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

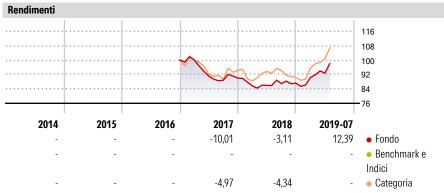
Morningstar Rating™

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 Mode	erate Tarç	et Allocation NR USD (dove ap	plicabile)



Dec. 1.0 1-1'0/	F I .	D. I	0.1	D	04			
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	6,79	2,22	4,02	Trimestrali %				
6-Mesi	15,26	7,46	6,39	2025	-	-	-	-
1-Anno	12,57	1,56	-5,81	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	10,51	-0,97	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	8,48	6,23	2022	=	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	=	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 05/08/2019	9							

Portafoglio 30/06/2025





Duration Effettiva Maturity 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
NumeroComplessivodiTitoliObbligaz	ionari	527

(30/06/2025)

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