

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

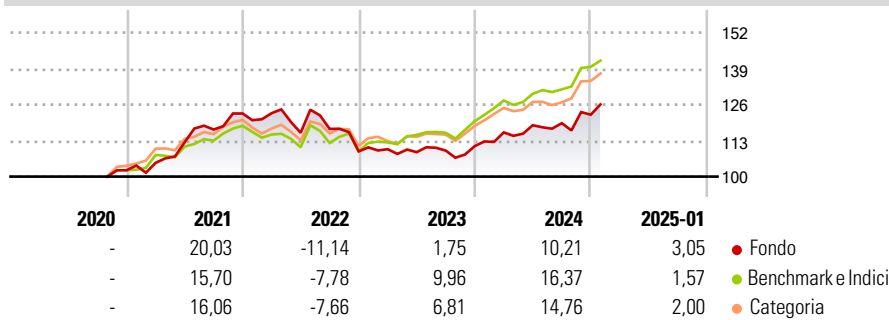
N/A

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

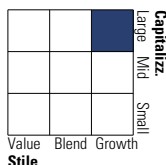
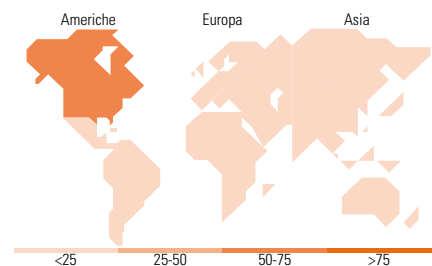
3Y Alpha	-5,08	3Y Sharpe Ratio	-0,04
3Y Beta	0,95	3Y Std Dev	8,90
3Y R-Squared	85,22	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,29	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	4,02	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	7,53	7,28	7,29	2025	-	-	-	-
6-Mesi	7,64	10,57	9,46	2025	-	-	-	-
1-Anno	11,57	15,03	13,17	2024	4,46	2,23	0,61	2,56
3-Anni Ann.ti	2,39	7,72	5,77	2023	0,73	-0,97	0,52	1,48
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	0,11	-5,76	1,19	-6,92
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	2,63	7,05	4,10	4,95

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Portafoglio 30/06/2024

Morningstar Style Box®
Stile Azionario

Reddito Fisso

Titoli principali

Nome	Settore	%
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...	-	8,14
United States Treasury Notes...	-	4,84
United States Treasury Notes...	-	4,44
United States Treasury Notes...	-	3,26
France (Republic Of) 0.1%	-	2,90
France (Republic Of) 0.1%	-	1,66
United Kingdom of Great...	-	1,50
Microsoft Corp	☑	1,38
United Kingdom of Great...	-	1,34
United Kingdom of Great...	-	1,33
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		30,78
Numero Complessivo di Titoli Azionari		890
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		29

Distribuzione Settoriale %

	Fondo
🔄 Ciclico	31,75
📈 Sensibile	49,04
📉 Difensivo	19,21

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛️ Governativo	-49,11
⚙️ Societario	0,00
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏢 Enti Locali	0,00
📄 Liquidità ed equivalenti	150,25
📁 Derivati	-1,13

Ripartizione Geografica %

	Fondo
America	68,26
Stati Uniti	64,36
Canada	3,01
America Latina e Centrale	0,89
Europa	15,61
Regno Unito	2,47
Europa Occidentale - Euro	6,98
Europa Occidentale - Non Euro	5,15
Europa dell'Est	0,13
Africa	0,29
Medio Oriente	0,60
Asia	16,13
Giappone	5,27
Australasia	2,09
Asia - Paesi Sviluppati	4,18
Asia - Emergente	4,59

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	24,05 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.	-
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 (04/02/2025)	USD 111,01				
Patrimonio Netto (Mln)	845,99 USD				

(30/06/2024)