

AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class B2 EUR Acc

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

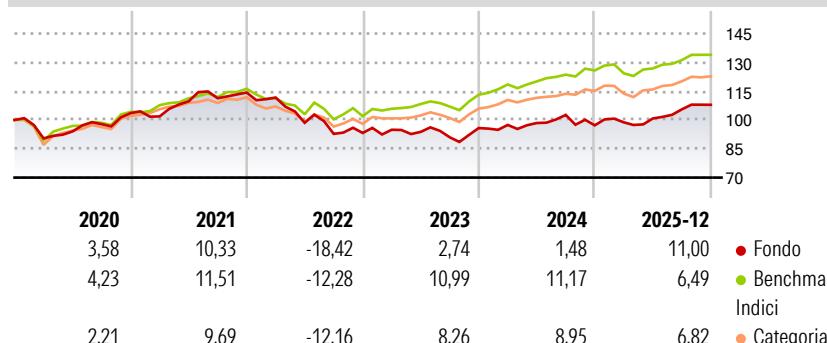
Morningstar Rating™



Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Nell'allocatione 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	-4,75	3Y Sharpe Ratio	0,27
3Y Beta	1,10	3Y Std Dev	8,21
3Y R-Squared	60,91	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,88	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	5,18	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %

3-Mesi	2,19
6-Mesi	10,35
1-Anno	12,65
3-Anni Ann.ti	4,98
5-Anni Ann.ti	1,17
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 28/01/2026

Fondo

Bmk

Cat

Rendimenti Trimestrali %

Q1

Q2

Q3

Q4

2026

2025

2024

2023

2022

2021

2020

Portafoglio 30/06/2025

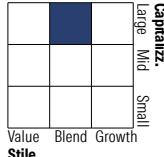


Asset Allocation %

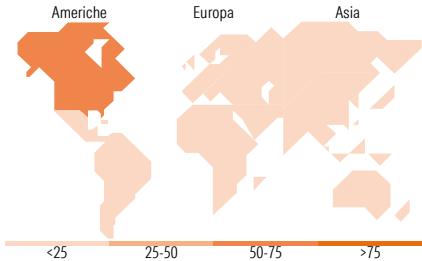
• Azioni	10,74
• Obbligazioni	-72,12
• Liquidità	161,35
• Altro	0,03

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 %	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 - Emergenti	5,56

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln) (28/01/2026)	18,85 EUR	Investimento Min. Ingresso	12.000.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,45%
Data di Partenza	20/04/2017	UCITS	Si	Spese correnti	0,45%
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995952305		
NAV (28/01/2026)	EUR 125,71				
Patrimonio Netto (Mln)	548,97 USD				

(30/06/2025)

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.