AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class A3 USD Acc

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili USD

Benchmark Morningstar

Morningstar EAA USD Mod Target Allocation NR USD Usato nel Report

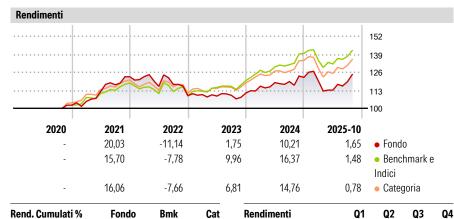
Benchmark Dichiarato

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	-5,10	3Y Sharpe Ratio	-0,06
3Y Beta	0,99	3Y Std Dev	9,07
3Y R-Squared	77,98	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,42	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	4,04	10Y Risk	-
Basati su Morningstar FAA II	SD Mod Tar	get Allocation NR USD (dove	annlicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	6,33	4,50	4,79	Trimestrali %				
6-Mesi	9,36	6,24	6,21	2025	-2,11	-5,53	5,32	-
1-Anno	0,96	1,62	-0,23	2024	4,46	2,23	0,61	2,56
3-Anni Ann.ti	2,64	6,97	4,34	2023	0,73	-0,97	0,52	1,48
5-Anni Ann.ti	3,86	6,74	5,20	2022	0,11	-5,76	1,19	-6,92
10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 28/11/20	- 125	=	=	2021	2,63	7,05	4,10	4,95

Portafoglio 31/12/2024



Morningstar Style Box® Stile Azionario







Settore	%
_	6,93
_	6,51
_	5,41
_	5,41
=	4,04
_	2,25
_	2,21
_	1,99
_	1,75
-	1,72
	38,23
i	899
ionari	85
	Settore i

Distribuzione Settoriale %	Fondo		
℃ Ciclico	32,95		
✓ Sensibile	48,55		
→ Difensivo	18,50		
Fixed Income Sector Weightings %	Fondo		
₩ Governativo	-32,08		
Societario	14,76		

→ Ditensivo	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	

	25 50 50 15	
Ripartizione	Geografica %	Fondo
America		68,50
Stati Uniti		64,57
Canada		2,99
America Lati	na e Centrale	0,94
Europa		14,28
Regno Unito		2,45
Europa Occio	dentale - Euro	6,35
Europa Occio	dentale - Non Euro	4,31
Europa dell'E	st	0,16
Africa		0,33
Medio Orient	te	0,69
Asia		17,22
Giappone		4,96
Australasia		1,90
Asia - Paesi S	Sviluppati	4,49
Asia - Emerg	ente	5,87

Anagrafica	
Società di Gestione	AQR Capital Management
	LLC
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	01/10/2020
Nome del Gestore	John Huss
Data Inizio Gestione	28/02/2012
NAV (28/11/2025)	USD 122,32
Patrimonio Netto (MIn)	819,86 USD

Patrimonio Classe (Mln) (28/11/2025)	98,93 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU0995952057

Investimento Min. Ingresso	300.000.000 USD
Investimento Min. Successivo	=
T.E.R.	0,42%
Spese correnti	0,42%
Commissione di incentivo	-

(31/12/2024)