

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund C GBP

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001013

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

N/A

Morningstar Rating™

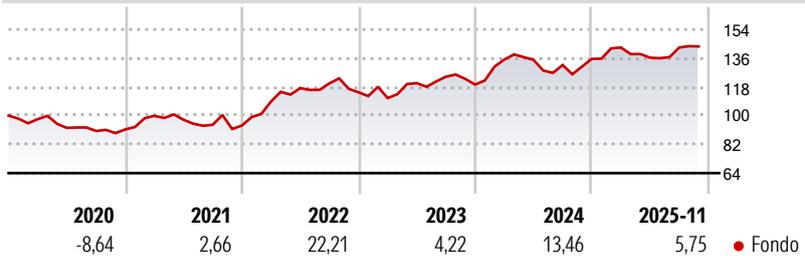
Senza rating

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 | - | 3Y Sharpe Ratio | 0,41 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 10,84 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

Rendimenti

Rend. Cumulati %

| Periodo | Fondo |
|----------------|-------|
| 3-Mesi | 6,07 |
| 6-Mesi | 3,95 |
| 1-Anno | 8,70 |
| 3-Anni Ann.ti | 8,13 |
| 5-Anni Ann.ti | 10,27 |
| 10-Anni Ann.ti | 1,48 |

Rendimenti aggiornati al 05/12/2025

Rendimenti

| Periodo | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|----------------------|-------|-------|-------|-------|
| Trimestrali % | | | | |
| 2025 | 5,26 | -4,46 | 4,68 | - |
| 2024 | 13,12 | -0,13 | -2,41 | 2,91 |
| 2023 | -3,16 | 8,41 | 3,37 | -3,96 |
| 2022 | 16,06 | 7,67 | 2,56 | -4,64 |
| 2021 | 9,28 | -2,44 | -3,20 | -0,53 |

Portafoglio 30/06/2025

Asset Allocation %

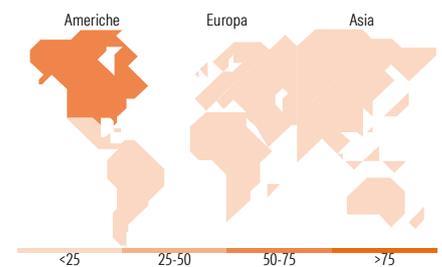
| Asset Class | Netta |
|--------------|--------|
| Azioni | -148,9 |
| Obbligazioni | -273,9 |
| Liquidità | 528,99 |
| Altro | -6,07 |

Fixed Income Style
Box™

| Quantità Credito | | Sensibilità ai Tassi |
|------------------|-------|----------------------|
| Alto | Basso | |
| | | Bassa |
| | | Med |
| | | Alta |

Fondo

- Duration Effettiva
- Maturità effettiva
- Qualità Credito Media


Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Star Compass PLC | — | 7,97 |
| Star Helios Plc | — | 7,97 |
| UBS (Irl) Sel Money Mkt USD... | — | 7,87 |
| United States Treasury Bills | — | 1,10 |
| United States Treasury Bills | — | 1,10 |
| United States Treasury Bills | — | 1,09 |
| United States Treasury Bills | — | 0,73 |
| United States Treasury Bills | — | 0,73 |
| United States Treasury Bills | — | 0,12 |
| United States Treasury Bills | — | 0,12 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 28,82 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 1.821 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 527 |

Fixed Income Sector Weightings %

| Settore | Fondo |
|--------------------------|---------|
| Governativo | -110,98 |
| Societario | 6,25 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 207,20 |
| Derivati | -2,48 |

Coupon Range %

| 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 %

| Regione | Fondo |
|-------------------------------|--------------|
| America | 62,97 |
| Stati Uniti | 60,45 |
| Canada | 1,23 |
| America Latina e Centrale | 1,29 |
| Europa | 13,93 |
| Regno Unito | 3,03 |
| Europa Occidentale - Euro | 7,35 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 3,53 |
| Europa dell'Est | 0,00 |
| Africa | 0,03 |
| Medio Oriente | 0,00 |
| Asia | 23,10 |
| Giappone | 19,64 |
| Australasia | 2,39 |
| Asia - Paesi Sviluppati | 0,48 |
| Asia - Emergente | 0,58 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|----------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------------|
| Società di Gestione | AQR Capital Management LLC | Patrimonio Classe (Mln) | 18,98 GBP | Investimento Min. Ingresso | 100.000 GBP |
| Telefono | 1 (203) 742-3600 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | http://www.aqr.com/ | Valuta del Fondo | GBP | T.E.R. | 1,21% |
| Data di Partenza | 18/06/2015 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,73% |
| Nome del Gestore | - | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | 10,00% |
| Data Inizio Gestione | 01/10/2014 | ISIN | LU1103258270 | | |
| NAV (05/12/2025) | GBP 133,62 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 806,32 USD | | | | |

(30/06/2025)