

# 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**

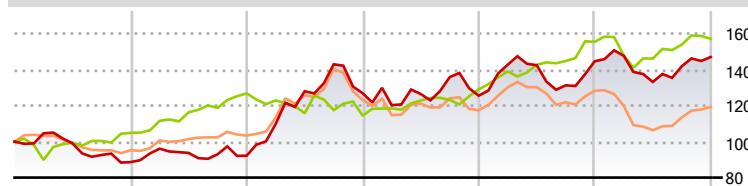
N/A

**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.

**Rendimenti**


2020 2021 2022 2023 2024 2025-12

-11,40	4,02	37,62	-1,06	15,24	1,63
4,82	20,90	-9,77	12,80	20,50	1,05
-5,68	8,44	21,80	-4,47	10,73	-6,78

● Fondo ● Benchmark e Indici ● CATEGORIA

**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)

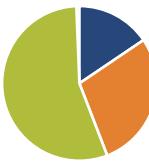
**Rend. Cumulati %**

Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	5,61	1,07
6-Mesi	13,89	7,10
1-Anno	3,50	0,10
3-Anni Ann.ti	7,61	10,64
5-Anni Ann.ti	10,92	8,19
10-Anni Ann.ti	3,24	8,58

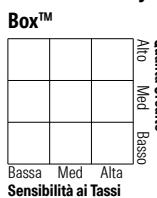
Rendimenti aggiornati al 23/01/2026

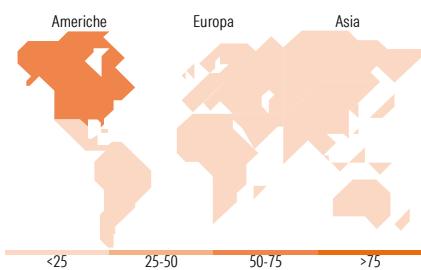
**Rendimenti Trimestrali %**

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	2,06	-9,80	6,55	3,61
2024	13,73	-0,21	-7,87	10,20
2023	-5,23	5,20	7,40	-7,59
2022	19,13	16,54	11,71	-11,26

**Portafoglio 30/06/2025**


Asset Allocation %	Netta
• Azioni	-148,9
• Obbligazioni	-273,9
• Liquidità	528,99
• Altro	-6,07

**Fixed Income Style Box™**

Duration Effettiva  
Maturity 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
Numeri Complessivo di Titoli Azionari		1.821
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari		527

**Fixed Income Sector Weightings %**

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 - Emergenti	0,58

**Anagrafica**

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

