

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund IAU1F USD

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001012

Benchmark Morningstar

Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

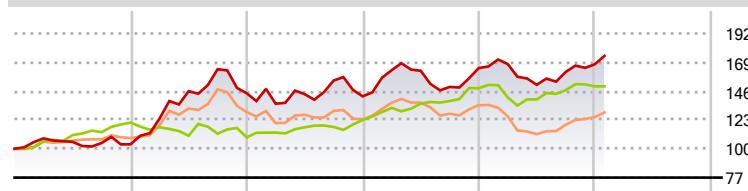
Morningstar Rating™

★★★★

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



2021 2022 2023 2024 2025 2026-01

3,61	39,32	-1,74	15,93	1,85	3,97
20,90	-9,77	12,80	20,50	1,05	0,02
8,44	21,80	-4,47	10,73	-6,78	3,00

Misure di Rischio

3Y Alpha	10,32	3Y Sharpe Ratio	0,40
3Y Beta	-0,48	3Y Std Dev	14,63
3Y R-Squared	13,50	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,13	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	15,44	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	4,01	-1,08	2,89	2026	-	-	-
6-Mesi	15,01	4,22	10,35	2025	1,96	-9,89	6,81
1-Anno	2,23	-1,04	-4,10	2024	14,74	-0,28	-7,96
3-Anni Ann.ti	7,44	9,44	0,59	2023	-5,80	5,59	7,61
5-Anni Ann.ti	11,10	7,52	6,36	2022	19,86	17,54	12,04
10-Anni Ann.ti	-	-	-		-11,73	-	-

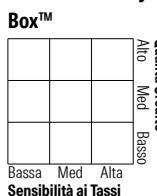
Rendimenti aggiornati al 12/02/2026

Portafoglio 30/06/2025



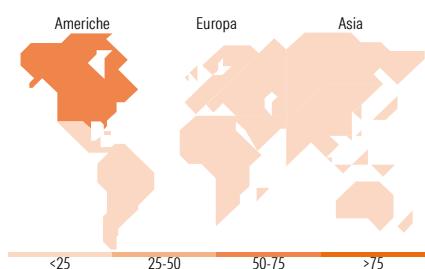
Asset Allocation %	Netta
• Azioni	-148,9
• Obbligazioni	-273,9
• Liquidità	528,99
• Altro	-6,07

Fixed Income Style Box™



Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

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 %

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
Da 0 a 4 cedole
Da 4 a 6 cedole
Da 6 a 8 cedole
Da 8 a 10 cedole
Da 10 a 12 cedole
Oltre 12 cedole

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 - Emergenti	0,58

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln) (12/02/2026)	15,90 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	1,13%
Data di Partenza	02/11/2017	UCITS	Si	Spese correnti	1,14%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1662499372		
NAV (12/02/2026)	USD 160,08				
Patrimonio Netto (Mln)	806,32 USD				
(30/06/2025)					