

AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class C1 GBP Acc

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili GBP

Benchmark Morningstar

Morningstar UK Moderate Target

Allocation NR GBP

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

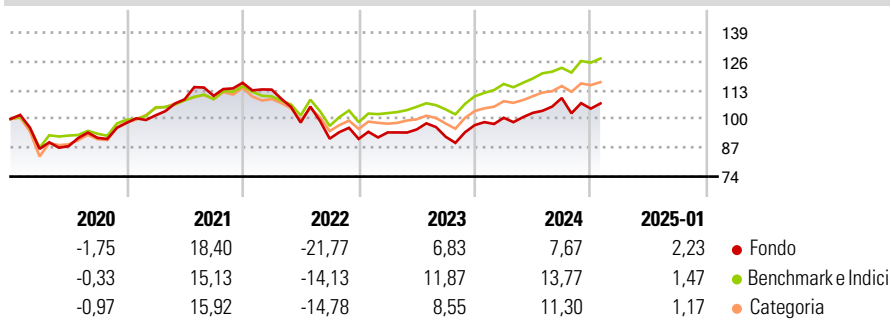
Morningstar Rating™

★

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	-5,87	3Y Sharpe Ratio	-0,26
3Y Beta	1,26	3Y Std Dev	12,94
3Y R-Squared	79,77	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-1,20	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	5,02	10Y Risk	+Med

Basati su Morningstar UK Moderate Target Allocation NR GBP (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,26	5,00	3,52	2025	-	-	-	-
6-Mesi	4,53	8,13	6,19	2025	-	-	-	-
1-Anno	9,38	13,70	11,68	2024	3,42	2,19	6,53	-4,36
3-Anni Ann.ti	-1,11	4,93	2,71	2023	3,20	1,45	-3,49	5,73
5-Anni Ann.ti	1,25	4,71	3,46	2022	-2,66	-13,12	-7,39	-0,12
10-Anni Ann.ti	1,00	4,24	2,12	2021	3,45	7,10	1,48	5,31

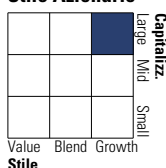
Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Portafoglio 30/06/2024

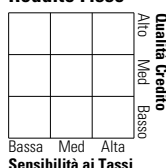


Morningstar Style Box®

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
America	68,26
Stati Uniti	64,36
Canada	3,01
America Latina e Centrale	0,89
Europa	15,61
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
Asia	16,13
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)	1,81 GBP	Investimento Min. Ingresso	100.000 GBP
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	GBP	T.E.R.	-
Data di Partenza	17/12/2012	UCITS	Si	Spese correnti	0,50%
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995952644		
NAV (04/02/2025)	GBP 135,87				
Patrimonio Netto (Mln)	845,99 USD				

(30/06/2024)