

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund RAET EUR

Categoria Morningstar™

Alt - Systematic Futures

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Moderate Global Target N/A

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

Morningstar Rating™

★★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

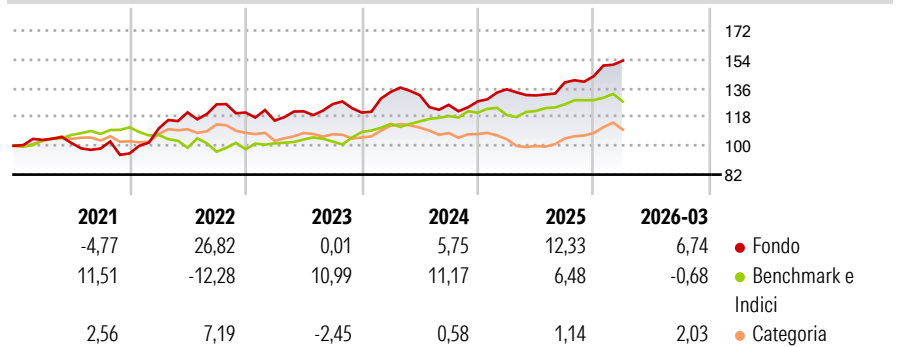
The Fund seeks to produce attractive risk-adjusted returns while maintaining low-to-zero long-term average correlation to traditional markets. The Fund is actively managed and will seek to achieve its Investment Objective by investing in a diversified portfolio of equity, currency, fixed-income instruments 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	8,28	3Y Sharpe Ratio	0,76
3Y Beta	-0,30	3Y Std Dev	8,96
3Y R-Squared	4,07	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,16	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	11,83	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rendimenti



Rend. Cumulati %

	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	5,60	-0,11	0,92
6-Mesi	10,60	3,31	1,92
1-Anno	17,99	14,48	10,71
3-Anni Ann.ti	10,12	8,61	5,52
5-Anni Ann.ti	8,25	4,55	2,01
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 10/04/2026

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	6,74	-	-	-
2025	5,90	-2,81	6,16	2,81
2024	10,64	-1,48	-4,62	1,72
2023	-4,17	5,01	3,68	-4,14
2022	16,29	9,13	4,15	-4,05

Portafoglio 30/06/2025



Asset Allocation %

● Azioni	-148,9
● Obbligazioni	-273,9
● Liquidità	528,99
● Altro	-6,07

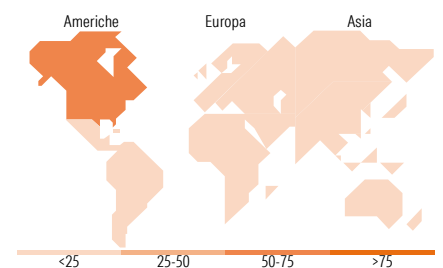
Fixed Income Style

Box™

Alto				
Med				
Basso				
	Bassa	Med	Alta	
	Sensibilità ai Tassi			

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)	0,49 EUR	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	(10/04/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,37%
Data di Partenza	06/01/2020	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,33%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	10,00%
Data Inizio Gestione	01/10/2014	Inc/Acc	Acc		
NAV (10/04/2026)	EUR 145,91	ISIN	LU1662500724		
Patrimonio Netto (Mln)	806,32 USD				

(30/06/2025)

© 2026 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 prodotte; (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.