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 Allocation NR EUR
Usato nel Report

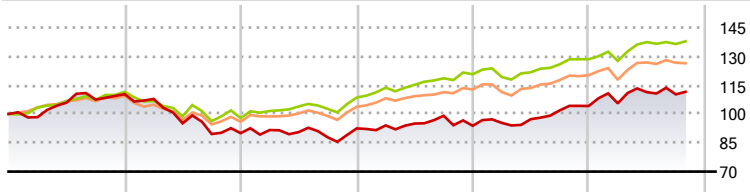
Benchmark Dichiarato
N/A

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



	2021	2022	2023	2024	2025	2026-10
Fondo	10,33	-18,42	2,73	1,48	11,00	7,08
Benchmark e Indici	11,51	-12,28	10,99	11,17	6,48	7,26
Categoria	9,69	-12,16	8,26	8,95	6,82	5,24

Misure di Rischio

3Y Alpha	-2,20	3Y Sharpe Ratio	0,77
3Y Beta	1,10	3Y Std Dev	8,53
3Y R-Squared	61,90	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,32	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	5,31	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-2,05	-0,27	-2,02
6-Mesi	-1,87	3,19	0,75
1-Anno	7,82	8,44	6,81
3-Anni Ann.ti	8,22	10,36	9,24
5-Anni Ann.ti	-0,19	4,42	3,27
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 09/11/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	1,29	5,53	-1,03	-
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

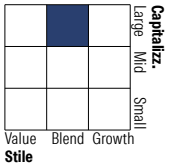
Portafoglio 31/12/2025



Asset Allocation %	Netta
Azioni	14,97
Obbligazioni	-90,33
Liquidità	175,34
Altro	0,02

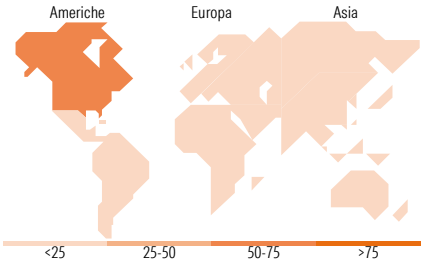
Morningstar Style Box®

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
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	15/02/2018
Nome del Gestore	John Huss
Data Inizio Gestione	30/08/2012
NAV (09/11/2026)	EUR 112,33
Patrimonio Netto (Mln) (31/12/2025)	554,38 USD
Patrimonio Classe (Mln) (09/11/2026)	0,37 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	-

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 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.

MORNINGSTAR