

AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund RDE4F 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

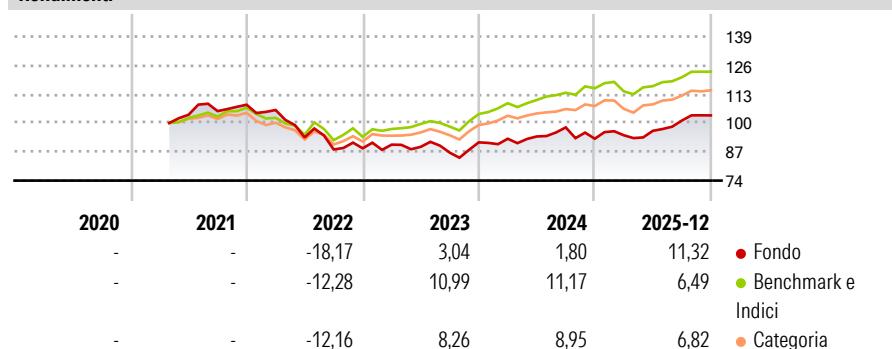
Morningstar Rating™

★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Nell'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 | -4,46 | 3Y Sharpe Ratio | 0,31 |
| 3Y Beta | 1,10 | 3Y Std Dev | 8,21 |
| 3Y R-Squared | 60,91 | 3Y Risk | +Med |
| 3Y Info Ratio | -0,82 | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | 5,18 | 10Y Risk | - |

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

Rend. Cumulati %

| | |
|----------------|-------|
| 3-Mesi | 2,28 |
| 6-Mesi | 10,52 |
| 1-Anno | 13,00 |
| 3-Anni Ann.ti | 5,30 |
| 5-Anni Ann.ti | - |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Fondo

Bmk

Cat

Rendimenti Trimestrali %

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|-------|--------|-------|-------|
| 2026 | - | - | - | - |
| 2025 | 1,69 | 2,10 | 4,79 | 2,32 |
| 2024 | 1,79 | 1,10 | 4,36 | -5,21 |
| 2023 | 1,87 | -1,11 | -2,91 | 5,34 |
| 2022 | -2,20 | -11,71 | -5,78 | 0,58 |

Rendimenti aggiornati al 28/01/2026

Portafoglio 30/06/2025



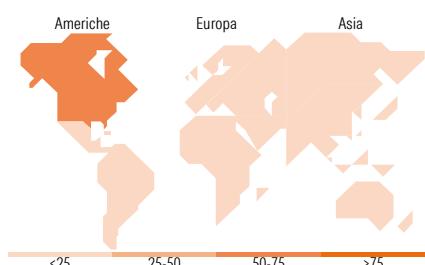
Asset Allocation %

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

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) | 0,13 EUR | Investimento Min. Ingresso | 10.000 EUR |
| Telefono | 1 (203) 742-3600 | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 0,15% |
| Web | http://www.aqr.com/ | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | 0,15% |
| Data di Partenza | 01/04/2021 | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| Nome del Gestore | John Huss | Inc/Acc | Inc | | |
| Data Inizio Gestione | 28/02/2012 | ISIN | LU1662511929 | | |
| NAV (28/01/2026) | EUR 110,06 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 548,97 USD | | | | |
| (30/06/2025) | | | | | |