

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

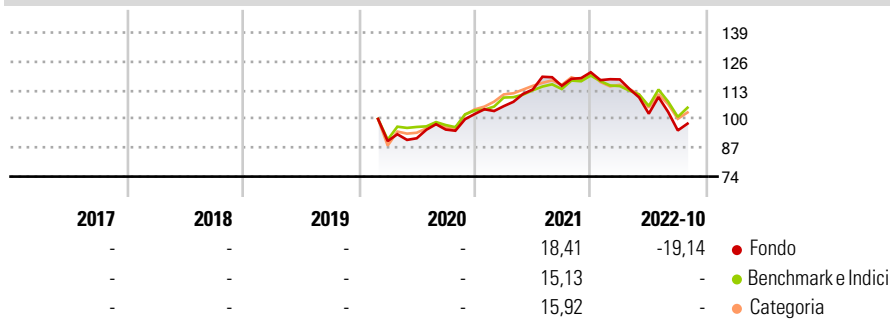
Morningstar Rating™

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).

Rendimenti



Misure di Rischio

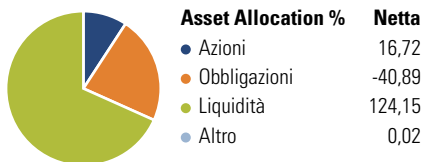
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Basati su Morningstar UK Moderate Target Allocation NR GBP (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-10,29	5,00	3,52	2025	-	-	-	-
6-Mesi	-8,09	8,13	6,19	2024	-	-	-	-
1-Anno	-18,47	13,70	11,68	2023	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	4,93	2,71	2022	-2,66	-13,12	-7,38	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	3,46	7,11	1,48	5,30
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 10/11/2022

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		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 %

Distribuzione Settoriale %	Fondo
Ciclico	31,75
Sensibile	49,04
Difensivo	19,21

Fixed Income Sector Weightings %

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	-49,11
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	150,25
Derivati	-1,13

Ripartizione Geografica %

Ripartizione Geografica %	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)	0,09 USD	Investimento Min. Ingresso	10.000 GBP
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	GBP	T.E.R.	-
Data di Partenza	18/02/2020	UCITS	Si	Spese correnti	0,50%
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU1662511176		
NAV (10/11/2022)	GBP 94,21				
Patrimonio Netto (Mln)	845,99 USD				

(30/06/2024)