

# 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**

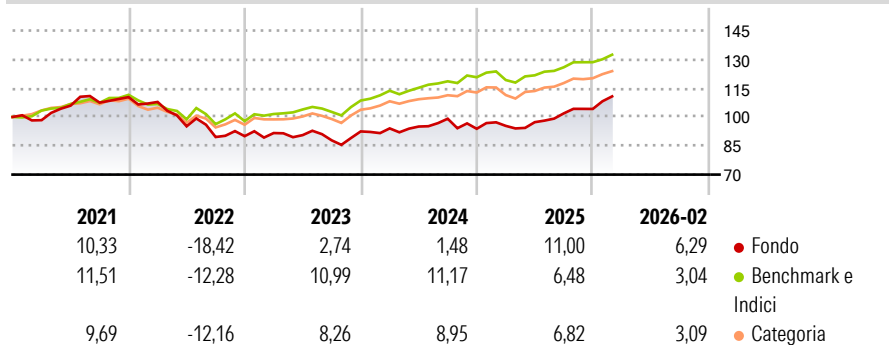
N/A

**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	-2,57	3Y Sharpe Ratio	0,56
3Y Beta	1,12	3Y Std Dev	8,04
3Y R-Squared	58,65	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,40	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	5,25	10Y Risk	-

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

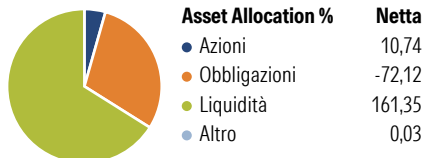
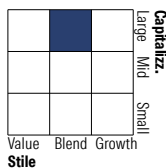
**Rend. Cumulati %**

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	0,68	-1,78	-1,03
6-Mesi	2,67	0,73	1,74
1-Anno	8,79	5,19	5,66
3-Anni Ann.ti	4,51	8,02	7,40
5-Anni Ann.ti	0,88	4,14	3,56
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 27/03/2026

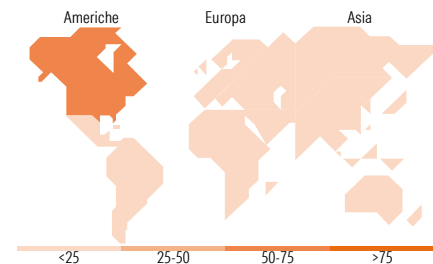
**Rendimenti**

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	1,62	2,02	4,71	2,25
2024	1,71	1,02	4,29	-5,29
2023	1,81	-1,19	-2,99	5,27
2022	-2,26	-11,77	-5,86	0,51

**Portafoglio 30/06/2025**

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

**Reddito Fisso**


Value Blend Growth  
Stile

Bassa Med Alta  
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)	17,07 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.	0,45%
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 (27/03/2026)	EUR 121,24				
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.