AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund A USD

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001012

Benchmark Morningstar

Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD Usato nel Report Benchmark Dichiarato

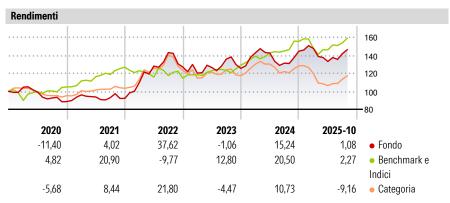
N/A

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	6,44	3Y Sharpe Ratio	-0,06
3Y Beta	-0,48	3Y Std Dev	15,07
3Y R-Squared	19,37	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,56	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	16,19	10Y Risk	-Med
Raeati eu Morningetar IIS M	nderate Tan	net Allocation NR USD (dove	annlicahile



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	7,00	4,47	5,23	Trimestrali %				
6-Mesi	5,77	8,97	4,58	2025	2,06	-9,80	6,55	-
1-Anno	4,31	0,75	-4,66	2024	13,73	-0,21	-7,87	10,20
3-Anni Ann.ti	4,05	9,43	-2,04	2023	-5,23	5,20	7,40	-7,59
5-Anni Ann.ti	10,41	8,40	6,03	2022	19,13	16,54	11,71	-11,26
10-Anni Ann.ti	2,55	7,70	1,65	2021	8,42	-2,46	-0,80	-0,84

Fondo

Portafoglio 31/12/2024





Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Duration Effettiva
Maturity 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 Azionar	i	1.863
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	472

(31/12/2024)

₩ 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

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	74,16
Stati Uniti	73,05
Canada	0,93
America Latina e Centrale	0,18
Europa	5,79
Regno Unito	1,07
Europa Occidentale - Euro	3,48
Europa Occidentale - Non Euro	1,24
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	20,05
Giappone	18,44
Australasia	1,15
Asia - Paesi Sviluppati	0,36
Asia - Emergente	0,10

				Asia - Emergente
Anagrafica				
Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (MIn) (25/11/2025)	19,03 USD	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti
Data di Partenza	05/03/2015	UCITS	Si	Commissione di incentivo
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1103257975	
NAV (25/11/2025)	USD 150,30			
Patrimonio Netto (MIn)	650,17 USD			

100.000 USD 100.000 USD

> 0,74% 10,00%