

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.

Rendimenti

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,77
3Y Beta	-	3Y Std Dev	11,65
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

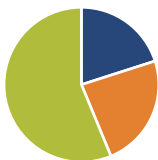
Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	7,96
6-Mesi	10,24
1-Anno	10,66
3-Anni Ann.ti	11,50
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

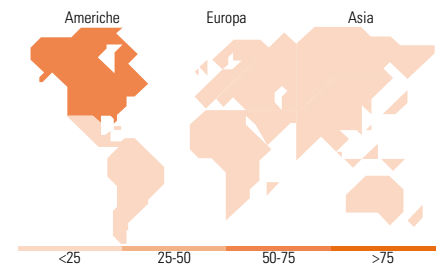
Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	12,73	-0,10	-2,37	2,97
2023	-2,64	7,97	3,19	-3,48
2022	15,85	7,73	2,79	-4,33
2021	8,92	-2,40	-3,16	-0,48

Portafoglio 30/06/2024

Asset Allocation %

Azioni	Netta	-161,0
Obbligazioni		1
Liquidità		-190,2
Altro		9
		451,36
		-0,07

Fixed Income
Style Box™


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 %	
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)	0,33 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.	-
Data di Partenza	28/02/2020	UCITS	Si	Spese correnti	0,59%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1278923856		
NAV (04/02/2025)	GBP 139,37				
Patrimonio Netto (Mln)	511,04 USD				

(30/06/2024)