AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund J EUR

Categoria Morningstar™

Alt - Systematic Futures

Benchmark Morningstar

Benchmark Dichiarato

Morningstar Rating™

Morningstar Euro Moderate Global Target N/A

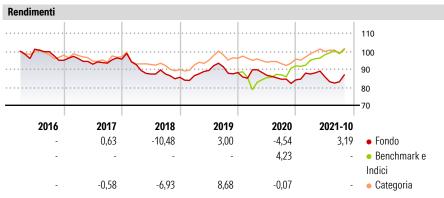
Allocation NR EUR
Usato nel Report

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 Rischie	0		
3Y Alpha	4,09	3Y Sharpe Ratio	0,13
3Y Beta	-0,33	3Y Std Dev	7,78
3Y R-Squared	12,57	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-0,65	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	13,36	10Y Risk	-
Basati su Morningstar Euro applicabile)	o Moderate	Global Target Allocation NR	EUR (dove



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-0,58	5,03	4,05	Trimestrali %				
6-Mesi	-6,93	8,23	3,18	2025	-	-	-	-
1-Anno	0,83	9,05	4,53	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-1,22	9,46	0,49	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-3,15	6,29	3,40	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	3,85	-1,79	-3,21	-
Rendimenti aggiornati al 09/11/2	2021							

Fondo

Portafoglio 31/12/2024





Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome	Settore	%
UBS (IrI) 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	i	1.863
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	472

(31/12/2024)

41,01 7,45 0,00 0.00
0,00
,
0.00
0,00
41,00
-7,44
ondo
0,00
0,00
0,00
0,00
0,00
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	Patrimonio Classe (Mln)	0,04 USD	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo	100.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,79%
Data di Partenza	16/03/2016	UCITS	Si	Commissione di incentivo	10,00%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Inc		
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1322538544		
NAV (09/11/2021)	EUR 82,41				
Patrimonio Netto (MIn)	650,17 USD				