

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund RAUFT USD

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Category_EUCA001012	Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD Usato nel Report	N/A	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	-
3Y Beta	- 3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	- 3Y Risk	-
3Y Info Ratio	- 5Y Risk	-
3Y Tracking Error	- 10Y Risk	-

Basati su Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rendimenti						
	2021	2022	2023	2024	2025	2026-08
	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-

100

● Fondo
● Benchmark e Indici
● Categoria

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %								
3-Mesi	-	-	-	2026	-	-	-	-
6-Mesi	-	-	-	2025	-	-	-	-
1-Anno	-	-	-	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	-	-	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 30/09/2026

Portafoglio 31/12/2025

Asset Allocation %	Netta
● Azioni	-101,3
● Obbligazioni	5
● Liquidità	-230,1
● Altro	0
	431,47
	-0,02

Fixed Income Style Box™

Qualità Credito

Alto Med Basso

Bassa Med Alta

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo

Americhe Europa Asia

<25 25-50 50-75 >75

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 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 %	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	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)	1,15 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	(30/09/2026)	
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO
Data di Partenza	13/08/2026	Valuta del Fondo	USD
Nome del Gestore	-	UCITS	Si
Data Inizio Gestione	01/10/2014	Inc/Acc	Acc
NAV (30/09/2026)	USD 106,44	ISIN	LU1662500054
Patrimonio Netto (Mln)	1.037,37 USD		

(31/12/2025)

Investimento Min. Ingresso	100.000 USD
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	1,79%
Commissione di incentivo	-