

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

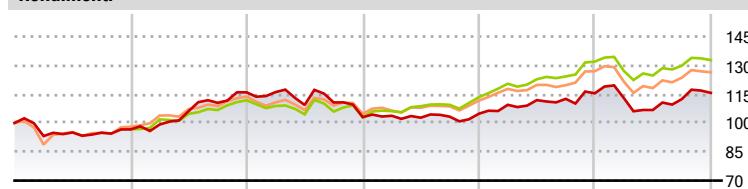
Morningstar Rating™

★★

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).

Rendimenti



| 2020 | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025-12 |
|-------|-------|--------|------|-------|---------|
| -3,36 | 19,99 | -11,17 | 1,72 | 10,17 | 0,19 |
| - | 15,70 | -7,78 | 9,96 | 16,37 | 0,60 |
| -1,59 | 16,06 | -7,66 | 6,81 | 14,76 | -0,03 |

Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | -4,79 | 3Y Sharpe Ratio | 0,15 |
| 3Y Beta | 1,04 | 3Y Std Dev | 8,31 |
| 3Y R-Squared | 78,03 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | -1,28 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 3,90 | 10Y Risk | - |

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

Rend. Cumulati %

| Fondo | Bmk | Cat |
|----------------|------|------|
| 3-Mesi | 1,37 | 0,24 |
| 6-Mesi | 7,74 | 4,11 |
| 1-Anno | 0,63 | 0,01 |
| 3-Anni Ann.ti | 4,40 | 7,86 |
| 5-Anni Ann.ti | 3,87 | 6,62 |
| 10-Anni Ann.ti | - | 5,43 |

Rendimenti aggiornati al 30/01/2026

Rendimenti Trimestrali %

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|-------|-------|------|-------|
| 2026 | - | - | - | - |
| 2025 | -2,12 | -5,53 | 5,31 | 2,88 |
| 2024 | 4,46 | 2,23 | 0,61 | 2,55 |
| 2023 | 0,73 | -0,97 | 0,51 | 1,46 |
| 2022 | 0,10 | -5,76 | 1,18 | -6,93 |

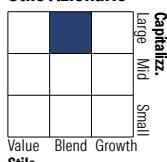
Portafoglio 30/06/2025



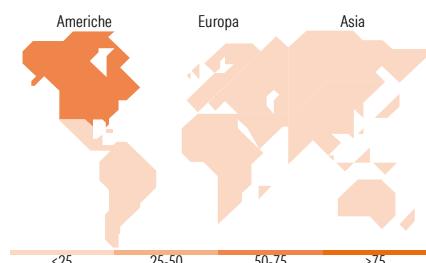
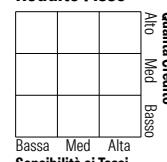
| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|--------|
| • Azioni | 10,74 |
| • Obbligazioni | -72,12 |
| • Liquidità | 161,35 |
| • Altro | 0,03 |

Morningstar Style Box®

Stile Azionario



Reddito Fisso



Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| United States Treasury Notes... | - | 8,57 |
| United States Treasury Notes... | - | 7,16 |
| United States Treasury Notes... | - | 6,02 |
| United States Treasury Notes... | - | 5,62 |
| UBS (Irl) Sel Money Mkt USD... | - | 4,87 |
| Star Compass PLC | - | 4,76 |
| Star Helios Plc | - | 4,76 |
| France (Republic Of) 0,1% | - | 2,99 |
| United Kingdom of Great... | - | 2,24 |
| United Kingdom of Great... | - | 1,97 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 48,96 |
| Numeri Complessivo di Titoli Azionari | | 861 |
| Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 118 |

Distribuzione Settoriale %

Fondo

| | |
|---|--------------|
| ● Ciclico | 34,26 |
| ● Sensibile | 49,10 |
| ● Difensivo | 16,64 |
| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
| ● Governativo | -55,11 |
| ● Societario | 10,66 |
| ● Cartolarizzazioni | 0,00 |
| ● Enti Locali | 0,00 |
| ● Liquidità ed equivalenti | 180,22 |
| ● Derivati | -35,78 |

Ripartizione Geografica %

Fondo

| | |
|-------------------------------|--------------|
| America | 66,89 |
| Stati Uniti | 63,00 |
| Canada | 2,90 |
| America Latina e Centrale | 1,00 |
| Europa | 15,78 |
| Regno Unito | 2,86 |
| Europa Occidentale - Euro | 6,93 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 4,70 |
| Europa dell'Est | 0,20 |
| Africa | 0,31 |
| Medio Oriente | 0,76 |
| Asia | 17,34 |
| Giappone | 4,82 |
| Australasia | 2,00 |
| Asia - Paesi Sviluppati | 4,95 |
| Asia - Emergenti | 5,56 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|----------------------------|---|--------------|------------------------------|-----------------|
| Società di Gestione | AQR Capital Management LLC | Patrimonio Classe (Mln) (30/01/2026) | 21,99 USD | Investimento Min. Ingresso | 150.000.000 USD |
| Telefono | 1 (203) 742-3600 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | http://www.aqr.com/ | Valuta del Fondo | USD | T.E.R. | 0,45% |
| Data di Partenza | 21/04/2017 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,45% |
| Nome del Gestore | John Huss | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 28/02/2012 | ISIN | LU0995951836 | | |
| NAV (30/01/2026) | USD 152,88 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 548,97 USD | | | | |
| (30/06/2025) | | | | | |

© 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 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 riscontro nel futuro.