

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

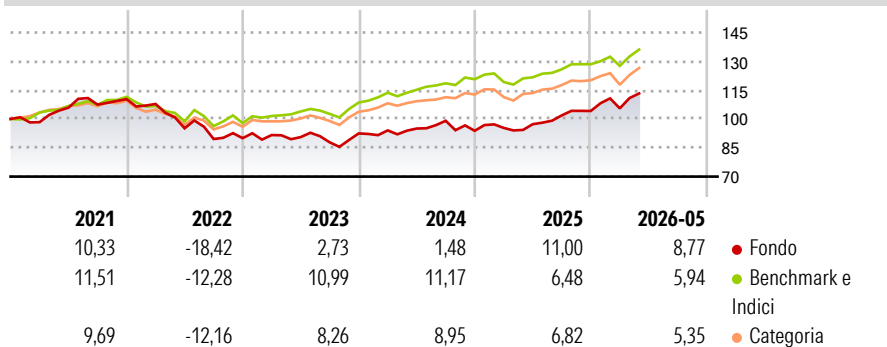
Morningstar Rating™

★★

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	-2,42	3Y Sharpe Ratio	0,61
3Y Beta	1,14	3Y Std Dev	8,81
3Y R-Squared	69,21	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,35	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	5,00	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %

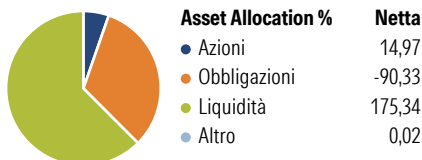
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	5,63	7,45	7,14
6-Mesi	7,70	6,24	6,65
1-Anno	14,70	12,74	14,15
3-Anni Ann.ti	6,82	9,92	9,28
5-Anni Ann.ti	1,05	5,11	4,26
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

Rendimenti

	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 31/12/2025



Morningstar Style Box®

Stile Azionario



Reddito Fisso



Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Notes...	—	17,12
United States Treasury Notes...	—	5,71
Star Compass PLC	—	5,28
Star Helios Plc	—	5,28
United States Treasury Notes...	—	4,68
United States Treasury Notes...	—	4,27
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...	—	3,16
United Kingdom of Great...	—	1,54
NVIDIA Corp	☑	1,45
United Kingdom of Great...	—	1,36
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		49,85
Numero Complessivo di Titoli Azionari		862
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		119

Distribuzione Settoriale %

	Fondo
🔄 Ciclico	33,65
📈 Sensibile	50,11
📉 Difensivo	16,24

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛️ Governativo	-68,67
⚙️ Societario	12,42
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏢 Enti Locali	0,00
📄 Liquidità ed equivalenti	194,40
📑 Derivati	-38,15

Ripartizione Geografica %

	Fondo
America	67,33
Stati Uniti	63,82
Canada	2,48
America Latina e Centrale	1,04
Europa	15,90
Regno Unito	2,45
Europa Occidentale - Euro	7,51
Europa Occidentale - Non Euro	4,90
Europa dell'Est	0,17
Africa	0,32
Medio Oriente	0,56
Asia	16,77
Giappone	5,19
Australasia	1,77
Asia - Paesi Sviluppati	5,06
Asia - Emergente	4,76

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 (26/06/2026)	EUR 112,72				
Patrimonio Netto (Mln)	554,38 USD				

(31/12/2025)

See disclosures for more details

© 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.