

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund RAE EUR

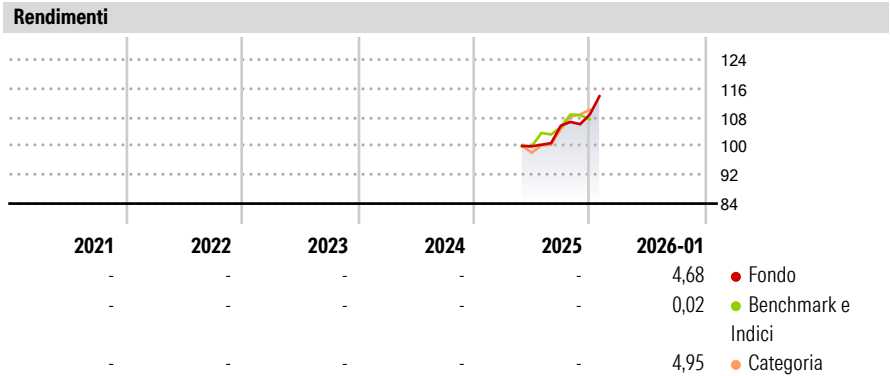
| | | | |
|-------------------------------|--------------------------------|-----------------------------|----------------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| Category_EUCA001012 | Morningstar US Moderate Target | N/A | Senza rating |
| | Allocation NR USD | | |
| | Usato nel Report | | |

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.

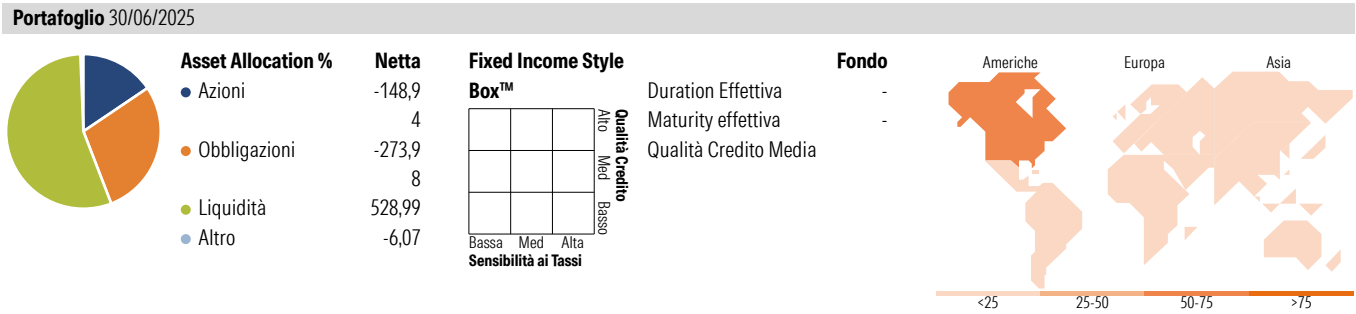
| Misure di Rischio | | |
|-------------------|-------------------|---|
| 3Y Alpha | - 3Y Sharpe Ratio | - |
| 3Y Beta | - 3Y Std Dev | - |
| 3Y R-Squared | - 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - 10Y Risk | - |

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



| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|----|----|------|------|
| 3-Mesi | 5,52 | -0,10 | 3,32 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 13,63 | 6,53 | 10,64 | 2025 | - | - | 5,71 | 2,94 |
| 1-Anno | - | - | - | 2024 | - | - | - | - |
| 3-Anni Ann.ti | - | - | - | 2023 | - | - | - | - |
| 5-Anni Ann.ti | - | - | - | 2022 | - | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026



| 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) | 0,36 EUR |
| Telefono | 1 (203) 742-3600 | (02/02/2026) | |
| Web | http://www.aqr.com/ | Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Data di Partenza | 05/03/2025 | Valuta del Fondo | EUR |
| Nome del Gestore | - | UCITS | Si |
| Data Inizio Gestione | 01/10/2014 | Inc/Acc | Acc |
| NAV (02/02/2026) | EUR 113,07 | ISIN | LU1662502183 |
| Patrimonio Netto (Mln) | 806,32 USD | | |

(30/06/2025)