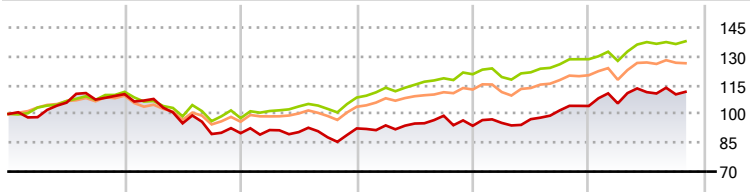
# AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class E2 EUR Inc

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Bilanciati Flessibili EUR - Globali | Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR<br>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).

## Rendimenti




| | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-10 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fondo | 10,33 | -18,42 | 2,73 | 1,48 | 11,00 | 7,08 |
| Benchmark e Indici | 11,51 | -12,28 | 10,99 | 11,17 | 6,48 | 7,26 |
| Categoria | 9,69 | -12,16 | 8,26 | 8,95 | 6,82 | 5,24 |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | -2,20 | 3Y Sharpe Ratio | 0,77 |
| 3Y Beta | 1,10 | 3Y Std Dev | 8,53 |
| 3Y R-Squared | 61,90 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | -0,32 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 5,31 | 10Y Risk | - |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | -2,86 | -0,18 | -1,56 |
| 6-Mesi | -2,67 | 3,19 | 1,45 |
| 1-Anno | 5,85 | 7,62 | 7,77 |
| 3-Anni Ann.ti | 8,16 | 10,28 | 9,51 |
| 5-Anni Ann.ti | -0,31 | 4,47 | 3,42 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 10/11/2026

| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | 1,29 | 5,53 | -1,03 | - |
| 2025 | 1,62 | 2,02 | 4,72 | 2,25 |
| 2024 | 1,70 | 1,03 | 4,28 | -5,29 |
| 2023 | 1,80 | -1,19 | -2,98 | 5,27 |
| 2022 | -2,27 | -11,78 | -5,86 | 0,51 |

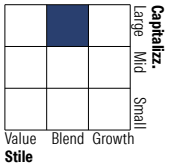
## Portafoglio 31/12/2025



| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 14,97 |
| Obbligazioni | -90,33 |
| Liquidità | 175,34 |
| Altro | 0,02 |

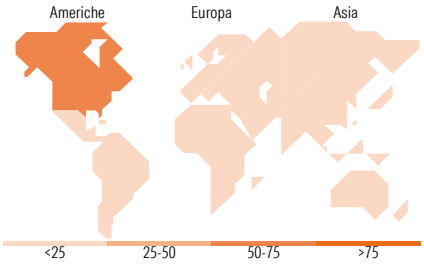
**Morningstar Style Box®**

**Stile Azionario**




**Reddito Fisso**




### Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| United States Treasury Notes... | — | 17,12 |
| United States Treasury Notes... | — | 5,71 |
| Star Compass PLC | — | 5,28 |
| Star Helios Plc | — | 5,28 |
| United States Treasury Notes... | — | 4,68 |
| United States Treasury Notes... | — | 4,27 |
| UBS (Irl) Sel Money Mkt USD... | — | 3,16 |
| United Kingdom of Great... | — | 1,54 |
| NVIDIA Corp | | 1,45 |
| United Kingdom of Great... | — | 1,36 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 49,85 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 862 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 119 |

| Distribuzione Settoriale % | Fondo |
|---|---|
| Ciclico | 33,65 |
| Sensibile | 50,11 |
| Difensivo | 16,24 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | -68,67 |
| Societario | 12,42 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 194,40 |
| Derivati | -38,15 |

| Ripartizione Geografica % | Fondo |
|---|---|
| **America** | **67,33** |
| Stati Uniti | 63,82 |
| Canada | 2,48 |
| America Latina e Centrale | 1,04 |
| **Europa** | **15,90** |
| Regno Unito | 2,45 |
| Europa Occidentale - Euro | 7,51 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 4,90 |
| Europa dell'Est | 0,17 |
| Africa | 0,32 |
| Medio Oriente | 0,56 |
| **Asia** | **16,77** |
| Giappone | 5,19 |
| Australasia | 1,77 |
| Asia - Paesi Sviluppati | 5,06 |
| Asia - Emergente | 4,76 |

## Anagrafica

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| Società di Gestione | AQR Capital Management LLC | Patrimonio Classe (Mln) (09/11/2026) | 0,37 EUR | Investimento Min. Ingresso | 120.000.000 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 | 15/02/2018 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,45% |
| Nome del Gestore | John Huss | Inc/Acc | Inc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 30/08/2012 | ISIN | LU0995954004 | | |
| NAV (10/11/2026) | EUR 111,41 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) (31/12/2025) | 554,38 USD | | | | |

See disclosures for more details

© 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 prodotto; (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.