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

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

Benchmark Morningstar

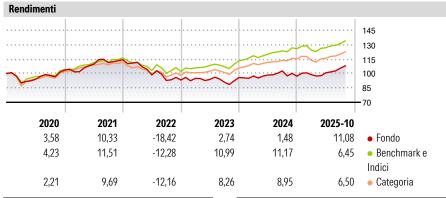
**Benchmark Dichiarato** 

Morningstar Rating™

Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report

## **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	-4,01	3Y Sharpe Ratio	0,26
3Y Beta	1,03	3Y Std Dev	8,52
3Y R-Squared	62,35	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,81	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	5,25	10Y Risk	-
Basati su Morningstar Euro	Moderate	Global Target Allocation N	IR EUR (dove

applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk		Rendimenti	01	02	02	
			Cat		Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	5,10	3,63	3,54	Trimestrali %				
6-Mesi	10,83	6,08	6,44	2025	1,62	2,02	4,71	-
1-Anno	8,43	5,68	5,63	2024	1,71	1,02	4,29	-5,29
3-Anni Ann.ti	4,11	8,05	7,13	2023	1,81	-1,19	-2,99	5,27
5-Anni Ann.ti	1,24	5,42	4,52	2022	-2,26	-11,77	-5,86	0,51
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	-1,67	7,70	1,49	2,65
Rendimenti aggiornati al 28/11/2	2025							

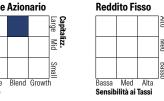
**Fondo** 

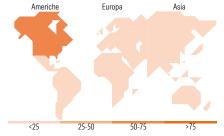
## Portafoglio 31/12/2024





**Distribuzione Settoriale %** 





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 Azionari	899
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari	85

(31/12/2024)

<b>℃</b> 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	

				Alora Emergence
Anagrafica				
Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	19,80 EUR	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti
Data di Partenza	20/04/2017	UCITS	Si	Commissione di incentivo
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc	
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995952305	
NAV (28/11/2025)	EUR 121,81			
Patrimonio Netto (MIn)	819.86 USD			

© 2025 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 acuratezza 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.



12.000.000 EUR

0,45% 0,45%