

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund I GBP

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001013

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report
Benchmark Dichiarato

N/A

Morningstar Rating™

Senza rating

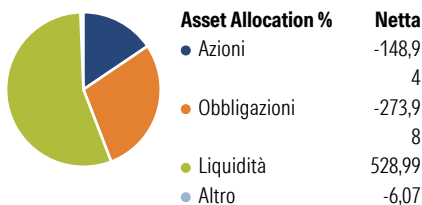
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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	0,84
3Y Beta	-	3Y Std Dev	10,23
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

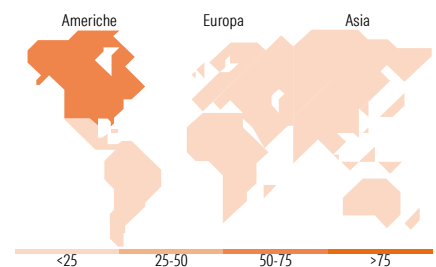
Rendimenti

Portafoglio 30/06/2025

Fixed Income Style
Box™


Duration Effettiva

Maturità 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
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
America	62,97
Stati Uniti	60,45
Canada	1,23
America Latina e Centrale	1,29
Europa	13,93
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
Asia	23,10
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)	0,55 GBP	Investimento Min. Ingresso	66.000.000 GBP
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	GBP	T.E.R.	0,85%
Data di Partenza	28/02/2020	UCITS	Si	Spese correnti	0,53%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1278923856		
NAV (10/04/2026)	GBP 165,54				
Patrimonio Netto (Mln)	806,32 USD				

(30/06/2025)