AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund F GBP

Categoria Morningstar™

Benchmark Morningstar

Benchmark Dichiarato N/A

Morningstar Rating™

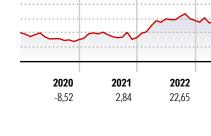
Category_EUCA001013

Not Categorized Usato nel Report

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						
						154
				\sim		136
		~~~~	$\sim$			118
	~~~					100
						00
						82
						8 2 - 64
2020	2021	2022	2023	2024	2025-11	

Misure di Rischio			
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,44
3Y Beta	-	3Y Std Dev	10,4
3Y R-Squared	-	3Y Risk	
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	

Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	6,12	Trimestrali %				
6-Mesi	4,05	2025	5,33	-4,41	4,72	-
1-Anno	8,94	2024	12,71	-0,07	-2,37	2,97
3-Anni Ann.ti	8,22	2023	-2,63	7,97	3,18	-3,48
5-Anni Ann.ti	10,50	2022	15,79	7,72	2,78	-4,33
10-Anni Ann.ti	1,62	2021	9,35	-2,41	-3,15	-0,49
Randimenti aggiornati al 05/12/2025						

Portafoglio 30/06/2025





Fixed Income Sector Weightings %

Fondo Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media

Americhe	Eu	ropa	Asia
	3		
<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
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1.821
Numero Complessivo di Titoli Obbligazi	onari	527

₩ 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
	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
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	01/10/2014
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014
NAV (05/12/2025)	GBP 147,21
Patrimonio Netto (MIn)	806,32 USD
(30/06/2025)	

Patrimonio Classe (MIn) (05/12/2025)	309,83 GBP
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	GBP
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1103258510

Investimento Min. Ingresso	70.000.000 GBP
Investimento Min. Successivo	100.000 GBP
T.E.R.	0,87%
Spese correnti	0,54%
Commissione di incentivo	10,00%