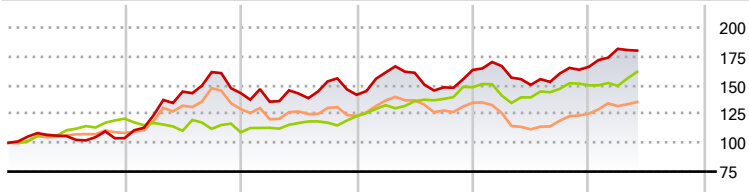
AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund A USD

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Category_EUCA001012	Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD Usato nel Report	N/A	★★★★

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.

Rendimenti



	2021	2022	2023	2024	2025	2026-05
Fondo	4,02	37,62	-1,06	15,24	1,63	8,51
Benchmark e Indici	20,90	-9,77	12,80	20,50	1,05	7,86
Categoria	8,44	21,80	-4,47	10,73	-6,78	8,04

Misure di Rischio

3Y Alpha	8,67	3Y Sharpe Ratio	0,40
3Y Beta	-0,29	3Y Std Dev	12,38
3Y R-Squared	8,27	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	-0,32	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	14,28	10Y Risk	-Med

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-0,26	10,21	1,93
6-Mesi	9,73	8,65	6,46
1-Anno	19,32	17,77	14,68
3-Anni Ann.ti	8,63	12,27	3,65
5-Anni Ann.ti	11,14	8,27	6,56
10-Anni Ann.ti	4,10	9,06	3,16

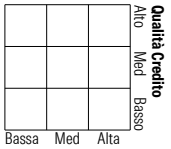
Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	9,44	-	-	-
2025	2,06	-9,80	6,55	3,61
2024	13,73	-0,21	-7,87	10,20
2023	-5,23	5,20	7,40	-7,59
2022	19,13	16,54	11,71	-11,26

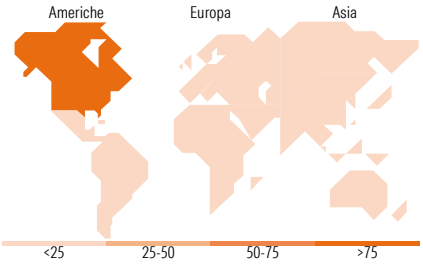
Portafoglio 31/12/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	-101,35
Obbligazioni	-230,10
Liquidità	431,47
Altro	-0,02

Fixed Income Style Box™



Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
Star Compass PLC	—	7,88
Star Helios Plc	—	7,88
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...	—	7,46
United States Treasury Bills	—	2,16
United States Treasury Bills	—	1,04
United States Treasury Bills	—	1,03
United States Treasury Bills	—	1,03
United States Treasury Bills	—	0,88
United States Treasury Bills	—	0,85
United States Treasury Bills	—	0,57
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		30,78
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1.686
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		568

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	-117,61
Societario	7,82
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	214,05
Derivati	-4,26

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	**77,84**
Stati Uniti	75,35
Canada	1,32
America Latina e Centrale	1,17
Europa	**9,16**
Regno Unito	1,53
Europa Occidentale - Euro	5,25
Europa Occidentale - Non Euro	2,38
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	**13,01**
Giappone	11,90
Australasia	0,65
Asia - Paesi Sviluppati	0,26
Asia - Emergente	0,20

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	05/03/2015
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014
NAV (26/06/2026)	USD 162,17
Patrimonio Netto (Mln) (31/12/2025)	1.037,37 USD
Patrimonio Classe (Mln) (26/06/2026)	41,01 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1103257975
Investimento Min. Ingresso	100.000 USD
Investimento Min. Successivo	100.000 USD
T.E.R.	1,21%
Spese correnti	0,73%
Commissione di incentivo	10,00%

See disclosures for more details

© 2026 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.

MORNINGSTAR