## **AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund RAG4F GBP Acc**

Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili GBP

**Benchmark Morningstar** 

Morningstar UK Moderate Target Allocation NR GBP Usato nel Report **Benchmark Dichiarato** 

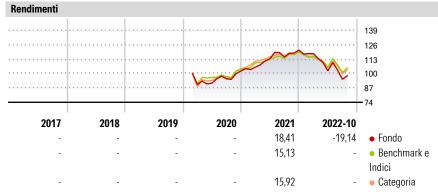
N/A

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).



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 UK Moderate Target Allocation NR GBP (dove applicabile)					

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-10,29	3,52	2,77	Trimestrali %				
6-Mesi	-8,09	4,81	3,64	2025	-	-	-	-
1-Anno	-18,47	4,01	3,22	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	8,11	6,10	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	6,02	4,91	2022	-2,66	-13,12	-7,38	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	3,46	7,11	1,48	5,30
Rendimenti aggiornati al 10/11/2	2022							

## Portafoglio 31/12/2024





Distribuzione Settoriale %



Fondo



Titoli principali		
Nome	Settore	%
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 (IrI) 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
NumeroComplessivodiTitoliObbligazio	onari	85

(31/12/2024)

♣ Ciclico	32,95
✓ Sensibile	48,55
→ Difensivo	18,50
Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
₩ Governativo	-32,08
<ul><li>Societario</li></ul>	14,76
★ Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
🚅 Liquidità ed equivalenti	177,63
■ Derivati	-60,31

23	25 50	30 13	
Ripartizion	e Geografica %		Fondo
America			68,50
Stati Uniti			64,57
Canada			2,99
America Lat	ina e Centrale		0,94
Europa			14,28
Regno Unito	1		2,45
Europa Occi	dentale - Euro		6,35
Europa Occi	dentale - Non Euro		4,31
uropa dell'	Est		0,16
Africa			0,33
Medio Orien	te		0,69
Asia			17,22
Giappone			4,96
Australasia			1,90
Asia - Paesi	Sviluppati		4,49
Asia - Emerç	gente		5,87

Anagrafica					
Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (MIn)	0,09 USD	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo	10.000 GBP
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	GBP	Spese correnti	0,50%
Data di Partenza	18/02/2020	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU1662511176		
NAV (10/11/2022)	GBP 94,21				
Patrimonio Netto (MIn)	819,86 USD				