

# AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund J EUR

## Categoria Morningstar™

Alt - Systematic Futures

## Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR  
Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

N/A

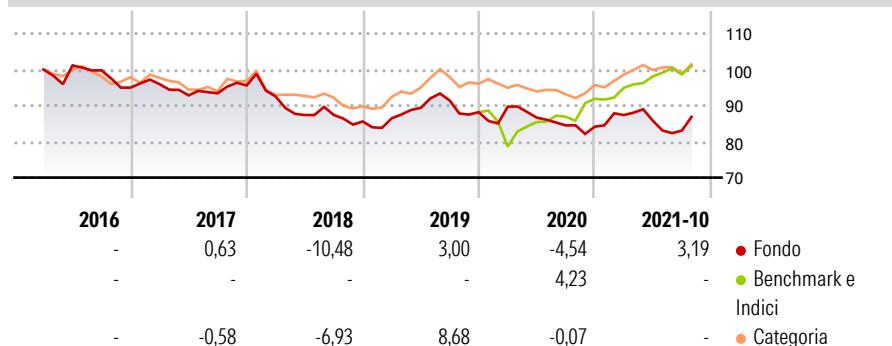
## Morningstar Rating™

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	4,09	3Y Sharpe Ratio	0,13
3Y Beta	-0,33	3Y Std Dev	7,78
3Y R-Squared	12,57	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-0,65	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	13,36	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

### Rend. Cumulati %

3-Mesi	-0,58
6-Mesi	-6,93
1-Anno	0,83
3-Anni Ann.ti	-1,22
5-Anni Ann.ti	-3,15
10-Anni Ann.ti	-

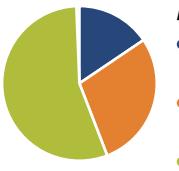
Fondo	Bmk	Cat
3,01	1,43	3,01
7,02	5,65	7,02
4,61	5,88	4,61
3,93	8,68	3,93
2,43	4,97	2,43
-	-	2022

### Rendimenti Trimestrali %

Q1	Q2	Q3	Q4
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

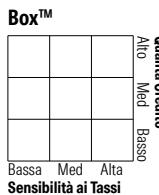
Rendimenti aggiornati al 09/11/2021

### Portafoglio 30/06/2025



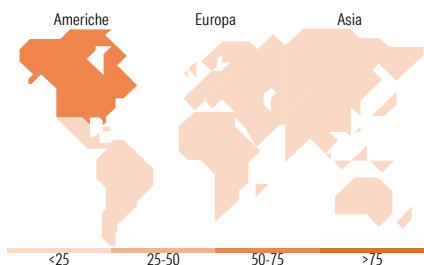
Asset Allocation %	Netta
• Azioni	-148,9
• Obbligazioni	-273,9
• Liquidità	528,99
• Altro	-6,07

### Fixed Income Style



Duration Effettiva  
Maturity effettiva  
Qualità Credito Media

### Fondo



### 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
Numeri Complessivo di Titoli Azionari		1.821
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari		527

### Fixed Income Sector Weightings %

Fondo	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	
Oltre 12 cedole	0,00	

### Ripartizione Geografica %

Fondo	America	62,97
• Stati Uniti		60,45
• Canada		1,23
• America Latina e Centrale		1,29
Fondo	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
Fondo	Asia	23,10
• Giappone		19,64
• Australasia		2,39
• Asia - Paesi Sviluppati		0,48
• Asia - Emergenti		0,58

### Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln) (09/11/2021)	0,04 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	16/03/2016	UCITS	Si	Spese correnti	0,79%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1322538544		
NAV (09/11/2021)	EUR 82,41				
Patrimonio Netto (Mln)	806,32 USD				
(30/06/2025)					