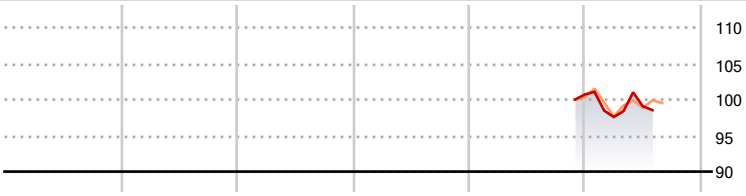
AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund RAE4F EUR Acc

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



2013	2014	2015	2016	2017	2018-08	
-	-	-	-	-	-1,85	Fondo
-	-	-	-	-	-	Benchmark e Indici
-	-	-	-	-	-	Categoria

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-1,30	1,99	2,86
6-Mesi	0,72	5,18	5,95
1-Anno	-	4,39	4,43
3-Anni Ann.ti	-	8,27	7,39
5-Anni Ann.ti	-	5,22	4,49
10-Anni Ann.ti	-	-	-

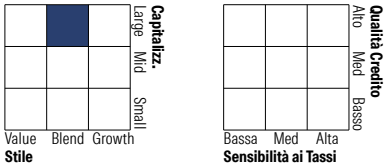
Rendimenti aggiornati al 24/08/2018

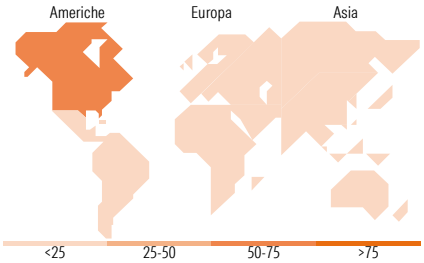
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	-	-	-	-
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-
2021	-	-	-	-

Portafoglio 30/06/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	10,74
Obbligazioni	-72,12
Liquidità	161,35
Altro	0,03

Morningstar Style Box®





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 (Irl) 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
America	**66,89**
Stati Uniti	63,00
Canada	2,90
America Latina e Centrale	1,00
Europa	**15,78**
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
Asia	**17,34**
Giappone	4,82
Australasia	2,00
Asia - Paesi Sviluppati	4,95
Asia - Emergente	5,56

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	16/11/2017
Nome del Gestore	John Huss
Data Inizio Gestione	28/02/2012
NAV (24/08/2018)	EUR 99,51
Patrimonio Netto (Mln) (30/06/2025)	548,97 USD

Patrimonio Classe (Mln) (24/08/2018)	0,06 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1662511259

Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	0,50%
Commissione di incentivo	-

© 2025 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.