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

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

Benchmark Morningstar

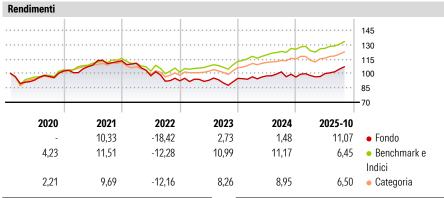
Benchmark Dichiarato

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	8,53
3Y R-Squared	62,28	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,80	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	5,25	10Y Risk	-
Basati su Morningstar Euro	Moderate	Global Target Allocation N	R 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	10,84	6,08	6,44	2025	1,62	2,02	4,72	-
1-Anno	8,43	5,68	5,63	2024	1,70	1,03	4,28	-5,29
3-Anni Ann.ti	4,11	8,05	7,13	2023	1,80	-1,19	-2,98	5,27
5-Anni Ann.ti	1,24	5,42	4,52	2022	-2,27	-11,78	-5,86	0,51
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	-1,67	7,70	1,49	2,66
Rendimenti aggiornati al 28/11/2	2025							

Portafoglio 31/12/2024









Bassa Med Alta Sensibilità ai Tassi

Americhe	Eu	ropa	Asia
	4		
P.			
<25	25-50	50-75	>75

Titoli principali		
Nome Setto	re	%
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	i	85

Distribuzione Settoriale %	Fondo		
℃ Ciclico	32,95		
₩ Sensibile	48,55		
→ Difensivo	18,50		
Fixed Income Sector Weightings %	Fondo		
₩ Governativo	-32,08		
Continuedo	447/		

₩ 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

Anagrafica	
Società di Gestione	AQR Capital Management
	LLC
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	15/02/2018
Nome del Gestore	John Huss
Data Inizio Gestione	28/02/2012
NAV (28/11/2025)	EUR 105,87
Patrimonio Netto (MIn)	819,86 USD
(31/12/2024)	

Patrimonio Classe (MIn) (28/11/2025)	0,34 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Inc
ISIN	LU0995954004

Investimento Min. Ingresso	120.000.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,45%
Spese correnti	0,45%
Commissione di incentivo	-

© 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 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.

