

AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class D2 CHF Acc

Categoria Morningstar™

Bilanciati Altro

Benchmark Morningstar

Not Categorized
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

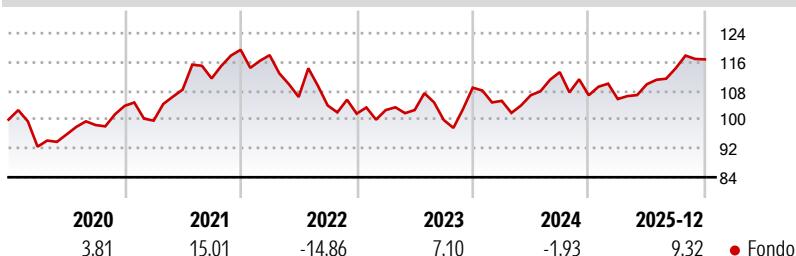
Morningstar Rating™

Senza 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	- 3Y Sharpe Ratio	0,22
3Y Beta	- 3Y Std Dev	9,75
3Y R-Squared	- 3Y Risk	-
3Y Info Ratio	- 5Y Risk	-
3Y Tracking Error	- 10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

	Fondo
3-Mesi	2,20
6-Mesi	10,75
1-Anno	13,24
3-Anni Ann.ti	5,59
5-Anni Ann.ti	2,88
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 28/01/2026

Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-1,00	3,88	4,08	2,13
2024	-3,36	1,49	6,00	-5,66
2023	0,97	0,02	-2,68	8,96
2022	-1,25	-9,84	-2,23	-2,19

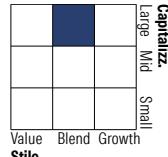
Portafoglio 30/06/2025



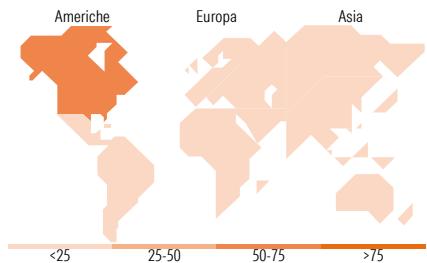
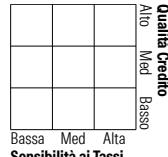
	Netta
● Azioni	10,74
● Obbligazioni	-72,12
● Liquidità	161,35
● Altro	0,03

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
Numero Complessivo di Titoli Azionari		861
Numero 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)	5,55 CHF	Investimento Min. Ingresso	150.000.000 CHF
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	CHF	T.E.R.	0,45%
Data di Partenza	21/04/2017	UCITS	Si	Spese correnti	0,45%
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995953451		
NAV (28/01/2026)	CHF 114,77				
Patrimonio Netto (Mln)	548,97 USD				
(30/06/2025)					