

AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund RAEF EUR Acc

Morningstar Medalist Rating™

Bronze

Morningstar Categorie Index

Morningstar EAA USD Mod
Target Allocation NR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

-

Morningstar Rating™

—

Morningstar Categorie™

Mixfondsen USD Flexibel

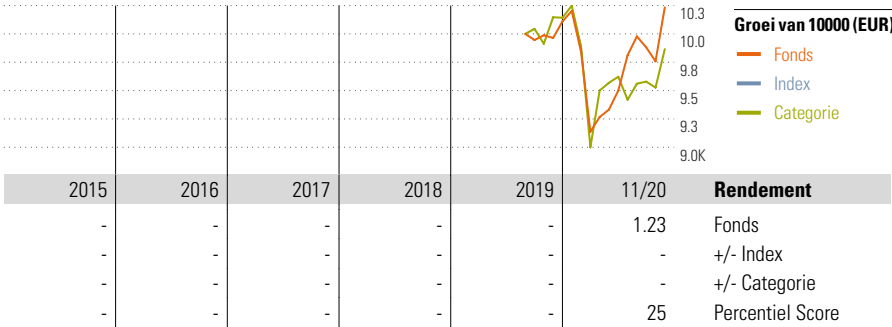
Beleggingsdoelstelling

The Fund seeks efficiently to deliver exposure to a broadly diversified set of global risk premia covering equities, government bonds and eligible, diversified commodity indices. There can be no assurance that the Fund will achieve its investment objective. The Fund is actively managed and will seek to achieve its Investment Objective through exposures to global developed and emerging stocks, developed government bonds, global inflation protected bonds and eligible, diversified commodity indices, among other exposures...

Risicomaatstaven

Alpha	-	Sharpe Ratio	-
Beta	-	Std Deviatie	-
R-kwadraat	-	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	-	5-jr Risico	-
Tracking Error	-	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar EAA USD Mod Tgt Alloc NR USD (waar van toepassing)



Rendementen (3 dec 2020)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	1.18	-0.62	-0.57
6 Maanden	8.89	0.28	1.49
1 jaar	3.26	-7.58	-3.98
3 jr gean.	-	-	-
5 jr gean.	-	-	-

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2020	-9.62	3.98	4.00	-
2019	-	-	-	1.65

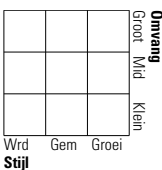
Portefeuille 30 jun 2023

Assetverdeling

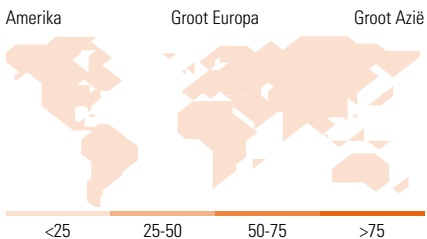
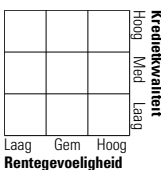
	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	25.43	-25.43
Obligaties	14.68	38.43	-23.75
Kas/ geldmarkt	187.28	38.08	149.20
Overig	0.00	0.01	-0.01

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...	—	4.94
United States Treasury Notes...	—	2.93
Germany (Federal Republic Of)...	—	2.76
United States Treasury Notes...	—	2.59
France (Republic Of)...	—	1.42
France (Republic Of)...	—	0.82
United States Treasury Notes...	—	0.79
United States Treasury Notes...	—	0.74
United States Treasury Notes...	—	0.70
United Kingdom of Great...	—	0.56
Totaal Aantal Aandelen		1
Totaal Aantal Obligaties		32
% Van Vermogen In Top 10 Posities		18.25

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	0.00
Basismaterialen	-
Cyclische consumentenproducten	-
Financiële dienstverlening	-
Vastgoed	-
Licht Cyclisch	0.00
Communicatiediensten	-
Energie	-
Industrie	-
Technologie	-
Defensief	0.00
Defensieve consumptiegoederen	-
Gezondheidszorg	-
Nutsbedrijven	-

Geen data beschikbaar

Fondsinformatie

Fondsgroep	AQR Capital Management LLC	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	-
Telefoon	1 (203) 742-3600	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	25 sep 2019	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	John Liew	ISIN	LU1662508891		
Aanvangsdatum	28 feb 2012				
Koers (3 dec 2020)	EUR 101.98				
Fondsvermogen (mln)	USD 0.25				

*To view the complete Morningstar Analyst Rating™ Research Report for this fund, please [Click here to read a detailed report on this fund.](#)

© 2024 Morningstar Benelux. Alle rechten voorbehouden. De informatie aangaande beleggingsfondsen en de fondsportefeuille in dit document weergegeven: (1) is eigendom van Morningstar en is in licentie verstrekt, (2) mag uitsluitend gebruikt worden conform de contractueel opgestelde licentievoorwaarden, (3) dient informatieve doeleinden en mag niet opgevat worden als beleggingsadvies van Morningstar, (4) is met grote zorg samengesteld maar kan desondanks onjuistheden bevatten. Morningstar aanvaardt geen enkele aansprakelijkheid voor beslissingen gebaseerd op de weergegeven informatie.