## **AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund RDE4F EUR Inc**

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

**Benchmark Morningstar** 

**Benchmark Dichiarato** 

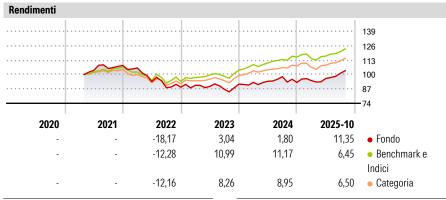
Morningstar Rating™

\*\*

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	-3,70	3Y Sharpe Ratio	0,30	
3Y Beta	1,03	3Y Std Dev	8,52	
3Y R-Squared	62,32	3Y Risk	+Med	
3Y Info Ratio	-0,75	5Y Risk	-	
3Y Tracking Error	5,25	10Y Risk	-	
Basati su Morningstar Euro	Moderate	Global Target Allocation N	R EUR (dove	

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	5,18	3,63	3,54	Trimestrali %				
6-Mesi	11,00	6,08	6,44	2025	1,69	2,10	4,79	-
1-Anno	8,75	5,68	5,63	2024	1,79	1,10	4,36	-5,21
3-Anni Ann.ti	4,42	8,05	7,13	2023	1,87	-1,11	-2,91	5,34
5-Anni Ann.ti	=	-	-	2022	-2,20	-11,71	-5,78	0,58
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	-	-	1,55	2,74
Rendimenti aggiornati al 28/11/2	2025							

## Portafoglio 31/12/2024







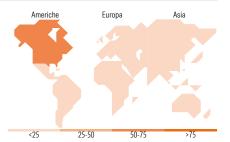
**Distribuzione Settoriale %** 

Derivati



**Fondo** 

-60,31



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	i	899
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	85

Ciclico     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	

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	Patrii
	LLC	(28/11/
Telefono	1 (203) 742-3600	Domi
Web	http://www.aqr.com/	Valut
Data di Partenza	01/04/2021	UCITS
Nome del Gestore	John Huss	Inc/A
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN
NAV (28/11/2025)	EUR 106,59	
Patrimonio Netto (MIn)	819,86 USD	
(31/12/2024)		

Patrimonio Classe (MIn) (28/11/2025)	0,12 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Inc
ISIN	LU1662511929

Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Investimento Min. Successivo	=
T.E.R.	0,15%
Spese correnti	0,15%
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 acuratezza 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.

