

# AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund L USD

**Categoria Morningstar™**

Category\_EUCA001012

**Benchmark Morningstar**

Morningstar US Moderate Target

Allocation NR USD

Usato nel Report

**Benchmark Dichiarato**

N/A

**Morningstar Rating™**

Senza rating

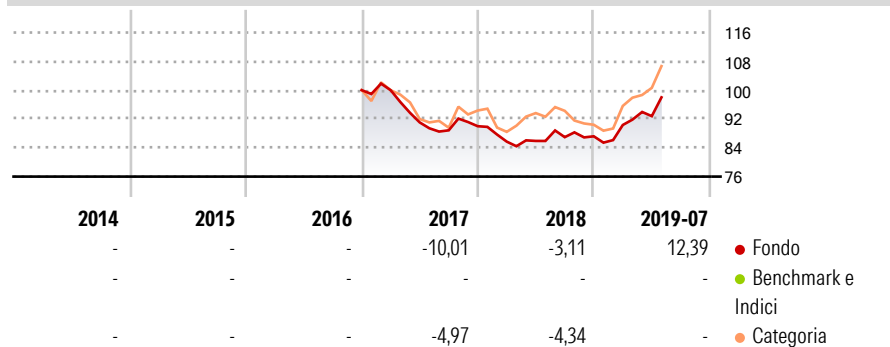
**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

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	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Basati su Morningstar US Moderate Target Allocation NR USD (dove applicabile)

**Rendimenti**


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	6,79	-1,27	0,53	2026	-	-	-	-
6-Mesi	15,26	2,50	4,17	2025	-	-	-	-
1-Anno	12,57	15,61	5,47	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	10,13	4,43	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	7,06	5,69	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 05/08/2019

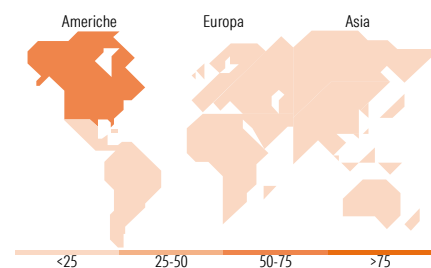
**Portafoglio 30/06/2025**


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	-148,9
● Obbligazioni	-273,9
● Liquidità	528,99
● Altro	-6,07

**Fixed Income Style**
**Box™**

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi	
Alto	Basso	Bassa	Alta

Fixed Income Style	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 %**

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 %**

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 %**

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)	0,02 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	(06/08/2019)		Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	06/07/2016	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	0,79%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	Inc/Acc	Inc		
NAV (05/08/2019)	USD 100,86	ISIN	LU1322538890		
Patrimonio Netto (Mln)	806,32 USD				

(30/06/2025)