

AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class D2 CHF Acc

Categoria Morningstar™

Bilanciati Altro

Benchmark Morningstar

Not Categorized
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

Morningstar Rating™

Senza 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	-	3Y Sharpe Ratio	-0,27
3Y Beta	-	3Y Std Dev	11,85
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

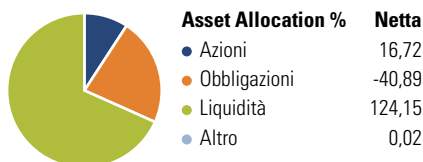
Periodo	Rendimento (%)
3-Mesi	1,00
6-Mesi	-0,45
1-Anno	1,90
3-Anni Ann.ti	-0,87
5-Anni Ann.ti	1,32
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

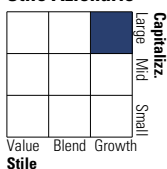
Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	-3,36	1,49	6,00	-5,66
2023	0,97	0,02	-2,68	8,96
2022	-1,25	-9,84	-2,23	-2,19
2021	-3,95	8,64	2,87	7,15

Portafoglio 30/06/2024

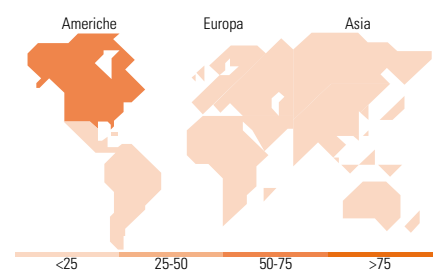
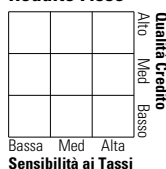


Morningstar Style Box®

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	Software	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 %

Settore	Fondo
Ciclico	31,75
Sensibile	49,04
Difensivo	19,21

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
Governativo	-49,11
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	150,25
Derivati	-1,13

Ripartizione Geografica %

Region	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)	92,09 CHF	Investimento Min. Ingresso	150.000.000 CHF
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	CHF	T.E.R.	-
Data di Partenza	21/04/2017	UCITS	Si	Spese correnti	0,45%
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995953451		
NAV (04/02/2025)	CHF 105,09				
Patrimonio Netto (Mln)	845,99 USD				

(30/06/2024)