

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund D CHF

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001013

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

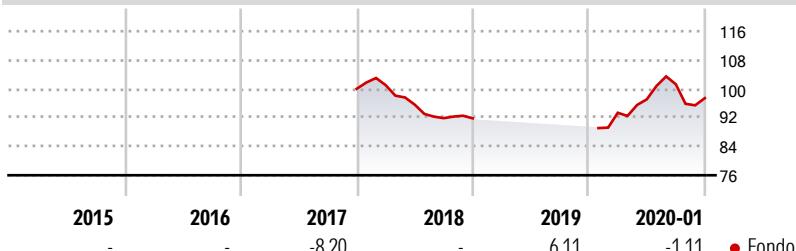
Morningstar Rating™

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.

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	- 3Y Sharpe Ratio	-0,38
3Y Beta	- 3Y Std Dev	9,47
3Y R-Squared	- 3Y Risk	-
3Y Info Ratio	- 5Y Risk	-
3Y Tracking Error	- 10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

	Fondo
3-Mesi	4,56
6-Mesi	-3,92
1-Anno	11,33
3-Anni Ann.ti	-3,71
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 20/02/2020

Rendimenti Trimestrali %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-	-	-	-
2024	-	-	-	-
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-

Portafoglio 30/06/2025



Asset Allocation %	Netta
• Azioni	-148,9
• Obbligazioni	-273,9
• Liquidità	528,99
• Altro	-6,07

Fixed Income Style Box™



Fondo

Duration Effettiva

-

Maturity effettiva

-

Qualità Credito Media

-



<25

25-50

50-75

>75

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
Numeri Complessivi di Titoli Azionari		1.821
Numeri Complessivi di Titoli Obbligazionari		527

Fixed Income Sector Weightings %

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

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	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 - Emergenti	0,58

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln) (21/02/2020)	0,25 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 CHF
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	CHF	T.E.R.	-
Data di Partenza	16/02/2016	UCITS	Si	Spese correnti	0,79%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1103258353		
NAV (20/02/2020)	CHF 82,91				
Patrimonio Netto (Mln)	806,32 USD (30/06/2025)				