

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund RAU USD

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001012

Benchmark Morningstar

Morningstar US Moderate Target
Allocation NR USD
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

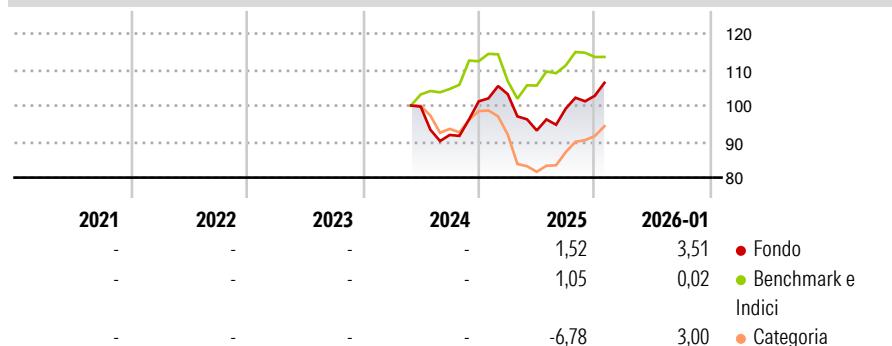
Morningstar Rating™

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	-
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)

Rend. Cumulati %

3-Mesi	13,87	1,36
6-Mesi	-	-
1-Anno	-	-
3-Anni Ann.ti	-	-
5-Anni Ann.ti	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-

Fondo	Bmk	Cat
3,51	0,02	-
1,05	-	-
-6,78	3,00	-

Rendimenti aggiornati al 12/02/2026

Rendimenti Trimestrali %

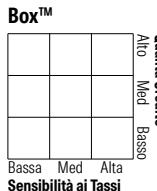
Q1	Q2	Q3	Q4
-	-	-	-
1,97	-9,78	6,53	3,58
-	-7,89	10,18	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

Portafoglio 30/06/2025

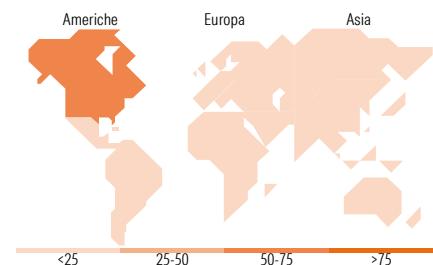


Asset Allocation %	Netta
• Azioni	-148,9
• Obbligazioni	-273,9
• Liquidità	528,99
• Altro	-6,07

Fixed Income Style Box™



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
• America	62,97
• Europa	13,93
• Asia	23,10
Stati Uniti	60,45
Canada	1,23
America Latina e Centrale	1,29
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
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) (12/02/2026)	0,49 USD	Investimento Min. Ingresso	10.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	1,16%
Data di Partenza	28/05/2024	UCITS	Si	Spese correnti	1,34%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1662502001		
NAV (12/02/2026)	USD 117,45				
Patrimonio Netto (Mln)	806,32 USD				
(30/06/2025)					