

# 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**

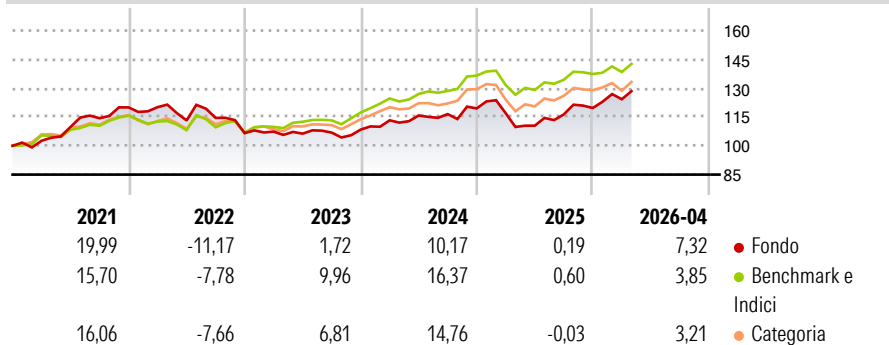
N/A

**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**

**Misure di Rischio**

3Y Alpha	-2,72	3Y Sharpe Ratio	0,45
3Y Beta	1,06	3Y Std Dev	8,74
3Y R-Squared	79,84	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,65	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	4,07	10Y Risk	-

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

**Rend. Cumulati %**

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	5,94	3,76	3,05
6-Mesi	8,42	5,43	4,91
1-Anno	17,53	10,38	11,58
3-Anni Ann.ti	6,73	9,35	7,17
5-Anni Ann.ti	4,57	6,86	5,25
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 13/05/2026

**Rendimenti**

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	3,78	-	-	-
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 %**

- Azioni
- Obbligazioni
- Liquidità
- Altro

**Netta**

10,74  
-72,12  
161,35  
0,03

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

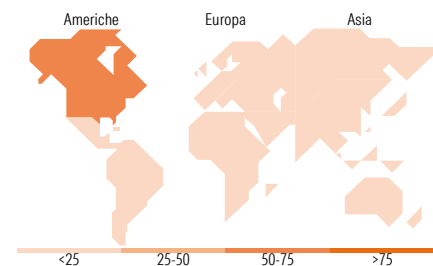
	Value	Blend	Growth
Capitaliz.	Small	Mid	Large

**Reddito Fisso**

	Bassa	Med	Alta
Qualità Credito	Basso	Med	Alto

Stile

Sensibilità ai Tassi


**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 (Iri) 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
Numero Complessivo di Titoli Azionari		861
Numero 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
<b>America</b>	<b>66,89</b>
Stati Uniti	63,00
Canada	2,90
America Latina e Centrale	1,00
<b>Europa</b>	<b>15,78</b>
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
<b>Asia</b>	<b>17,34</b>
Giappone	4,82
Australasia	2,00
Asia - Paesi Sviluppati	4,95
Asia - Emergente	5,56

**Anagrafica**

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	28,22 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 (13/05/2026)	USD 160,26				
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 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.