AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund IAC3F CHF

Categoria Morningstar™

Benchmark Morningstar

Benchmark Dichiarato

N/A

Morningstar Rating™

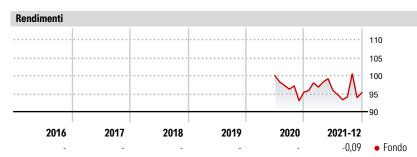
Category_EUCA001013

Not Categorized

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.



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	-

Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,38	Trimestrali %				
6-Mesi	3,11	2025	-	-	-	-
1-Anno	1,79	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	2021	1,50	-0,95	-1,87	1,28
Pandimenti aggiornati al 11/01/2022						

Portafoglio 30/06/2025





Fixed Income Sector Weightings %

Prondo

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome Settor	e	%
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	2	8,82
Numero Complessivo di Titoli Azionari	1	.821
NumeroComplessivodiTitoliObbligazionari		527

· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	
₩ Governativo	-110,98
O Societario	6,25
त 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	26/06/2020
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014
NAV (11/01/2022)	CHF 96,00
Patrimonio Netto (MIn)	806,32 USD
(30/06/2025)	

Patrimonio Classe (MIn)	0,01 USD
Domicilio Valuta del Fondo	LUSSEMBURGO CHF
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1775565648

Investimento Min. Ingresso	350.000.000 CHF
Investimento Min. Successivo	=
T.E.R.	-
Spese correnti	0,74%
Commissione di incentivo	=