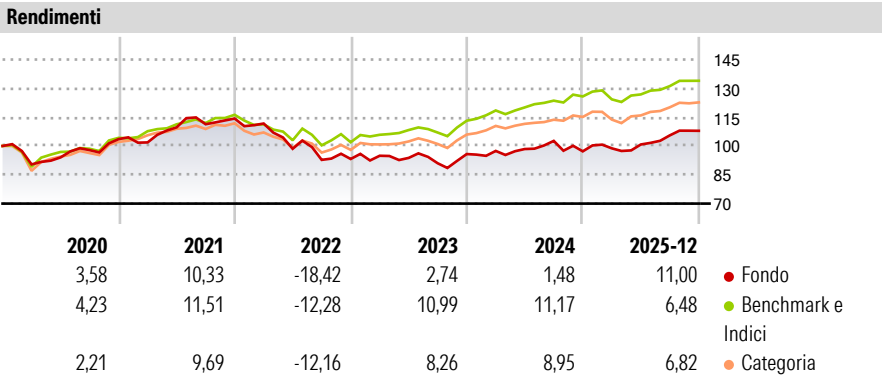


AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class B2 EUR Acc

<b>Categoria Morningstar™</b>	<b>Benchmark Morningstar</b>	<b>Benchmark Dichiarato</b>	<b>Morningstar Rating™</b>
Bilanciati Flessibili EUR - Globali	Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report	N/A	★

**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).



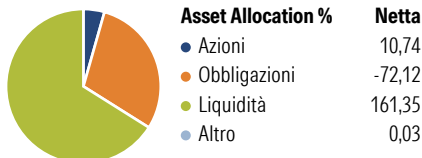
Misure di Rischio			
3Y Alpha	-4,75	3Y Sharpe Ratio	0,27
3Y Beta	1,10	3Y Std Dev	8,21
3Y R-Squared	60,91	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,88	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	5,18	10Y Risk	-

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	2,67	1,28	2,88	2026	-	-	-	-
6-Mesi	10,24	5,20	7,78	2025	1,62	2,02	4,71	2,25
1-Anno	12,38	6,19	8,03	2024	1,71	1,02	4,29	-5,29
3-Anni Ann.ti	5,09	8,58	7,97	2023	1,81	-1,19	-2,99	5,27
5-Anni Ann.ti	1,35	5,46	4,59	2022	-2,26	-11,77	-5,86	0,51
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

Portafoglio 30/06/2025



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)	18,91 EUR	Investimento Min. Ingresso	12.000.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	(29/01/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,45%
Data di Partenza	20/04/2017	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,45%
Nome del Gestore	John Huss	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	Inc/Acc	Acc		
NAV (29/01/2026)	EUR 126,10	ISIN	LU0995952305		
Patrimonio Netto (Mln)	548,97 USD				

(30/06/2025)