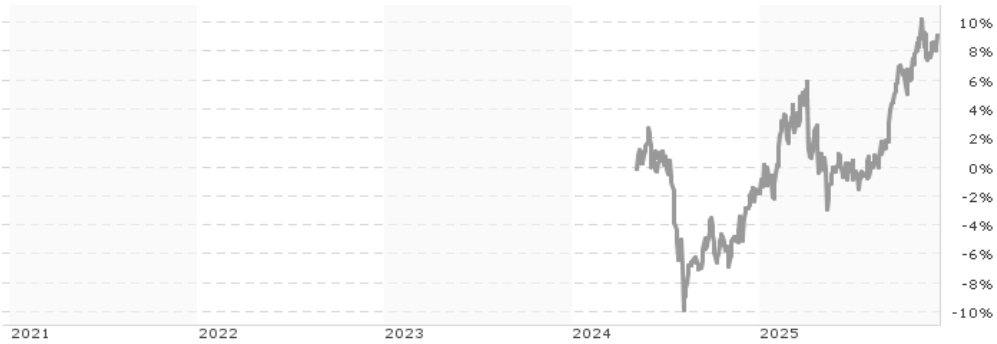
AQR Managed Futures UCITS Fund I GBP / LU1278923856 / A14YRK / FundRock M. Co.

Aktuell 12.12.2025 [1]	Region	Branche	Ausschüttungsart	Typ
151,75 GBP	weltweit	AI Managed Futures	ausschüttend	Alternative Investm.



Risikokennzahlen

SRI 1 2 **3** 4 5 6 7

Jahresperformance

Performanceergebnisse der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung zu.

Stammdaten

Fondart	Einzelfond
Kategorie	Alternative Investments
Fondsunterkategorie	AI Managed Futures
Ursprungsland	Luxemburg
Tranchenvolumen	(12.12.2025) USD 520113,016
Gesamt-Fondsvolumen	-
Auflagedatum	28.02.2020
KESt-Meldefonds	Nein
Beginn des Geschäftsjahres	01.04.
Nachhaltigkeitsfondsart	-
Fondsmanager	Clifford S. Asness John Liew
	Clifford S. Asness, John Liew, Jordan Brooks, John Huss
Thema	-

Konditionen

Ausgabeaufschlag	0,00%
Managementgebühr	0,40%
Depotgebühr	-
Tilgungsgebühr	0,00%
Sonstige lfd. Kosten (25.02.2025)	0,59%
Transaktionskosten	0,86%

Sonstige Kennzahlen

Mindestveranlagung	EUR 66.000.000,00
Sparplan	Nein
UCITS / OGAW	Ja
Gewinnbeteiligung	10,00%
Umschichtgebühr	-

Fondsgesellschaft

FundRock M. Co.
Heienhaff 5, 1736, Senningerberg
Luxemburg
https://www.fundrock.com

Performance	1M	6M	YTD	1J	2J	3J	5J	seit Beginn
Performance	-0,87%	+9,09%	+11,03%	+11,17%	-	-	-	+9,13%
Performance p.a.	-	-	-	+11,17%	-	-	-	+5,61%
Performance p.a. nach max. AGA	-	-	-	+11,17%	-	-	-	+5,57%
Sharpe Ratio	-1,37	2,21	1,03	0,99	-	-	-	0,39
Volatilität	8,87%	7,61%	9,27%	9,17%	-	-	-	9,14%
Schlechtester Monat	-	-0,41%	-3,65%	-3,65%	-5,52%	-	-	-5,52%
Bester Monat	-	+5,21%	+5,21%	+5,21%	+5,21%	-	-	+5,21%
Maximaler Verlust	-2,52%	-2,52%	-8,39%	-8,39%	-	-	-	-12,26%

Vertriebszulassung

Österreich, Deutschland, Schweiz, Luxemburg;

1. Wichtiger Hinweis zum Aktualisierungsstand: Das angegebene Datum bezieht sich ausschließlich auf die Berechnung des NAV.

RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapieres oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapieres verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft übernehmen trotz sorgfältigster Recherche keinerlei Haftung für die Richtigkeit der angegebenen Daten.
Factsheet erstellt von: www.baha.com am 15.12.2025 23:44

AQR Managed Futures UCITS Fund I GBP / LU1278923856 / A14YRK / FundRock M. Co.

Investmentstrategie

Der Fonds strebt eine Rendite an, die nach Abzug von Gebühren und Aufwendungen über einen Zeitraum von drei Jahren über Null liegt. Der Fonds investiert in eine diversifizierte Palette von Aktieninstrumenten (darunter Einzeltitel), Währungs-, Volatilitäts-, Kredit- und Festzinsinstrumenten und zulässigen, diversifizierten Kredit- und Rohstoffindizes, sowohl long als auch short (um von positiver oder negativer Wertentwicklung zu profitieren), um ein Engagement und eine Wertentwicklung zu bieten, die im Durchschnitt keine Verbindung zu traditionellen Anlageklassen aufweisen. Der Fonds ist bestrebt, von den Preisentwicklungen an den Märkten der oben genannten Anlageklassen zu profitieren. Er versucht dies durch eine eigene, computergestützte Handelsstrategie zu erreichen, die hauptsächlich kurz- und langfristige Trendsignale verwendet. Der Fonds versucht, das Risiko zu reduzieren, indem er kurz- oder langfristige Überdehnungen von Trends auf diesem Markt einschätzt.

Fondsspezifische Informationen

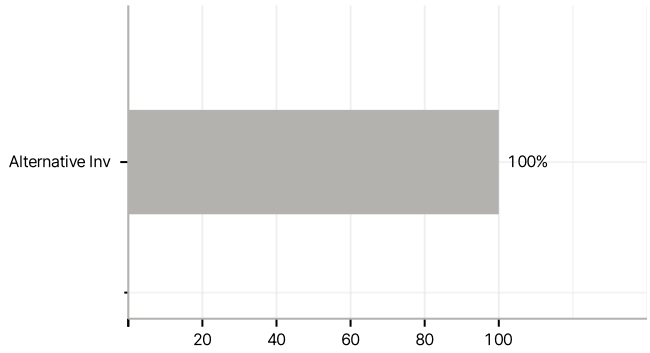
Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des AQR Managed Futures UCITS Fund I GBP wurden durch die FMA bewilligt. Der AQR Managed Futures UCITS Fund I GBP kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/ Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: by a Member State of the EU, by its local authorities, by any other Member State of the OECD such as the U.S., by certain non-Member States of the OECD (currently Brazil, Indonesia, Russia and South Africa) or by a public international body of which one or more Member State(s) of the EU are member(s) (collectively, the "Public Issuers"), provided that.

Investmentziel

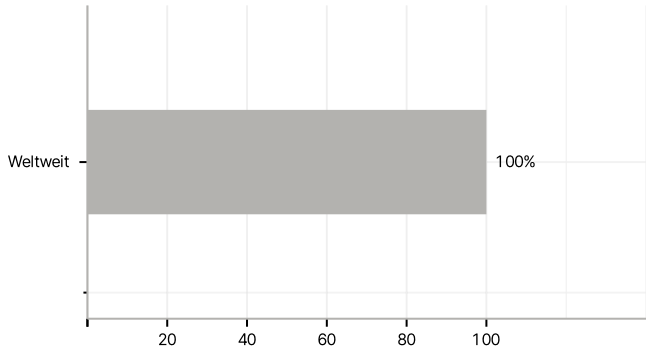
Der Fonds strebt die Erzielung von Renditen an, misst aber auch, welches Maß an Risiko hierfür in Kauf genommen wird. Langfristig beabsichtigt der Fonds, sich in einer geringen Korrelation oder ohne Korrelation zu traditionellen Märkten zu bewegen. Damit wird angestrebt, Ihnen Renditen zu bieten, die nicht von traditionellen Märkten abhängig oder beeinflusst sind.

Veranlagungsstruktur

Anlagearten



Länder



RISIKOHINWEISE: Die Informationen auf dieser Seite dienen ausschließlich zu Informationszwecken und sollten weder als Verkaufsangebot noch als Aufforderung zum Kauf des Wertpapieres oder einer Empfehlung zugunsten des Wertpapieres verstanden werden. Die baha GmbH und die BAWAG P.S.K. Bank für Arbeit und Wirtschaft und Österreichische Postsparkasse Aktiengesellschaft übernehmen trotz sorgfältigster Recherche keinerlei Haftung für die Richtigkeit der angegebenen Daten.
Factsheet erstellt von: www.baha.com am 15.12.2025 23:44