

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund RAE EUR

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001012

Benchmark Morningstar
Morningstar US Moderate Target
Allocation NR USD
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

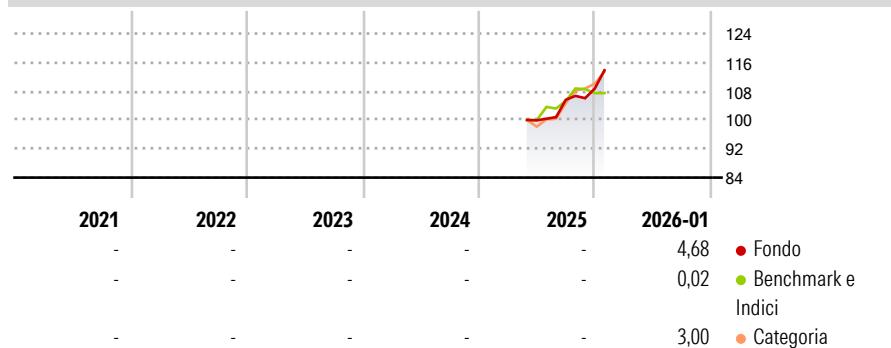
N/A

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 %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	5,54	-1,08	2,89
6-Mesi	14,50	4,22	10,35
1-Anno	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-

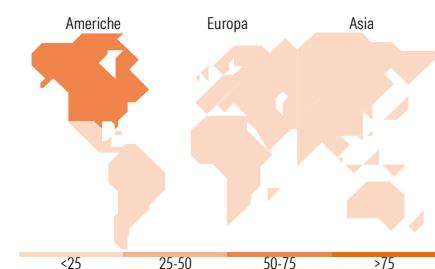
Rendimenti aggiornati al 12/02/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-	-	5,71	2,94
2024	-	-	-	-
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-

Portafoglio 30/06/2025


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

Fixed Income Style Box™	Duration Effettiva	Fondo
Altro	Maturity effettiva	-
Med	Qualità Credito Media	-
Bassa	Qualità Credito Bassa	-
Med	Sensibilità ai Tassi	-
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
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) (12/02/2026)	0,33 EUR	Investimento Min. Ingresso
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	05/03/2025	UCITS	Si	Spese correnti
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1662502183	
NAV (12/02/2026)	EUR 115,14			
Patrimonio Netto (Mln)	806,32 USD			

(30/06/2025)

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società produttori; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.