

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund A USD

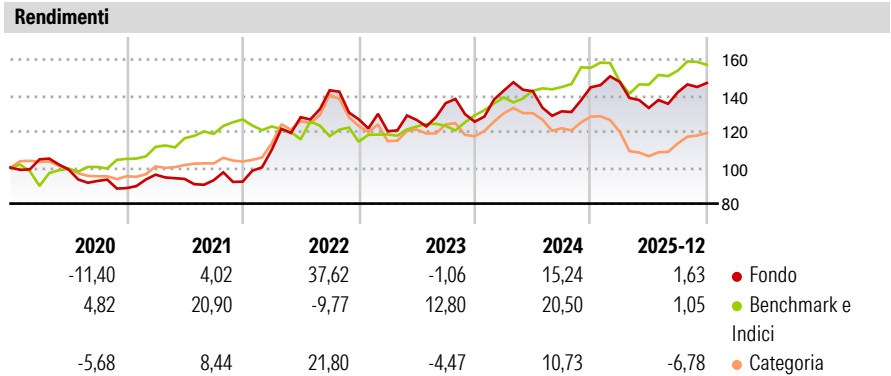
Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Category_EUCA001012	Morningstar US Moderate Target	N/A	★★★★
	Allocation NR USD		
	Usato nel Report		

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	8,06	3Y Sharpe Ratio	0,21
3Y Beta	-0,47	3Y Std Dev	14,14
3Y R-Squared	16,75	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,42	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	15,23	10Y Risk	-Med

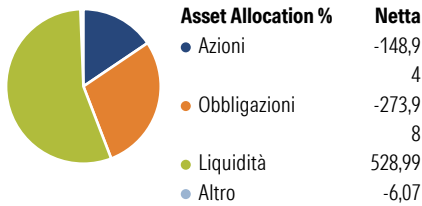
Basati su Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD (dove applicabile)



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	5,61	1,07	5,20	2026	-	-	-	-
6-Mesi	13,89	7,10	11,44	2025	2,06	-9,80	6,55	3,61
1-Anno	3,50	0,10	-2,96	2024	13,73	-0,21	-7,87	10,20
3-Anni Ann.ti	7,61	10,64	1,37	2023	-5,23	5,20	7,40	-7,59
5-Anni Ann.ti	10,92	8,19	6,70	2022	19,13	16,54	11,71	-11,26
10-Anni Ann.ti	3,24	8,58	2,19					

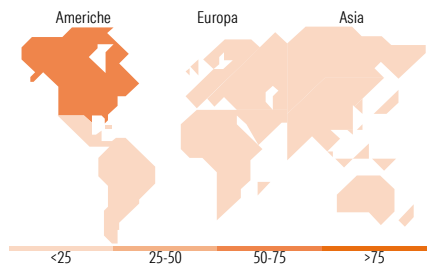
Rendimenti aggiornati al 23/01/2026

Portafoglio 30/06/2025



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

Qualità Credito: Alto, Med, Basso
Sensibilità ai Tassi: Basso, Med, Alto



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	Patrimonio Classe (Mln)	20,51 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	(23/01/2026)		Investimento Min. Successivo	100.000 USD
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,21%
Data di Partenza	05/03/2015	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	0,74%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	Inc/Acc	Acc		
NAV (23/01/2026)	USD 158,21	ISIN	LU1103257975		
Patrimonio Netto (Mln)	806,32 USD				

(30/06/2025)