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

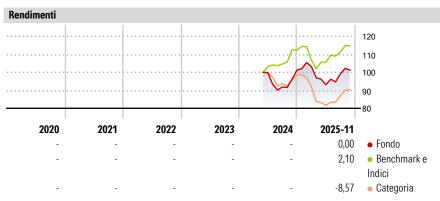
Morningstar Rating™

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.

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 Moderat	e Tar	get Allocation NR USD (dove applicabile)



					•		U	
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	7,38	4,64	5,80	Trimestrali %				
6-Mesi	5,85	8,76	5,37	2025	1,97	-9,78	6,53	-
1-Anno	3,99	1,18	-4,36	2024	-	-	-7,89	10,18
3-Anni Ann.ti	-	-	-	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	-	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 05/12/2025								

Portafoglio 30/06/2025





Fondo **Duration Effettiva** Maturity effettiva Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome Setto	re	%
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
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1.821
Numero 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		
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		

				Asia Emergente
Anagrafica				
Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (MIn) (05/12/2025)	0,28 USD	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti
Data di Partenza	28/05/2024	UCITS	Si	Commissione di incentivo
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1662502001	
NAV (05/12/2025)	USD 109,25			
Patrimonio Netto (MIn)	806,32 USD			

10.000 USD

1,16% 1,34% 10,00%