

AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class A3 USD Acc

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili USD

Benchmark Morningstar

Morningstar EAA USD Mod Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

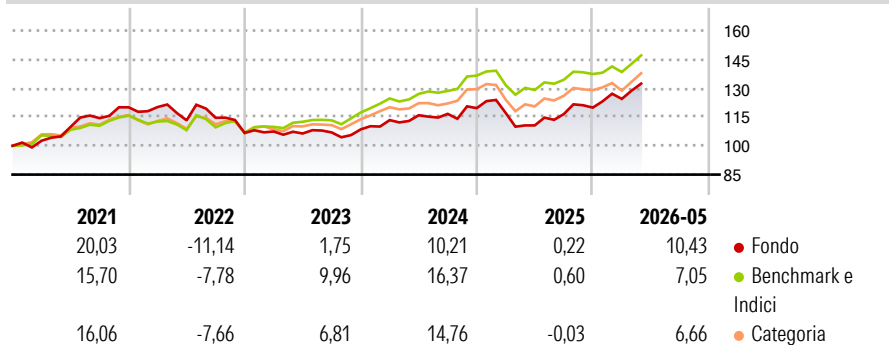
N/A

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	-2,40	3Y Sharpe Ratio	0,51
3Y Beta	1,05	3Y Std Dev	8,83
3Y R-Squared	79,52	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,57	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	4,04	10Y Risk	-

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

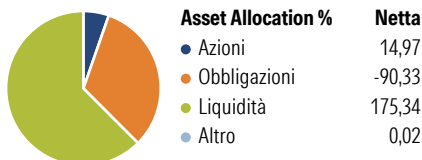
Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	7,54	8,32	7,94
6-Mesi	12,49	8,62	9,46
1-Anno	20,58	16,02	18,07
3-Anni Ann.ti	7,52	10,25	8,54
5-Anni Ann.ti	4,16	6,76	5,40
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	3,79	-	-	-
2025	-2,11	-5,53	5,32	2,89
2024	4,46	2,23	0,61	2,56
2023	0,73	-0,97	0,52	1,48
2022	0,11	-5,76	1,19	-6,92

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
America	67,33
Stati Uniti	63,82
Canada	2,48
America Latina e Centrale	1,04
Europa	15,90
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
Asia	16,77
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)	96,19 USD	Investimento Min. Ingresso	300.000.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	0,42%
Data di Partenza	01/10/2020	UCITS	Si	Spese correnti	0,42%
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995952057		
NAV (26/06/2026)	USD 131,84				
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.