

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund E EUR

Categoria Morningstar™

Alt - Systematic Futures

Benchmark Morningstar
Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

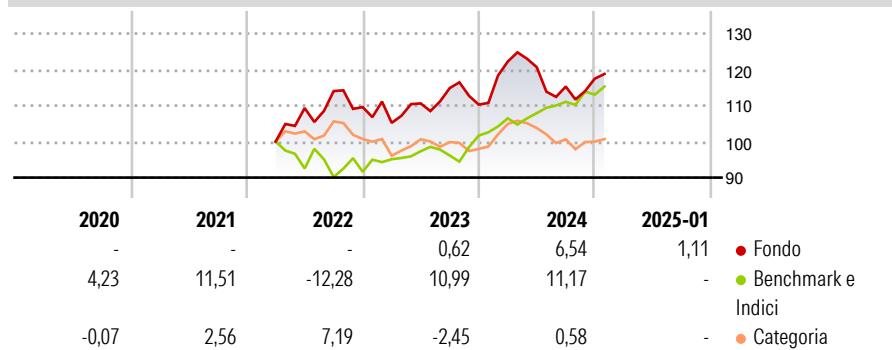
N/A

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 | - |
|--|-------------------|-----------------|---|
| | 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)

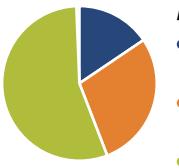
Rend. Cumulati %

| | 3-Mesi | 6-Mesi | 1-Anno |
|--|--------|--------|--------|
| | 6,34 | 1,43 | 3,01 |
| | 4,33 | 5,65 | 7,02 |
| | 7,24 | 5,88 | 4,61 |
| | - | 8,68 | 3,93 |
| | - | 4,97 | 2,43 |
| | - | 6,10 | 0,93 |

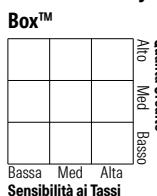
Rendimenti aggiornati al 31/01/2025

Fondo
Bmk
Cat
Rendimenti Trimestrali %

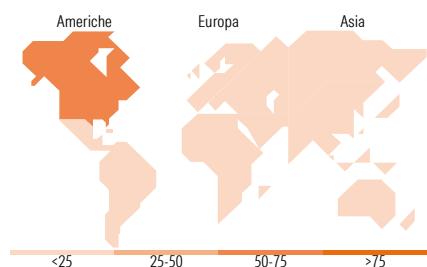
| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2026 | - | - | - | - |
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | 10,82 | -1,26 | -4,45 | 1,90 |
| 2023 | -3,99 | 5,12 | 3,84 | -3,99 |
| 2022 | - | 9,30 | 4,32 | -3,90 |

Portafoglio 30/06/2025


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

Fixed Income Style Box™


Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo


| | 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 |

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 Complessivo di Titoli Azionari | | 1.821 |
| Numeri 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 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|----------------------------|---|--------------|------------------------------|----------------|
| Società di Gestione | AQR Capital Management LLC | Patrimonio Classe (Mln) (31/01/2025) | 7,40 EUR | Investimento Min. Ingresso | 80.000.000 EUR |
| Telefono | 1 (203) 742-3600 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | http://www.aqr.com/ | Valuta del Fondo | EUR | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 22/07/2015 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,64% |
| Nome del Gestore | - | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | 10,00% |
| Data Inizio Gestione | 01/10/2014 | ISIN | LU1103258437 | | |
| NAV (31/01/2025) | EUR 120,53 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 806,32 USD | | | | |
| (30/06/2025) | | | | | |