

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

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

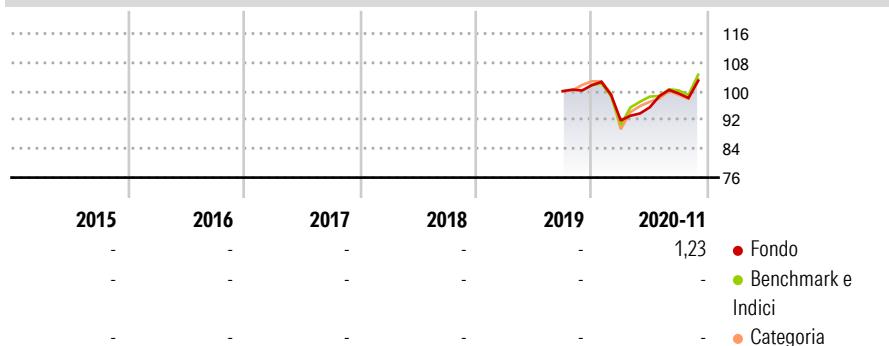
Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Nell'allocatione 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 | 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 Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %

| | 3-Mesi | 1,18 | 1,19 | 2,73 |
|--|----------------|------|------|------|
| | 6-Mesi | 8,89 | 5,56 | 7,81 |
| | 1-Anno | 3,26 | 6,23 | 8,30 |
| | 3-Anni Ann.ti | - | 8,58 | 7,94 |
| | 5-Anni Ann.ti | - | 5,24 | 4,52 |
| | 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 03/12/2020

Fondo

Bmk

Cat

Rendimenti Trimestrali %

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|----|----|----|----|
| 2026 | - | - | - | - |
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | - | - | - | - |
| 2023 | - | - | - | - |
| 2022 | - | - | - | - |

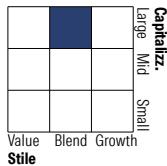
Portafoglio 30/06/2025



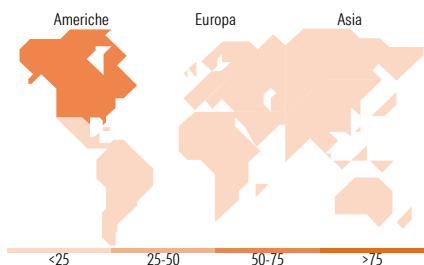
| | Asset Allocation % | Netta |
|----------------|--------------------|-------|
| • Azioni | 10,74 | - |
| • Obbligazioni | -72,12 | - |
| • Liquidità | 161,35 | - |
| • Altro | 0,03 | - |

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 (Irl) 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 |
| Numeri Complessivo di Titoli Azionari | | 861 |
| Numeri 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 - Emergenti | 5,56 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|----------------------------|---|--------------|------------------------------|------------|
| Società di Gestione | AQR Capital Management LLC | Patrimonio Classe (Mln) (03/12/2020) | 0,25 USD | Investimento Min. Ingresso | 10.000 EUR |
| Telefono | 1 (203) 742-3600 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | http://www.aqr.com/ | Valuta del Fondo | EUR | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 25/09/2019 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,61% |
| Nome del Gestore | John Huss | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 28/02/2012 | ISIN | LU1662508891 | | |
| NAV (03/12/2020) | EUR 101,98 | | | | |
| 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 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.