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

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

Benchmark Morningstar

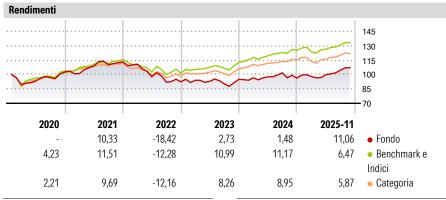
Benchmark Dichiarato

Morningstar Rating™

Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report

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	-3,85	3Y Sharpe Ratio	0,16
3Y Beta	1,03	3Y Std Dev	8,42
3Y R-Squared	61,19	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,77	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	5,26	10Y Risk	-
Basati su Morningstar Euro	Moderate	Global Target Allocation N	IR EUR (dove

applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	5,10	3,63	3,54	Trimestrali %				
6-Mesi	10,84	6,08	6,44	2025	1,62	2,02	4,72	-
1-Anno	8,43	5,68	5,63	2024	1,70	1,03	4,28	-5,29
3-Anni Ann.ti	4,11	8,05	7,13	2023	1,80	-1,19	-2,98	5,27
5-Anni Ann.ti	1,24	5,42	4,52	2022	-2,27	-11,78	-5,86	0,51
10-Anni Ann.ti Rendimenti aggiornati al 28/11/2	- 2025	-	=	2021	-1,67	7,70	1,49	2,66

Portafoglio 31/12/2024







Distribuzione Settoriale %



Fondo



Titoli principali		
Nome Setto	re	%
United States Treasury Notes	_	6,93
United States Treasury Notes	_	6,51
Star Compass PLC	_	5,41
Star Helios Plc	_	5,41
France (Republic Of) 0.1%	_	4,04
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD	_	2,25
France (Republic Of) 0.1%	_	2,21
France (Republic Of) 0.1%	_	1,99
United Kingdom of Great	_	1,75
France (Republic Of) 0.1%	-	1,72
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		38,23
Numero Complessivo di Titoli Azionari		899
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		85

(31/12/2024)

♣ Ciclico	32,95		
✓ Sensibile	48,55		
→ Difensivo	18,50		
Fixed Income Sector Weightings %	Fondo		
₩ Governativo	-32,08		
Societario	14,76		
★ Cartolarizzazioni	0,00		
Enti Locali	0.00		

V OCHSIBIIC	40,5.
→ Difensivo	18,50
Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
₩ Governativo	-32,08
Societario	14,76
♠ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	177,63
Derivati	-60,3′

23	23 30	0.3
Ripartizione Ge	eografica %	Fondo
America		68,50
Stati Uniti		64,57
Canada		2,99
America Latina	e Centrale	0,94
Europa		14,28
Regno Unito		2,45
Europa Occiden	tale - Euro	6,35
Europa Occiden	tale - Non Euro	4,31
Europa dell'Est		0,16
Africa		0,33
Medio Oriente		0,69
Asia		17,22
Giappone		4,96
Australasia		1,90
Asia - Paesi Svil	uppati	4,49
Asia - Emergent	e	5,87

				3
Anagrafica				
Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln) (28/11/2025)	0,34 EUR	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti
Data di Partenza	15/02/2018	UCITS	Si	Commissione di incentivo
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Inc	
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU0995954004	
NAV (28/11/2025)	EUR 105,87			
Patrimonio Netto (MIn)	819,86 USD			

120.000.000 EUR

0,45% 0,45%