AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund RAEF EUR Acc

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

Benchmark Morningstar

Benchmark Dichiarato

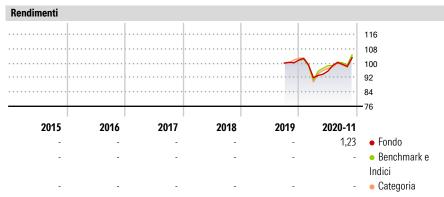
Morningstar Rating™

Senza 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 | - | 3Y Sharpe Ratio | - |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | - |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |
| Basati su Morningstar Euro M applicabile) | oderate | Global Target Allocation NR I | EUR (dove |

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|-----------------------------------|-------|------|------|---------------|----|----|----|----|
| 3-Mesi | 1,18 | 3,63 | 3,54 | Trimestrali % | | | | |
| 6-Mesi | 8,89 | 6,08 | 6,44 | 2025 | = | - | - | - |
| 1-Anno | 3,26 | 5,68 | 5,63 | 2024 | - | - | - | - |
| 3-Anni Ann.ti | - | 8,05 | 7,13 | 2023 | - | - | - | - |
| 5-Anni Ann.ti | - | 5,42 | 4,52 | 2022 | = | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - | 2021 | - | - | - | - |
| Rendimenti aggiornati al 03/12/20 | 020 | | | | | | | |

Portafoglio 31/12/2024





Distribuzione Settoriale %



Fondo



| Titoli principali | | |
|---------------------------------------|---------|-------|
| Nome | Settore | % |
| 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 Obbligaz | ionari | 85 |

(31/12/2024)

| ♣ Ciclico | 32,95 |
|----------------------------------|--------|
| ₩ Sensibile | 48,55 |
| → Difensivo | 18,50 |
| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
| ₩ 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 | Patrimonio Classe (Mln) | 0,25 USD | Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo | 10.000 EUR |
| Telefono | 1 (203) 742-3600 | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | - |
| Web | http://www.aqr.com/ | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | 0,61% |
| Data di Partenza | 25/09/2019 | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| Nome del Gestore | John Huss | Inc/Acc | Acc | | |
| Data Inizio Gestione | 28/02/2012 | ISIN | LU1662508891 | | |
| NAV (03/12/2020) | EUR 101,98 | | | | |
| Patrimonio Netto (MIn) | 819,86 USD | | | | |