

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™

★★★★★

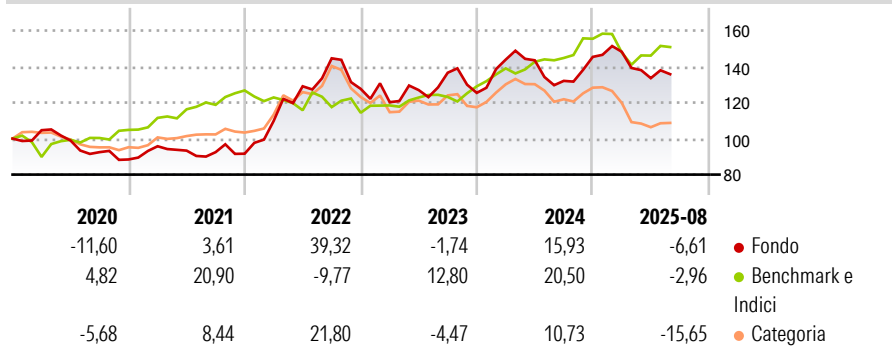
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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

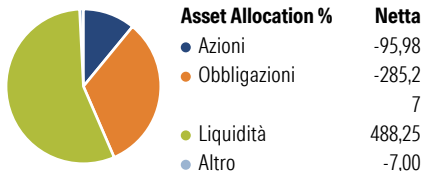
3Y Alpha	5,54	3Y Sharpe Ratio	-0,06
3Y Beta	-0,56	3Y Std Dev	16,12
3Y R-Squared	29,76	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,36	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	18,53	10Y Risk	-

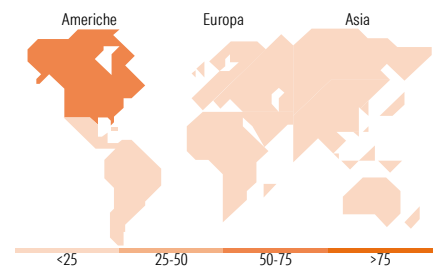
Basati su Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD (dove applicabile)

Rendimenti


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-1,56	3,28	-0,63	2025	1,96	-9,89	-	-
6-Mesi	-9,26	-2,95	-10,62	2024	14,74	-0,28	-7,96	10,08
1-Anno	5,59	6,17	-3,07	2023	-5,80	5,59	7,61	-8,19
3-Anni Ann.ti	0,48	7,18	-4,21	2022	19,86	17,54	12,04	-11,73
5-Anni Ann.ti	8,16	8,43	4,58	2021	8,31	-2,56	-0,90	-0,94
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 03/09/2025

Portafoglio 31/12/2024

Fixed Income Style
Box™

Fondo
 Duration Effettiva -
 Maturità effettiva -
 Qualità Credito Media

Titoli principali

Nome	Settore	%
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...	-	7,72
Star Compass PLC	-	7,56
Star Helios Plc	-	7,56
7267 Jp Equity Citi Jpy (Cfd)	-	0,08
Bf/B Us Equity Citi Usd (Cfd)	-	0,06
Hsy Us Equity Citi Usd (Cfd)	-	0,03
6965 Jp Equity Citi Jpy (Cfd)	-	0,03
Avgo Us Equity Citi Usd (Cfd)	-	0,03
Alb Us Equity Citi Usd (Cfd)	-	0,03
Ingersoll Rand Inc	🔧	0,02
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		23,12
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1.863
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		472

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛️ Governativo	-141,01
⚙️ Societario	7,45
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
👤 Enti Locali	0,00
💰 Liquidità ed equivalenti	241,00
📄 Derivati	-7,44

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

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	9,96 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.	-
Data di Partenza	02/11/2017	UCITS	Si	Spese correnti	1,19%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1662499372		
NAV (03/09/2025)	USD 138,31				
Patrimonio Netto (Mln)	650,17 USD				

(31/12/2024)

© 2025 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.