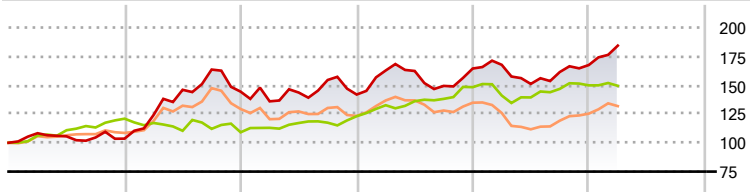
AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund IAU1F USD

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

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



	2021	2022	2023	2024	2025	2026-03
Fondo	3,61	39,32	-1,74	15,93	1,85	10,03
Benchmark e Indici	20,90	-9,77	12,80	20,50	1,05	-0,27
Categoria	8,44	21,80	-4,47	10,73	-6,78	5,33

Misure di Rischio

3Y Alpha	10,34	3Y Sharpe Ratio	0,60
3Y Beta	-0,37	3Y Std Dev	13,37
3Y R-Squared	10,40	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,06	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	14,54	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,24	-0,44	-1,32
6-Mesi	10,28	2,98	4,11
1-Anno	15,28	16,42	7,53
3-Anni Ann.ti	10,09	10,95	4,06
5-Anni Ann.ti	11,07	7,28	5,74
10-Anni Ann.ti	-	-	-

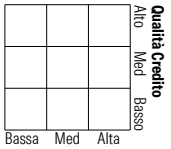
Rendimenti aggiornati al 15/04/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	10,03	-	-	-
2025	1,96	-9,89	6,81	3,78
2024	14,74	-0,28	-7,96	10,08
2023	-5,80	5,59	7,61	-8,19
2022	19,86	17,54	12,04	-11,73

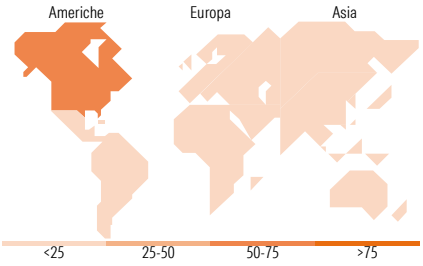
Portafoglio 30/06/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	-148,94
Obbligazioni	-273,98
Liquidità	528,99
Altro	-6,07

Fixed Income Style Box™



Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



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
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	02/11/2017
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014
NAV (15/04/2026)	USD 161,75
Patrimonio Netto (Mln) (30/06/2025)	806,32 USD
Patrimonio Classe (Mln) (15/04/2026)	19,78 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1662499372
Investimento Min. Ingresso	100.000 USD
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	1,13%
Spese correnti	1,13%
Commissione di incentivo	-

© 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 prodotto; (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.

MORNINGSTAR