

# AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class A1 USD Acc

## Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili USD

## Benchmark Morningstar

Morningstar EAA USD Mod Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

N/A

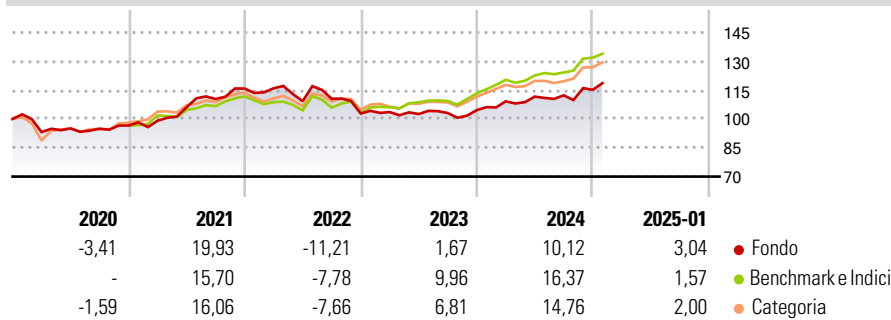
## Morningstar Rating™

★★

### 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).

### Rendimenti



### Misure di Rischio

3Y Alpha	-5,16	3Y Sharpe Ratio	-0,05
3Y Beta	0,95	3Y Std Dev	8,90
3Y R-Squared	85,24	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,31	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	4,02	10Y Risk	Med

Basati su Morningstar EAA USD Mod Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	7,51	7,28	7,29	2025	-	-	-	-
6-Mesi	7,59	10,57	9,46	2025	-	-	-	-
1-Anno	11,48	15,03	13,17	2024	4,44	2,22	0,60	2,54
3-Anni Ann.ti	2,31	7,72	5,77	2023	0,71	-0,98	0,50	1,45
5-Anni Ann.ti	2,90	6,51	5,01	2022	0,09	-5,77	1,16	-6,94
10-Anni Ann.ti	3,93	6,45	4,66	2021	2,61	7,02	4,08	4,93

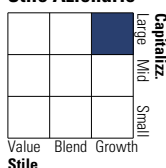
Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

### Portafoglio 30/06/2024

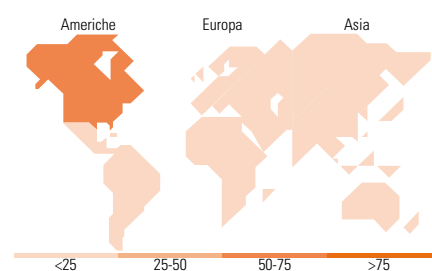
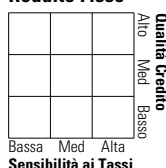


### Morningstar Style Box®

#### Stile Azionario



#### Reddito Fisso



### Titoli principali

Nome	Settore	%
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...	—	8,14
United States Treasury Notes...	—	4,84
United States Treasury Notes...	—	4,44
United States Treasury Notes...	—	3,26
France (Republic Of) 0.1%	—	2,90
France (Republic Of) 0.1%	—	1,66
United Kingdom of Great...	—	1,50
Microsoft Corp	☑	1,38
United Kingdom of Great...	—	1,34
United Kingdom of Great...	—	1,33
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		30,78
Numero Complessivo di Titoli Azionari		890
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		29

### Distribuzione Settoriale %

	Fondo
🔄 Ciclico	31,75
📈 Sensibile	49,04
📉 Difensivo	19,21

### Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛️ Governativo	-49,11
⚙️ Societario	0,00
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏢 Enti Locali	0,00
📄 Liquidità ed equivalenti	150,25
📁 Derivati	-1,13

### Ripartizione Geografica %

	Fondo
<b>America</b>	<b>68,26</b>
Stati Uniti	64,36
Canada	3,01
America Latina e Centrale	0,89
<b>Europa</b>	<b>15,61</b>
Regno Unito	2,47
Europa Occidentale - Euro	6,98
Europa Occidentale - Non Euro	5,15
Europa dell'Est	0,13
Africa	0,29
Medio Oriente	0,60
<b>Asia</b>	<b>16,13</b>
Giappone	5,27
Australasia	2,09
Asia - Paesi Sviluppati	4,18
Asia - Emergente	4,59

### Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	17,11 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-
Data di Partenza	28/08/2012	UCITS	Si	Spese correnti	0,50%
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995951752		
NAV (04/02/2025)	USD 147,83				
Patrimonio Netto (Mln)	845,99 USD				

(30/06/2024)