

AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class B2 EUR Acc

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Moderate Global Target N/A

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

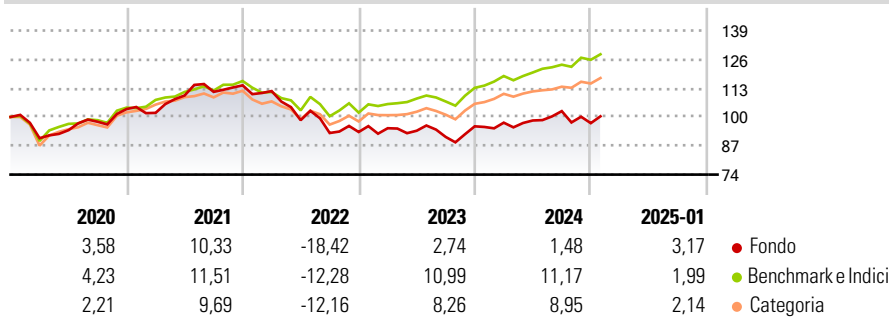
Morningstar Rating™

★

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	-7,32	3Y Sharpe Ratio	-0,48
3Y Beta	1,07	3Y Std Dev	10,43
3Y R-Squared	76,36	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-1,46	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	5,04	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,80	4,51	4,13	2025	-	-	-	-
6-Mesi	1,19	7,22	5,67	2025	-	-	-	-
1-Anno	5,17	11,81	11,11	2024	1,71	1,02	4,29	-5,29
3-Anni Ann.ti	-3,05	4,72	3,45	2023	1,81	-1,19	-2,99	5,27
5-Anni Ann.ti	-0,16	4,80	3,75	2022	-2,26	-11,77	-5,86	0,51
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	-1,67	7,70	1,49	2,65

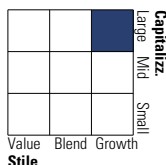
Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Portafoglio 30/06/2024

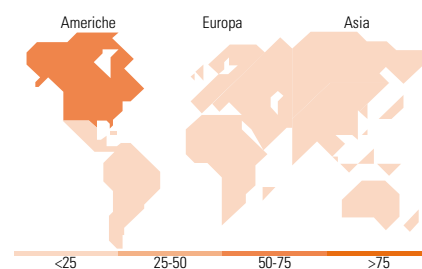


Morningstar Style Box®

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)	23,12 EUR	Investimento Min. Ingresso	12.000.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	20/04/2017	UCITS	Si	Spese correnti	0,45%
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995952305		
NAV (04/02/2025)	EUR 112,64				
Patrimonio Netto (Mln)	845,99 USD				

(30/06/2024)