

# AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund D CHF

**Categoria Morningstar™**

Category\_EUCA001013

**Benchmark Morningstar**
Not Categorized  
Usato nel Report
**Benchmark Dichiarato**

N/A

**Morningstar Rating™**

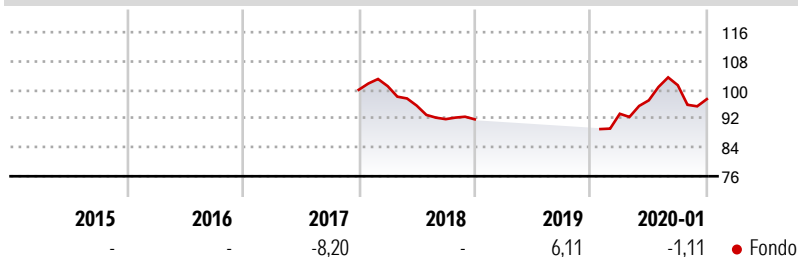
Senza rating

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

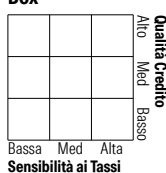
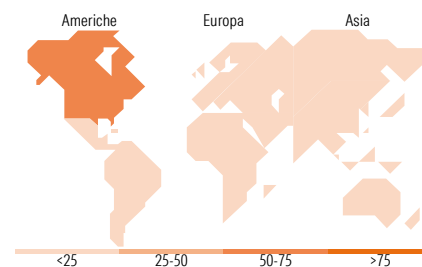
The Fund seeks to produce attractive risk-adjusted returns while maintaining low-to-zero long-term average correlation to traditional markets. The Fund is actively managed and will seek to achieve its Investment Objective by investing in a diversified portfolio of equity, currency, fixed-income instruments 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	-0,38
3Y Beta	-	3Y Std Dev	9,47
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

**Rendimenti**

**Portafoglio 30/06/2025**


<b>Asset Allocation %</b>	<b>Netta</b>
● Azioni	-148,9
● Obbligazioni	4
● Liquidità	-273,9
● Altro	8
	528,99
	-6,07

**Fixed Income Style Box™**

**Fondo**  
 Duration Effettiva -  
 Maturità effettiva -  
 Qualità Credito Media

**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
<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 - Emergente	0,58

**Anagrafica**

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	0,25 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 CHF
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	CHF	T.E.R.	-
Data di Partenza	16/02/2016	UCITS	Si	Spese correnti	0,79%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1103258353		
NAV (20/02/2020)	CHF 82,91				
Patrimonio Netto (Mln)	806,32 USD				

(30/06/2025)