

# AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund RDE4F EUR Inc

## Categoria Morningstar™

Bilanciati Flessibili EUR - Globali

## Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Moderate Global Target N/A

Allocation NR EUR

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

N/A

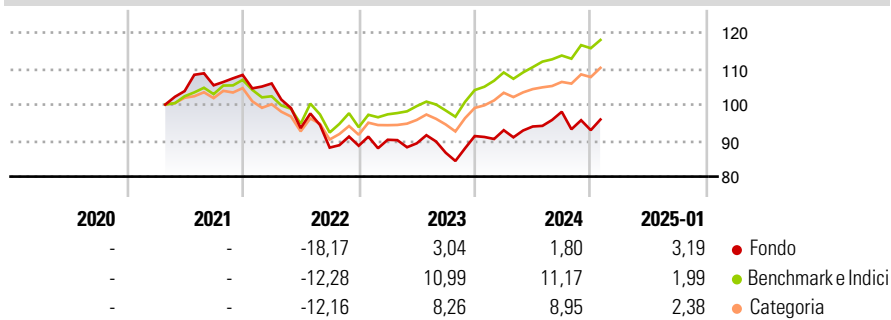
## Morningstar Rating™

★

### 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	-7,02	3Y Sharpe Ratio	-0,45
3Y Beta	1,06	3Y Std Dev	10,42
3Y R-Squared	76,38	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-1,41	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	5,04	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	2,06	3,35	3,67	2025	-	-	-	-
6-Mesi	3,74	8,87	9,57	2024	1,79	1,10	4,36	-5,21
1-Anno	6,90	12,01	11,28	2023	1,87	-1,11	-2,91	5,34
3-Anni Ann.ti	-2,34	4,87	3,90	2022	-2,20	-11,71	-5,78	0,58
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	-	-	1,55	2,74
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 07/02/2025

### 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 %

	Fondo
🔄 Ciclico	31,75
📉 Sensibile	49,04
📈 Difensivo	19,21

### 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 %

	Fondo
<b>America</b>	<b>68,26</b>
Stati Uniti	64,36
Canada	3,01
America Latina e Centrale	0,89
<b>Europa</b>	<b>15,61</b>
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
<b>Asia</b>	<b>16,13</b>
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)	0,11 EUR	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	01/04/2021	UCITS	Si	Spese correnti	0,16%
Nome del Gestore	John Huss	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/02/2012	ISIN	LU1662511929		
NAV (07/02/2025)	EUR 99,37				
Patrimonio Netto (Mln)	845,99 USD				

(30/06/2024)