

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund Class B EUR Acc

Morningstar Categorie Index

Morningstar Euro Cautious Global Target -
Allocation NR EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Morningstar Rating™

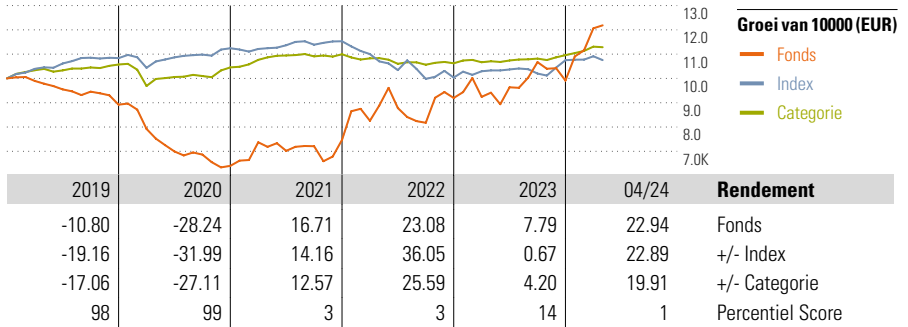
★★★★

Morningstar Categorie™

Alt - Multistrategy

Beleggingsdoelstelling

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



Risicomaatstaven

Alpha	17.67	Sharpe Ratio	0.90
Beta	-0.31	Std Deviatie	20.67
R-kwadraat	0.87	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	0.94	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	22.12	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar EU Cau Gbl Tgt Alloc NR EUR (waar van toepassing)

Rendementen (17 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	11.87	10.35	9.12
6 Maanden	16.91	11.76	11.95
1 jaar	33.13	27.57	26.67
3 jr gean.	16.73	17.65	14.18
5 jr gean.	5.00	4.15	3.08

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	21.69	-	-	-
2023	0.50	4.26	10.75	-7.11
2022	10.51	6.37	-6.93	12.50
2021	15.18	-4.80	2.72	3.62
2020	-11.20	-11.70	-1.85	-6.76

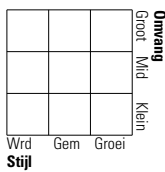
Portefeuille -

Assetverdeling

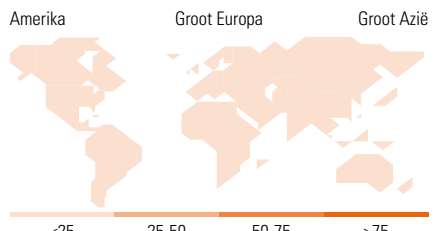
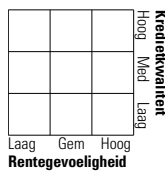
% Long % Short % Netto

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	EUR	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	15 okt 2014	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ronen Israel	ISIN	LU1103258783		
Aanvangsdatum	1 okt 2014				
Koers (17 mei 2024)	EUR 126.70				
Fondsvermogen (mln)	EUR 33.61				