## **AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund RAE4F EUR Acc**

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

**Benchmark Morningstar** 

Benchmark Dichiarato

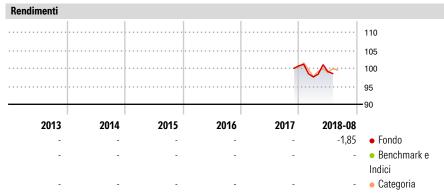
Morningstar Rating™

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)	loderate	Global Target Allocation NR EL	JR (dove

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-1,30	3,63	3,54	Trimestrali %				
6-Mesi	0,72	6,08	6,44	2025	-	-	-	-
1-Anno	-	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 24/08/2018	8							

## 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	İ	899
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	85

♣ 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
	-60,

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	Patrimonio Classe (MIn)	0,06 USD	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
	LLC	(24/08/2018)		Investimento Min. Successivo	=
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	=
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,50%
Data di Partenza	16/11/2017	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU1662511259		
NAV (24/08/2018)	EUR 99,51				
Patrimonio Netto (MIn)	819,86 USD				
(31/12/2024)					