

# 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™**

★★★★★

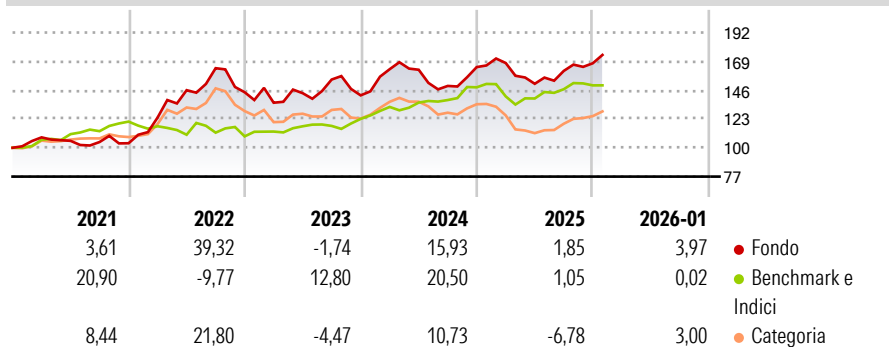
**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

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.

**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)

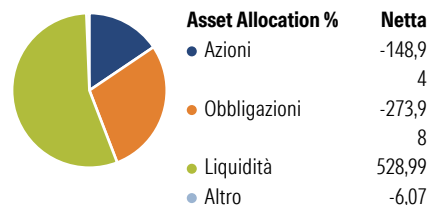
**Rendimenti**

**Rend. Cumulati %**

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	4,01	-1,08	2,89
6-Mesi	15,01	4,22	10,35
1-Anno	2,23	-1,04	-4,10
3-Anni Ann.ti	7,44	9,44	0,59
5-Anni Ann.ti	11,10	7,52	6,36
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 12/02/2026

**Rendimenti**

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2026	-	-	-	-
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**

**Fixed Income Style**
**Box™**


Qualità Credito

Sensibilità ai Tassi

Alto Med Basso

Bassa Med Alta

Duration Effettiva

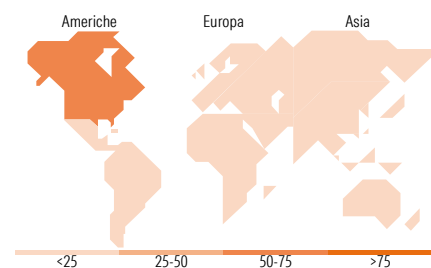
Maturità effettiva

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
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
<b>America</b>	<b>62,97</b>
Stati Uniti	60,45
Canada	1,23
America Latina e Centrale	1,29
<b>Europa</b>	<b>13,93</b>
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
<b>Asia</b>	<b>23,10</b>
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)	15,90 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	(12/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,13%
Data di Partenza	02/11/2017	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,14%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014	Inc/Acc	Acc		
NAV (12/02/2026)	USD 160,08	ISIN	LU1662499372		
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 prodotte; (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.