

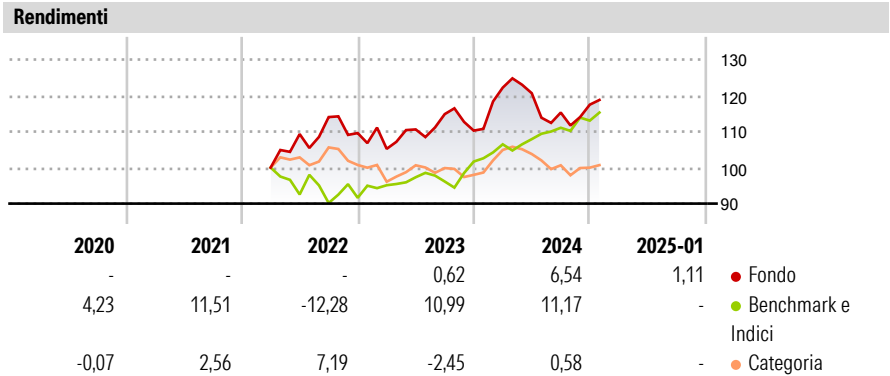
AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund E EUR

<b>Categoria Morningstar™</b>	<b>Benchmark Morningstar</b>	<b>Benchmark Dichiarato</b>	<b>Morningstar Rating™</b>
Alt - Systematic Futures	Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR Usato nel Report	N/A	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.

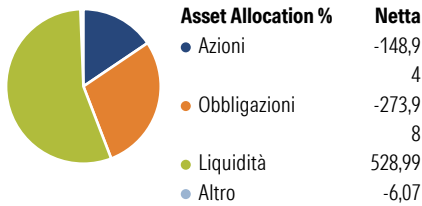
Misure di Rischio			
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-
Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)			



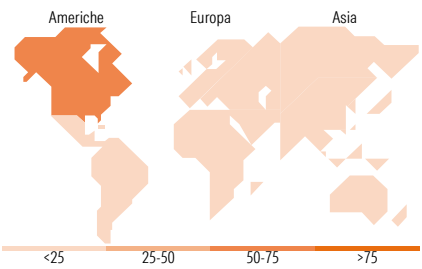
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	6,34	1,43	3,01	2026	-	-	-	-
6-Mesi	4,33	5,65	7,02	2025	-	-	-	-
1-Anno	7,24	5,88	4,61	2024	10,82	-1,26	-4,45	1,90
3-Anni Ann.ti	-	8,68	3,93	2023	-3,99	5,12	3,84	-3,99
5-Anni Ann.ti	-	4,97	2,43	2022	-	9,30	4,32	-3,90
10-Anni Ann.ti	-	6,10	0,93					

Rendimenti aggiornati al 31/01/2025

Portafoglio 30/06/2025



Fixed Income Style Box™		Fondo	
Duration Effettiva	-		
Maturità effettiva	-		
Qualità Credito Media	-		
Qualità Credito			
Alto			
Med			
Basso			
Sensibilità ai Tassi			
Bassa			
Med			
Alta			



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 %		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 - Emergente		0,58

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	7,40 EUR	Investimento Min. Ingresso	80.000.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	(31/01/2025)		Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	22/07/2015	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,64%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	Inc/Acc	Acc		
NAV (31/01/2025)	EUR 120,53	ISIN	LU1103258437		
Patrimonio Netto (Mln)	806,32 USD				

(30/06/2025)