

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund A USD Acc

Morningstar Categorie Index

Morningstar US Conservative Target
Allocation NR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

-

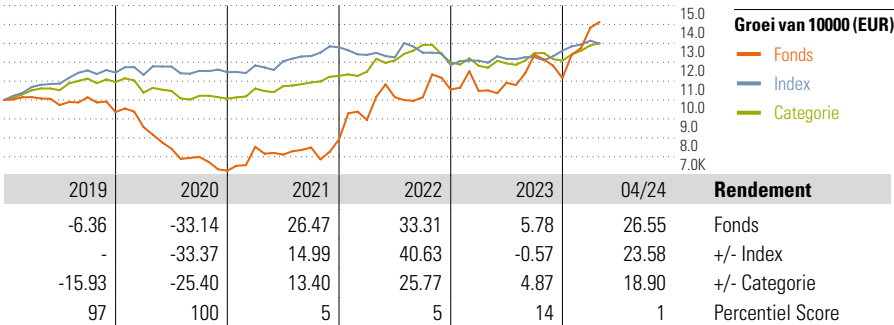
Morningstar Rating™

★★★

Morningstar Categorie™

Beleggingsdoelstelling

The Fund seeks to produce high risk-adjusted returns while maintaining low-to-zero correlation to traditional markets.



Risicomaatstaven

Alpha	16.77	Sharpe Ratio	1.10
Beta	-0.28	Std Deviatie	21.53
R-kwadraat	1.26	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	0.94	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	22.51	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar US Con Tgt Alloc NR USD (waar van toepassing)

Rendementen (2 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	11.48	10.45	8.02
6 Maanden	16.48	9.85	11.62
1 jaar	32.34	23.62	21.44
3 jr gean.	25.30	21.63	15.21
5 jr gean.	6.71	2.83	1.71

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	23.82	-	-	-
2023	-0.73	4.15	13.60	-9.94
2022	13.03	13.41	-0.04	4.04
2021	20.15	-5.45	5.28	5.74
2020	-8.50	-13.41	-5.82	-10.39

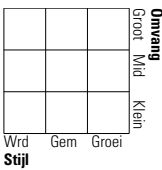
Portefeuille -

Assetverdeling

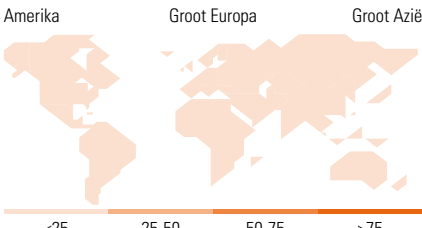
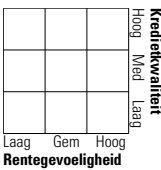
% Long % Short % Netto

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

Sector % Port

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	100,000
Telefoon	1 (203) 742-3600	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	21 jan 2015	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ronen Israel	ISIN	LU1103258601		
Aanvangsdatum	1 okt 2014				
Koers (2 mei 2024)	USD 142.66				
Fondsvermogen (mln)	USD 5.81				