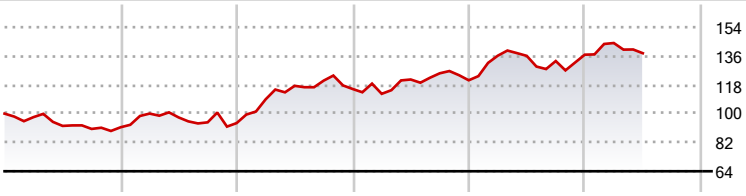
AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund F GBP

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Category_EUCA001013	Not Categorized Usato nel Report	N/A	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.

Rendimenti



2020	2021	2022	2023	2024	2025-06	
-8,52	2,84	22,65	4,70	13,23	0,69	● Fondo

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,30
3Y Beta	-	3Y Std Dev	10,89
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	-1,98
6-Mesi	0,90
1-Anno	6,64
3-Anni Ann.ti	5,63
5-Anni Ann.ti	8,26
10-Anni Ann.ti	0,41

Rendimenti aggiornati al 30/07/2025

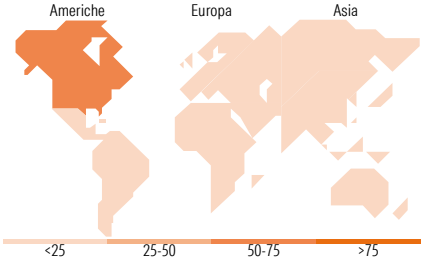
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	5,33	-4,41	-	-
2024	12,71	-0,07	-2,37	2,97
2023	-2,63	7,97	3,18	-3,48
2022	15,79	7,72	2,78	-4,33
2021	9,35	-2,41	-3,15	-0,49

Portafoglio 31/12/2024

Asset Allocation %	Netta
● Azioni	-95,98
● Obbligazioni	-285,27
● Liquidità	488,25
● Altro	-7,00

Fixed Income Style Box™

	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 Azionari		1.863
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		472

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
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

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	01/10/2014
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014
NAV (30/07/2025)	GBP 136,18
Patrimonio Netto (Mln) (31/12/2024)	650,17 USD

Patrimonio Classe (Mln) (30/07/2025)	275,24 GBP
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	GBP
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1103258510

Investimento Min. Ingresso	70.000.000 GBP
Investimento Min. Successivo	100.000 GBP
T.E.R.	-
Spese correnti	0,59%
Commissione di incentivo	10,00%

© 2025 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 prodotto; (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.