

# AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class F EUR Inc

**Categoria Morningstar™**

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

**Benchmark Morningstar**

Morningstar Euro Moderate Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

**Benchmark Dichiarato**

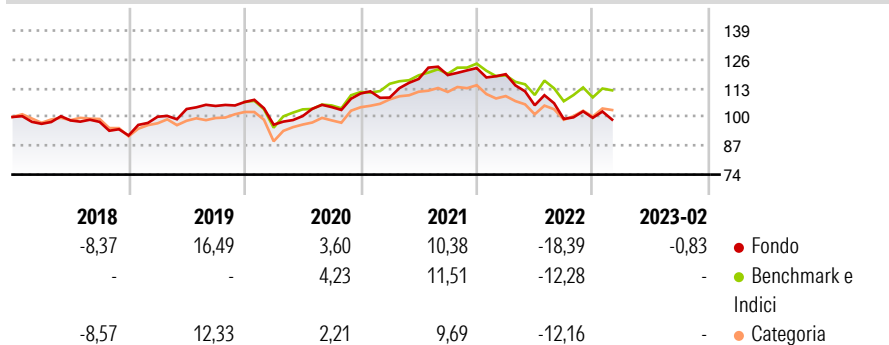
N/A

**Morningstar Rating™**

Senza 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	-3,86	3Y Sharpe Ratio	-0,08
3Y Beta	0,88	3Y Std Dev	10,81
3Y R-Squared	70,70	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-0,72	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	6,00	10Y Risk	-

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

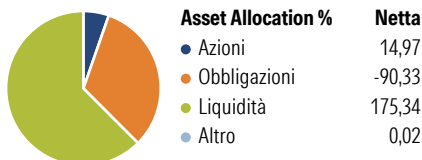
**Rend. Cumulati %**

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	0,99	7,45	7,14
6-Mesi	0,86	6,24	6,65
1-Anno	-15,29	12,74	14,15
3-Anni Ann.ti	1,99	9,92	9,28
5-Anni Ann.ti	0,90	5,11	4,26
10-Anni Ann.ti	-	5,97	4,64

Rendimenti aggiornati al 24/03/2023

**Rendimenti**

	Q1	Q2	Q3	Q4
<b>Trimestrali %</b>				
2026	-	-	-	-
2025	-	-	-	-
2024	-	-	-	-
2023	-	-	-	-
2022	-2,26	-11,77	-5,85	0,51

**Portafoglio 31/12/2025**

**Morningstar Style Box®**
**Stile Azionario**

**Reddito Fisso**

**Titoli principali**

Nome	Settore	%
United States Treasury Notes...	—	17,12
United States Treasury Notes...	—	5,71
Star Compass PLC	—	5,28
Star Helios Plc	—	5,28
United States Treasury Notes...	—	4,68
United States Treasury Notes...	—	4,27
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...	—	3,16
United Kingdom of Great...	—	1,54
NVIDIA Corp	☑	1,45
United Kingdom of Great...	—	1,36
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		49,85
Numero Complessivo di Titoli Azionari		862
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		119

**Distribuzione Settoriale %**

	Fondo
🔄 Ciclico	33,65
📈 Sensibile	50,11
📉 Difensivo	16,24

**Fixed Income Sector Weightings %**

	Fondo
🏛️ Governativo	-68,67
⚙️ Societario	12,42
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏢 Enti Locali	0,00
📄 Liquidità ed equivalenti	194,40
📑 Derivati	-38,15

**Ripartizione Geografica %**

	Fondo
<b>America</b>	<b>67,33</b>
Stati Uniti	63,82
Canada	2,48
America Latina e Centrale	1,04
<b>Europa</b>	<b>15,90</b>
Regno Unito	2,45
Europa Occidentale - Euro	7,51
Europa Occidentale - Non Euro	4,90
Europa dell'Est	0,17
Africa	0,32
Medio Oriente	0,56
<b>Asia</b>	<b>16,77</b>
Giappone	5,19
Australasia	1,77
Asia - Paesi Sviluppati	5,06
Asia - Emergente	4,76

**Anagrafica**

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	44,76 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	09/12/2013	UCITS	Si	Spese correnti	0,78%
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995954426		
NAV (24/03/2023)	EUR 109,01				
Patrimonio Netto (Mln)	554,38 USD				

(31/12/2025)

See disclosures for more details

© 2026 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 accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotte; (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.