

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund A USD

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001012

Benchmark Morningstar

Morningstar US Moderate Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

Morningstar Rating™

★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

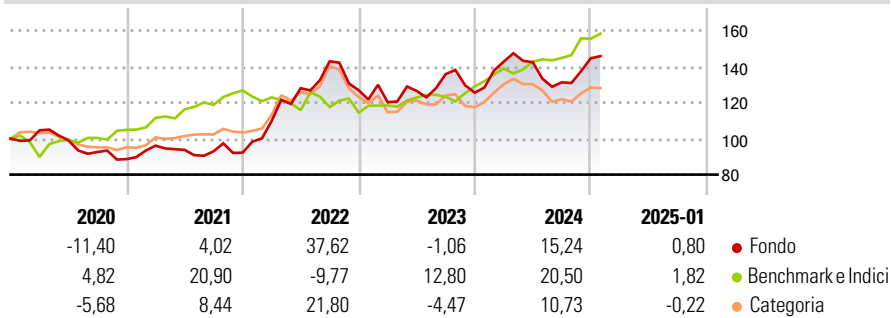
The Fund seeks to produce attractive risk-adjusted returns while maintaining low-to-zero long-term average correlation to traditional markets. The Fund is actively managed and will seek to achieve its Investment Objective by investing in a diversified portfolio of equity, currency, fixed-income instruments and eligible diversified commodity indices, both long and short, in an effort to provide exposure and performance that is, on average, lowly correlated to traditional asset classes. The Fund is not managed in reference to a benchmark.

Misure di Rischio

3Y Alpha	8,31	3Y Sharpe Ratio	0,71
3Y Beta	-0,58	3Y Std Dev	17,11
3Y R-Squared	33,64	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,25	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	21,11	10Y Risk	-

Basati su Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD (dove applicabile)

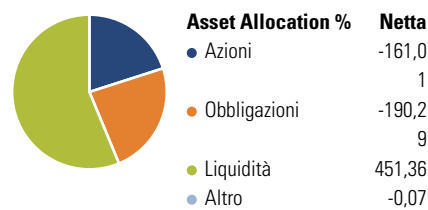
Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	12,13	8,45	8,10	2025	-	-	-	-
6-Mesi	13,09	12,88	7,48	2024	13,73	-0,21	-7,87	10,20
1-Anno	12,12	18,41	7,21	2023	-5,23	5,20	7,40	-7,59
3-Anni Ann.ti	14,42	9,58	8,60	2022	19,13	16,54	11,71	-11,26
5-Anni Ann.ti	8,14	8,95	5,64	2021	8,42	-2,46	-0,80	-0,84
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Portafoglio 30/06/2024

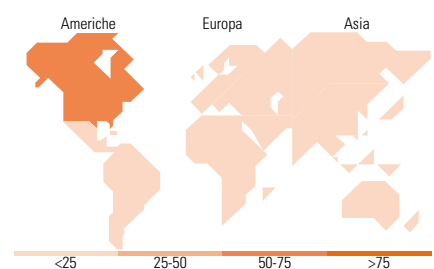


Fixed Income Style Box™

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
Star Compass PLC	—	7,70
Star Helios Plc	—	7,70
UBS (Iri) Sel Money Mkt USD...	—	7,09
Wolf Us Equity Citi Usd (Cfd)	—	0,04
Fnd Us Equity Citi Usd (Cfd)	—	0,03
Anet Us Equity Citi Usd (Cfd)	—	0,03
Alb Us Equity Citi Usd (Cfd)	—	0,02
8725 Jp Equity Citi Jpy (Cfd)	—	0,02
Lly Us Equity Citi Usd (Cfd)	—	0,02
Alny Us Equity Citi Usd (Cfd)	—	0,02
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		22,67
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1.869
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		233

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	-76,93
Societario	5,90
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	173,17
Derivati	-2,15

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	0,00
Da 6 a 8 cedole	0,00
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %

	Fondo
America	68,96
Stati Uniti	66,70
Canada	2,02
America Latina e Centrale	0,25
Europa	15,61
Regno Unito	2,70
Europa Occidentale - Euro	8,13
Europa Occidentale - Non Euro	4,77
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	15,43
Giappone	13,03
Australasia	1,64
Asia - Paesi Sviluppati	0,72
Asia - Emergente	0,04

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	9,67 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	100.000 USD
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-
Data di Partenza	05/03/2015	UCITS	Si	Spese correnti	0,79%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1103257975		
NAV (04/02/2025)	USD 136,08				
Patrimonio Netto (Mln)	511,04 USD				

(30/06/2024)