

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund I GBP

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001013

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

N/A

Morningstar Rating™

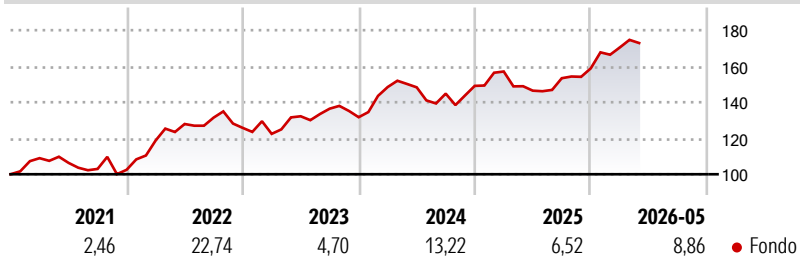
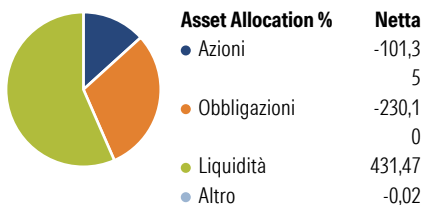
Senza rating

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	0,67
3Y Beta	-	3Y Std Dev	9,97
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rendimenti

Portafoglio 31/12/2025

Rend. Cumulati %

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	-1,20
6-Mesi	7,41
1-Anno	14,98
3-Anni Ann.ti	9,21
5-Anni Ann.ti	9,53
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 26/06/2026

Rendimenti

Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2026	7,30	-	-	-
2025	5,35	-6,77	4,72	3,57
2024	12,73	-0,10	-2,37	2,97
2023	-2,64	7,97	3,19	-3,48
2022	15,85	7,73	2,79	-4,33

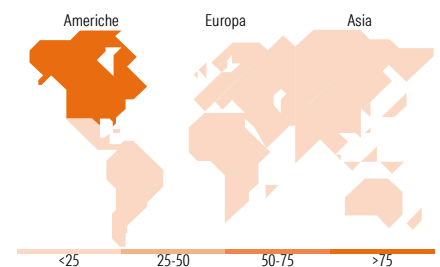
Titoli principali

Nome	Settore	%
Star Compass PLC	—	7,88
Star Helios Plc	—	7,88
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...	—	7,46
United States Treasury Bills	—	2,16
United States Treasury Bills	—	1,04
United States Treasury Bills	—	1,03
United States Treasury Bills	—	1,03
United States Treasury Bills	—	0,88
United States Treasury Bills	—	0,85
United States Treasury Bills	—	0,57
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		30,78
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1.686
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		568

Fixed Income Style
Box™

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi	
Alto	Medio	Basso	Alto

Fondo
 Duration Effettiva -
 Maturità effettiva -
 Qualità Credito Media

Fondo

Fixed Income Sector Weightings %

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
🏛️ Governativo	-117,61
⚙️ Societario	7,82
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏢 Enti Locali	0,00
📄 Liquidità ed equivalenti	214,05
📄 Derivati	-4,26

Coupon Range %

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 %

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	77,84
Stati Uniti	75,35
Canada	1,32
America Latina e Centrale	1,17
Europa	9,16
Regno Unito	1,53
Europa Occidentale - Euro	5,25
Europa Occidentale - Non Euro	2,38
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	13,01
Giappone	11,90
Australasia	0,65
Asia - Paesi Sviluppati	0,26
Asia - Emergente	0,20

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	0,60 GBP	Investimento Min. Ingresso	66.000.000 GBP
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	GBP	T.E.R.	0,85%
Data di Partenza	28/02/2020	UCITS	Si	Spese correnti	0,53%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1278923856		
NAV (26/06/2026)	GBP 162,17				
Patrimonio Netto (Mln)	1.037,37 USD				

(31/12/2025)

[See disclosures for more details](#)

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotte; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.