

AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class E2 EUR Inc

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Moderate Global Target N/A

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

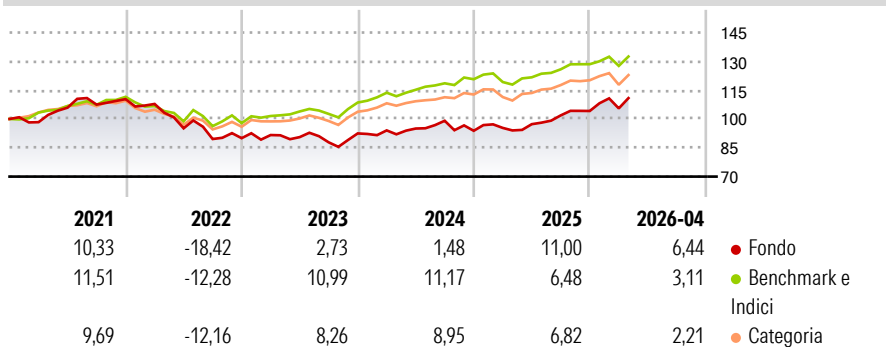
N/A

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	-3,14	3Y Sharpe Ratio	0,44
3Y Beta	1,16	3Y Std Dev	8,92
3Y R-Squared	67,45	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,49	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	5,21	10Y Risk	-

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

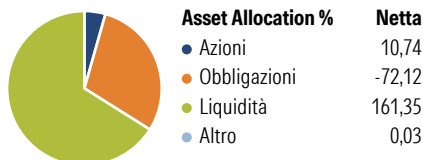
Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,18	2,12	1,96
6-Mesi	6,91	3,58	5,35
1-Anno	19,95	10,51	14,30
3-Anni Ann.ti	6,98	9,28	9,02
5-Anni Ann.ti	1,75	5,26	4,51
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 12/05/2026

Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	1,29	-	-	-
2025	1,62	2,02	4,72	2,25
2024	1,70	1,03	4,28	-5,29
2023	1,80	-1,19	-2,98	5,27
2022	-2,27	-11,78	-5,86	0,51

Portafoglio 30/06/2025

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 (Iri) 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 - Emergente	5,56

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	0,37 EUR	Investimento Min. Ingresso	120.000.000 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	15/02/2018	UCITS	Si	Spese correnti	0,45%
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995954004		
NAV (12/05/2026)	EUR 114,00				
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 prodotte; (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.