

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund RAE EUR

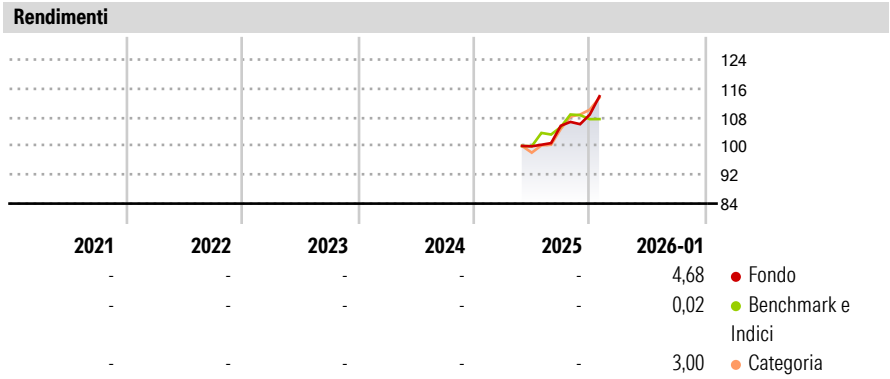
Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Category_EUCA001012	Morningstar US Moderate Target	N/A	Senza rating
	Allocation NR USD		
	Usato nel Report		

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	-

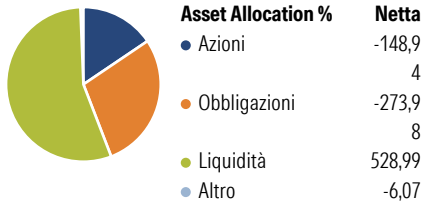
Basati su Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD (dove applicabile)



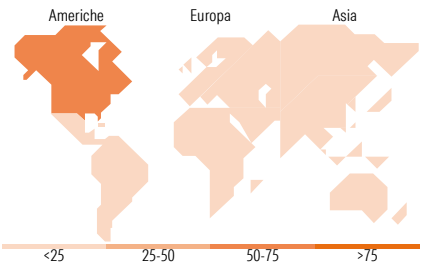
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	5,54	-1,08	2,89	2026	-	-	-	-
6-Mesi	14,50	4,22	10,35	2025	-	-	5,71	2,94
1-Anno	-	-	-	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	-	-	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 12/02/2026

Portafoglio 30/06/2025



Fixed Income Style		Fondo
Box™		
Duration Effettiva		-
Maturità effettiva		-
Qualità Credito Media		-
Qualità Credito		
Alto		
Med		
Basso		
Sensibilità ai Tassi		
Bassa		
Med		
Alta		



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
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

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	0,33 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	1 (203) 742-3600	(12/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	2,34%
Data di Partenza	05/03/2025	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,34%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014	Inc/Acc	Acc		
NAV (12/02/2026)	EUR 115,14	ISIN	LU1662502183		
Patrimonio Netto (Mln)	806,32 USD				

(30/06/2025)