

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund F 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 | 0,77 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 11,64 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

Rendimenti



Rend. Cumulati %

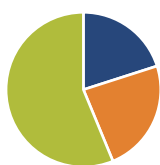
| Periodo | Fondo |
|----------------|-------|
| 3-Mesi | 7,97 |
| 6-Mesi | 10,23 |
| 1-Anno | 10,67 |
| 3-Anni Ann.ti | 11,49 |
| 5-Anni Ann.ti | 7,28 |
| 10-Anni Ann.ti | 0,93 |

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

| Periodo | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---------|-------|-------|-------|-------|
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | 12,71 | -0,07 | -2,37 | 2,97 |
| 2023 | -2,63 | 7,97 | 3,18 | -3,48 |
| 2022 | 15,79 | 7,72 | 2,78 | -4,33 |
| 2021 | 9,35 | -2,41 | -3,15 | -0,49 |

Portafoglio 30/06/2024



Asset Allocation %

| Categoria | Netta |
|--------------|--------|
| Azioni | -161,0 |
| Obbligazioni | -190,2 |
| Liquidità | 451,36 |
| Altro | -0,07 |

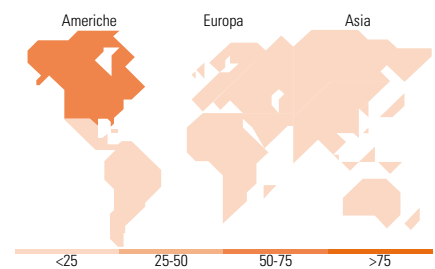
Fixed Income

Style Box™

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

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Star Compass PLC | - | 7,70 |
| Star Helios Plc | - | 7,70 |
| UBS (Irl) Sel Money Mkt USD... | - | 7,09 |
| Wolf Us Equity Citi Usd (Cfd) | - | 0,04 |
| Fnd Us Equity Citi Usd (Cfd) | - | 0,03 |
| Anet Us Equity Citi Usd (Cfd) | - | 0,03 |
| Alb Us Equity Citi Usd (Cfd) | - | 0,02 |
| 8725 Jp Equity Citi Jpy (Cfd) | - | 0,02 |
| Lly Us Equity Citi Usd (Cfd) | - | 0,02 |
| Alny Us Equity Citi Usd (Cfd) | - | 0,02 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 22,67 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 1.869 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 233 |

Fixed Income Sector Weightings %

| Settore | Fondo |
|--------------------------|--------|
| Governativo | -76,93 |
| Societario | 5,90 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 173,17 |
| Derivati | -2,15 |

Coupon Range %

| Intervallo | 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 | 68,96 |
| Stati Uniti | 66,70 |
| Canada | 2,02 |
| America Latina e Centrale | 0,25 |
| Europa | 15,61 |
| Regno Unito | 2,70 |
| Europa Occidentale - Euro | 8,13 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 4,77 |
| Europa dell'Est | 0,00 |
| Africa | 0,00 |
| Medio Oriente | 0,00 |
| Asia | 15,43 |
| Giappone | 13,03 |
| Australasia | 1,64 |
| Asia - Paesi Sviluppati | 0,72 |
| Asia - Emergente | 0,04 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|----------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|----------------|
| Società di Gestione | AQR Capital Management LLC | Patrimonio Classe (Mln) | 258,18 GBP | Investimento Min. Ingresso | 70.000.000 GBP |
| Telefono | 1 (203) 742-3600 | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | 100.000 GBP |
| Web | http://www.aqr.com/ | Valuta del Fondo | GBP | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 01/10/2014 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,59% |
| Nome del Gestore | - | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | 10,00% |
| Data Inizio Gestione | 01/10/2014 | ISIN | LU1103258510 | | |
| NAV (04/02/2025) | GBP 132,42 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 511,04 USD | | | | |

(30/06/2024)