

AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund IAU3F 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

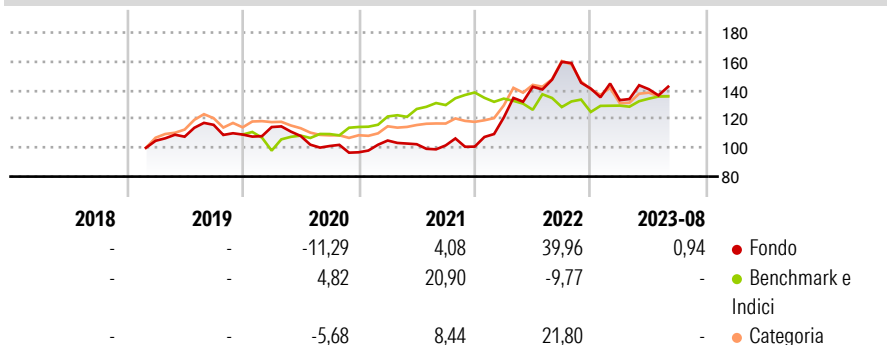
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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

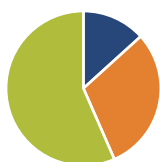
3Y Alpha	8,92	3Y Sharpe Ratio	0,76
3Y Beta	-0,55	3Y Std Dev	16,86
3Y R-Squared	26,29	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	0,23	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	21,41	10Y Risk	-

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	6,99	10,33	3,84	2026	-	-	-	-
6-Mesi	7,06	9,10	7,80	2025	-	-	-	-
1-Anno	-2,52	17,97	15,81	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	13,53	12,30	4,09	2023	-5,69	5,71	-	-
5-Anni Ann.ti	-	8,35	6,87	2022	19,99	17,67	12,16	-11,63
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 15/09/2023

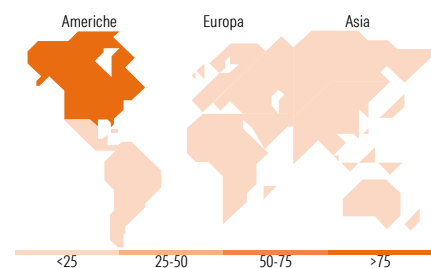
Portafoglio 31/12/2025


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	-101,3
● Obbligazioni	5
● Liquidità	-230,1
● Altro	0
	431,47
	-0,02

Fixed Income Style
Box™

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi	
Alto	Basso	Basso	Alto

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo

Titoli principali

Nome	Settore	%
Star Compass PLC	-	7,88
Star Helios Plc	-	7,88
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...	-	7,46
United States Treasury Bills	-	2,16
United States Treasury Bills	-	1,04
United States Treasury Bills	-	1,03
United States Treasury Bills	-	1,03
United States Treasury Bills	-	0,88
United States Treasury Bills	-	0,85
United States Treasury Bills	-	0,57
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		30,78
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1.686
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		568

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛️ Governativo	-117,61
⚙️ Societario	7,82
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
👥 Enti Locali	0,00
🏦 Liquidità ed equivalenti	214,05
📄 Derivati	-4,26

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	77,84
Stati Uniti	75,35
Canada	1,32
America Latina e Centrale	1,17
Europa	9,16
Regno Unito	1,53
Europa Occidentale - Euro	5,25
Europa Occidentale - Non Euro	2,38
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	13,01
Giappone	11,90
Australasia	0,65
Asia - Paesi Sviluppati	0,26
Asia - Emergente	0,20

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	5,78 USD	Investimento Min. Ingresso	350.000.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-
Data di Partenza	19/02/2019	UCITS	Si	Spese correnti	0,74%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1775565135		
NAV (15/09/2023)	USD 137,82				
Patrimonio Netto (Mln)	1.037,37 USD				

(31/12/2025)

[See disclosures for more details](#)

© 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.