AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class A2 USD Acc

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili USD

Benchmark Morningstar

Morningstar EAA USD Mod Target Allocation NR USD Usato nel Report **Benchmark Dichiarato**

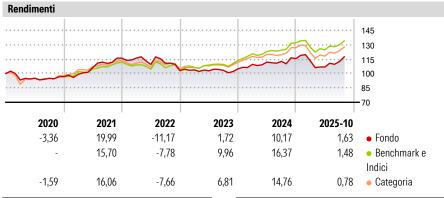
N/A

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).



Misure di Rischio)			
3Y Alpha	-5,13	3Y Sharpe Ratio	-0,07	
3Y Beta	0,99	3Y Std Dev	9,07	
3Y R-Squared	78,03	3Y Risk	Med	
3Y Info Ratio	-1,43	5Y Risk	Med	
3Y Tracking Error	4,03	10Y Risk	-	
Rasati su Morningstar EAA HSD Mod Target Allocation NR HSD (dove applicabile)				

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	6,31	4,50	4,79	Trimestrali %				
6-Mesi	9,33	6,24	6,21	2025	-2,12	-5,53	5,31	-
1-Anno	0,93	1,62	-0,23	2024	4,46	2,23	0,61	2,55
3-Anni Ann.ti	2,61	6,97	4,34	2023	0,73	-0,97	0,51	1,46
5-Anni Ann.ti	3,83	6,74	5,20	2022	0,10	-5,76	1,18	-6,93
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	2,63	7,03	4,09	4,94
Rendimenti aggiornati al 28/11/2	2025							

Portafoglio 31/12/2024



Morningstar Style Box® Stile Azionario



Distribuzione Settoriale %



Fondo

Americhe	Eu	ropa	Asia
<25	25-50	50-75	>75

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 Azionari	i	899
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	85

(31/12/2024)

Ciclico ∴	32,9
✓ 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	-60,3′

\23	23-30	30-73	/13
Ripartizione	Geografica %		Fondo
America			68,50
Stati Uniti			64,57
Canada			2,99
America Latiı	na e Centrale		0,94
Europa			14,28
Regno Unito			2,45
Europa Occid	entale - Euro		6,35
Europa Occid	entale - Non Eu	0	4,31
Europa dell'E	st		0,16
Africa			0,33
Medio Orient	е		0,69
Asia			17,22
Giappone			4,96
Australasia			1,90
Asia - Paesi S	viluppati		4,49
Asia - Emerge	ente		5,87

Anagrafica					
Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	21,35 USD	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo	150.000.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,45%
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	0,45%
Data di Partenza	21/04/2017	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995951836		
NAV (28/11/2025)	USD 146,73				
Patrimonio Netto (MIn)	819,86 USD				

© 2025 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 prodotto; (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 risconttro nel futuro.

