## **AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class B1 EUR Acc**

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

**Benchmark Morningstar** 

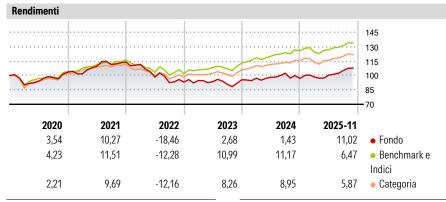
**Benchmark Dichiarato** 

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	-3,90	3Y Sharpe Ratio	0,15		
3Y Beta	1,03	3Y Std Dev	8,42		
3Y R-Squared	61,24	3Y Risk	+Med		
3Y Info Ratio	-0,78	5Y Risk	+Med		
3Y Tracking Error	5,25	10Y Risk	Med		
Basati su Morningstar Euro applicabile)	Moderate	Global Target Allocation N	R EUR (dove		

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	5,09	3,63	3,54	Trimestrali %				
6-Mesi	10,80	6,08	6,44	2025	1,61	2,00	4,70	-
1-Anno	8,38	5,68	5,63	2024	1,70	1,01	4,27	-5,31
3-Anni Ann.ti	4,06	8,05	7,13	2023	1,79	-1,21	-3,00	5,26
5-Anni Ann.ti	1,19	5,42	4,52	2022	-2,28	-11,78	-5,88	0,50
10-Anni Ann.ti	2,75	4,94	3,38	2021	-1,68	7,69	1,47	2,65
Rendimenti aggiornati al 28/11/2	2025							

## 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 Azionar	i	899
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	zionari	85

<b>℃</b> 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

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

				3
Anagrafica				
Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln) (28/11/2025)	8,14 EUR	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti
Data di Partenza	05/06/2015	UCITS	Si	Commissione di incentivo
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc	
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995952131	
NAV (28/11/2025)	EUR 132,71			
Patrimonio Netto (MIn)	819,86 USD			

(31/12/2024)

M\(\tag{RNINGSTAR}\)

100.000 EUR

0,50% 0,50%