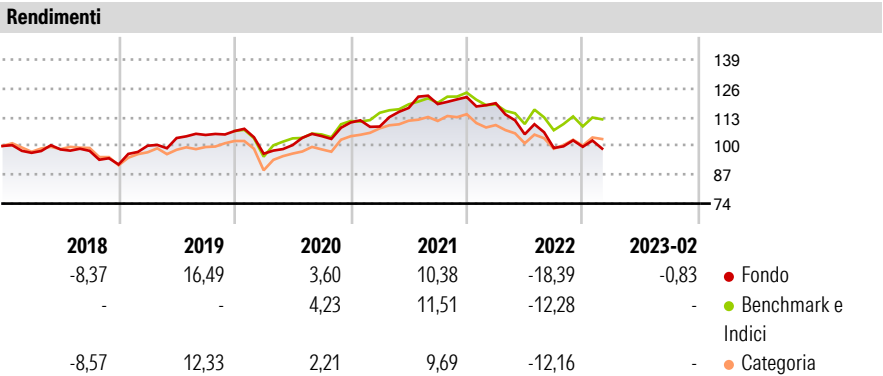


AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class F EUR Inc

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	Senza 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).



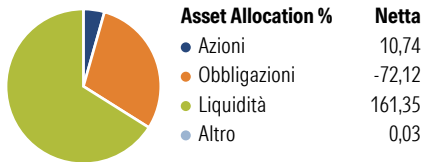
Misure di Rischio			
3Y Alpha	-3,86	3Y Sharpe Ratio	-0,08
3Y Beta	0,88	3Y Std Dev	10,81
3Y R-Squared	70,70	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-0,72	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	6,00	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,99	1,19	2,73	2026	-	-	-	-
6-Mesi	0,86	5,56	7,81	2025	-	-	-	-
1-Anno	-15,29	6,22	8,30	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	1,99	8,58	7,94	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	0,90	5,24	4,52	2022	-2,26	-11,77	-5,85	0,51
10-Anni Ann.ti	-	5,76	4,46					

Rendimenti aggiornati al 24/03/2023

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 (Iri) 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)	44,76 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	(24/03/2023)		Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	09/12/2013	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,45%
Nome del Gestore	John Huss	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	Inc/Acc	Inc		
NAV (24/03/2023)	EUR 109,01	ISIN	LU0995954426		
Patrimonio Netto (Mln)	548,97 USD				

(30/06/2025)