

# AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund F GBP

**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	0,79
3Y Beta	-	3Y Std Dev	9,56
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

**Rendimenti**

**Portafoglio 31/12/2025**

**Asset Allocation %**

Asset Class	Netta
Azioni	-101,3
Obbligazioni	-230,1
Liquidità	431,47
Altro	-0,02

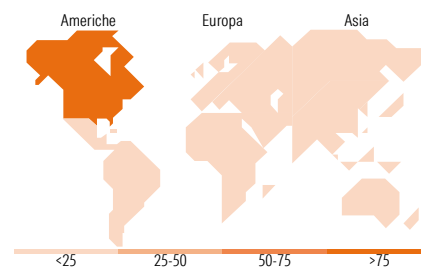
**Fixed Income Style**
**Box™**

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi
Alto	Basso	
Bassa	Med	Alta
Med	Alta	Bassa
Alta	Bassa	Med

Duration Effettiva  
Maturità effettiva  
Qualità Credito Media

**Fondo**

Duration Effettiva -  
Maturità effettiva -  
Qualità Credito Media -


**Titoli principali**

Nome	Settore	%
Star Compass PLC	-	7,88
Star Helios Plc	-	7,88
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...	-	7,46
United States Treasury Bills	-	2,16
United States Treasury Bills	-	1,04
United States Treasury Bills	-	1,03
United States Treasury Bills	-	1,03
United States Treasury Bills	-	0,88
United States Treasury Bills	-	0,85
United States Treasury Bills	-	0,57
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		30,78
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1.686
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		568

**Fixed Income Sector Weightings %**

	Fondo
Governativo	-117,61
Societario	7,82
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	214,05
Derivati	-4,26

**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>77,84</b>
Stati Uniti	75,35
Canada	1,32
America Latina e Centrale	1,17
<b>Europa</b>	<b>9,16</b>
Regno Unito	1,53
Europa Occidentale - Euro	5,25
Europa Occidentale - Non Euro	2,38
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
<b>Asia</b>	<b>13,01</b>
Giappone	11,90
Australasia	0,65
Asia - Paesi Sviluppati	0,26
Asia - Emergente	0,20

**Anagrafica**

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	459,32 GBP	Investimento Min. Ingresso	70.000.000 GBP
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	100.000 GBP
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	GBP	T.E.R.	0,87%
Data di Partenza	01/10/2014	UCITS	Si	Spese correnti	0,53%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1103258510		
NAV (24/06/2026)	GBP 160,45				
Patrimonio Netto (Mln)	1.037,37 USD				

(31/12/2025)

[See disclosures for more details](#)

© 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 prodotte; (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.