AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class A2 USD Acc

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili USD

Benchmark Morningstar

Usato nel Report

Morningstar EAA USD Mod Target Allocation NR USD

Benchmark Dichiarato

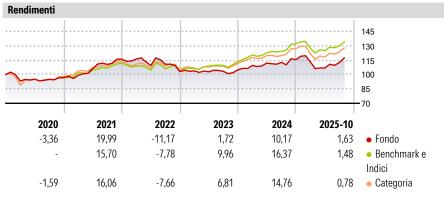
N/A

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 Rischio)		
3Y Alpha	-5,13	3Y Sharpe Ratio	-0,07
3Y Beta	0,99	3Y Std Dev	9,07
3Y R-Squared	78,03	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,43	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	4,03	10Y Risk	-
Raeati eu Morningetar FAA II	SD Mod Tar	avet Allocation NR USD (dove	annlicahile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	6,31	4,50	4,79	Trimestrali %				
6-Mesi	9,33	6,24	6,21	2025	-2,12	-5,53	5,31	-
1-Anno	0,93	1,62	-0,23	2024	4,46	2,23	0,61	2,55
3-Anni Ann.ti	2,61	6,97	4,34	2023	0,73	-0,97	0,51	1,46
5-Anni Ann.ti	3,83	6,74	5,20	2022	0,10	-5,76	1,18	-6,93
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	2,63	7,03	4,09	4,94
Rendimenti aggiornati al 28/11/2	2025							

Portafoglio 31/12/2024



Morningstar Style Box®



Distribuzione Settoriale %



Fondo

Americhe	e Eu	ropa	Asia
		J	
<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 Azionar	i	899
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	zionari	85

' 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 (Mln)	21,35 USD	
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	1
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	USD	9
Data di Partenza	21/04/2017	UCITS	Si	(
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc	
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995951836	
NAV (28/11/2025)	USD 146,73			
Patrimonio Netto (MIn)	819.86 USD			

Investimento Min. Ingresso	150.000.000 USD
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,45%
Spese correnti	0,45%
Commissione di incentivo	-

(31/12/2024)