## **AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund I GBP**

Categoria Morningstar™

Benchmark Morningstar

**Benchmark Dichiarato** 

N/A

Morningstar Rating™

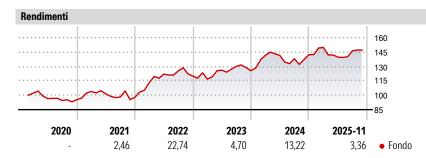
Category\_EUCA001013

Not Categorized

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	0,35
3Y Beta	-	3Y Std Dev	10,79
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	6,11	Trimestrali %				
6-Mesi	4,04	2025	5,35	-6,77	4,72	-
1-Anno	6,27	2024	12,73	-0,10	-2,37	2,97
3-Anni Ann.ti	7,32	2023	-2,64	7,97	3,19	-3,48
5-Anni Ann.ti	9,84	2022	15,85	7,73	2,79	-4,33
10-Anni Ann.ti	-	2021	8,92	-2,40	-3,16	-0,48
Randimenti aggiornati al 05/12/2025						

Fondo

## Portafoglio 30/06/2025

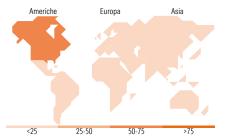




Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome	Settore	%
Star Compass PLC	_	7,97
Star Helios Plc	_	7,97
UBS (IrI) 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	ionari	527

<b>₩</b> Governativo	-110,98
Societario     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
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	28/02/2020
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014
NAV (05/12/2025)	GBP 151,14
Patrimonio Netto (MIn)	806,32 USD
(30/06/2025)	

Patrimonio Classe (Mln) (05/12/2025)	0,51 GBP
Domicilio Valuta del Fondo	LUSSEMBURGO GBP
UCITS Inc/Acc ISIN	Si Inc LU1278923856

Investimento Min. Ingresso	66.000.000 GBP
Investimento Min. Successivo	=
T.E.R.	0,85%
Spese correnti	0,54%
Commissione di incentivo	10,00%