AQR UCITS Funds - AQR Managed Futures UCITS Fund IAE3F EUR

Categoria Morningstar™

Alt - Systematic Futures

Benchmark Morningstar

Benchmark Dichiarato

Morningstar Rating™

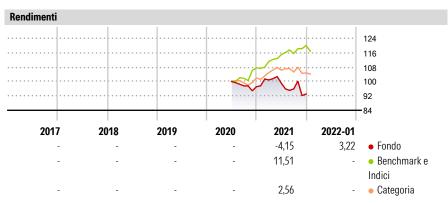
Senza rating

Morningstar Euro Moderate Global Target Allocation NR EUR 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 Euro M	oderate	Global Target Allocation NR E	JR (dove



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-3,16	1,91	1,25	Trimestrali %				
6-Mesi	-0,01	5,66	4,18	2025	-	-	-	-
1-Anno	-2,63	5,86	2,14	2024	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	8,96	1,95	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	=	5,15	2,56	2022	=	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	3,87	-1,79	-3,20	-2,93
Rendimenti aggiornati al 25/01/202	22							

Portafoglio 30/06/2025





Fixed Income Sector Weightings %

Prondo

Duration Effettiva

Maturity 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 Azior	nari	1.821
Numero Complessivo di Titoli Obbli	gazionari	527

₩ 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
D 40 40 11	0,00
Da 10 a 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)	0,01 USD	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo	280.000.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,74%
Data di Partenza	26/06/2020	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	01/10/2014	ISIN	LU1775565218		
NAV (25/01/2022)	EUR 95,81				
Patrimonio Netto (MIn)	806,32 USD				

(30/06/2025)