

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

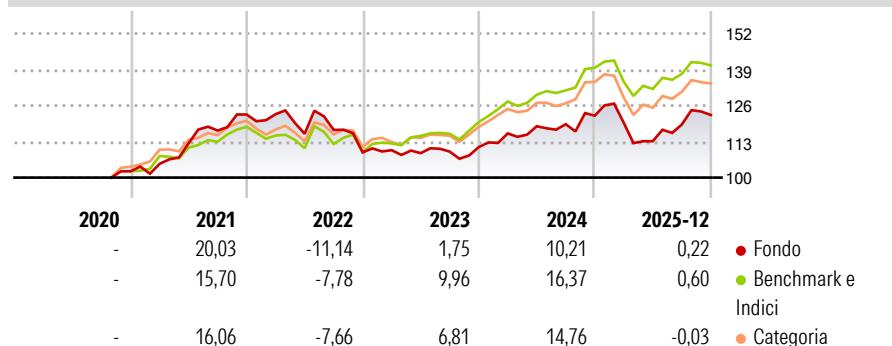
Morningstar Rating™

★★

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).

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	-4,76	3Y Sharpe Ratio	0,15
3Y Beta	1,04	3Y Std Dev	8,31
3Y R-Squared	77,96	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,27	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	3,90	10Y Risk	-

Basati su Morningstar EAA USD Mod Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	0,32	0,01	1,65
6-Mesi	8,81	4,97	6,92
1-Anno	0,57	-0,02	-0,46
3-Anni Ann.ti	3,88	7,84	5,20
5-Anni Ann.ti	3,53	6,36	5,31
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 28/01/2026

Rendimenti Trimestrali %

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-2,11	-5,53	5,32	2,89
2024	4,46	2,23	0,61	2,56
2023	0,73	-0,97	0,52	1,48
2022	0,11	-5,76	1,19	-6,92

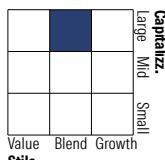
Portafoglio 30/06/2025



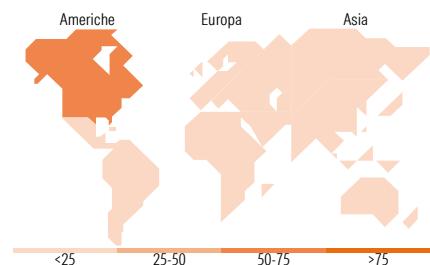
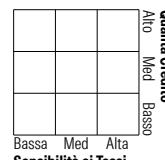
Asset Allocation %	Netta
• Azioni	10,74
• Obbligazioni	-72,12
• Liquidità	161,35
• Altro	0,03

Morningstar Style Box®

Stile Azionario



Reddito Fisso



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 (Irl) 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
Numeri Complessivo di Titoli Azionari		861
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari		118

Distribuzione Settoriale %

Fondo

● Ciclico	34,26
● Sensibile	49,10
● Difensivo	16,64

Fixed Income Sector Weightings %

● 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 - Emergenti	5,56

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln) (28/01/2026)	98,34 USD	Investimento Min. Ingresso	300.000.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	0,42%
Data di Partenza	01/10/2020	UCITS	Si	Spese correnti	0,42%
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995952057		
NAV (28/01/2026)	USD 126,70				
Patrimonio Netto (Mln)	548,97 USD				
(30/06/2025)					