

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund Class C GBP Acc

Morningstar Categorie Index

Morningstar UK Cautious Target
Allocation NR GBP

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

-

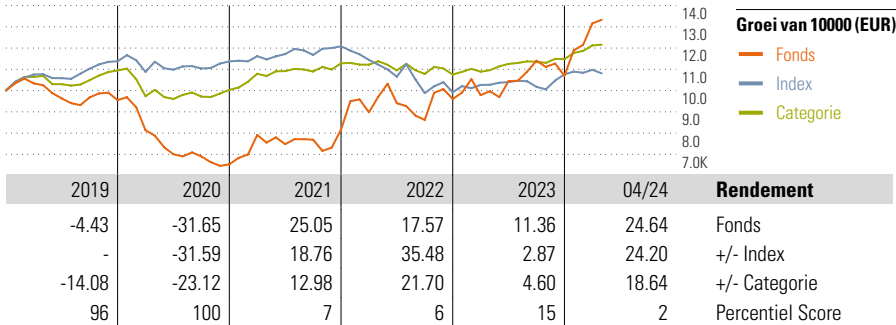
Morningstar Rating™

★★★★

Morningstar Categorie™

Beleggingsdoelstelling

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



Risicomaatstaven

Alpha	15.95	Sharpe Ratio	0.94
Beta	-0.38	Std Deviatie	21.32
R-kwadraat	1.43	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	1.05	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	21.55	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar UK Cau Tgt Alloc NR GBP (waar van toepassing)

Rendementen (29 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	13.07	12.31	9.18
6 Maanden	22.51	18.28	14.93
1 jaar	38.30	31.57	26.56
3 jr gean.	20.69	22.79	15.28
5 jr gean.	6.62	6.04	2.01

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	23.06	-	-	-
2023	1.93	6.74	9.17	-6.24
2022	9.95	4.74	-8.38	11.43
2021	21.12	-5.43	2.79	6.20
2020	-14.86	-13.92	-1.47	-5.35

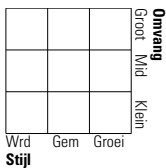
Portefeuille -

Assetverdeling

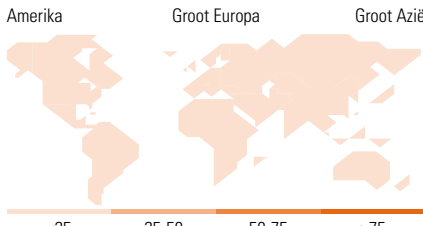
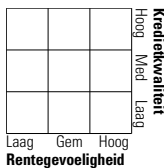
% Long % Short % Netto

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	GBP	Min Additioneel	100,000
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	5 nov 2014	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ronen Israel	ISIN	LU1103258866		
Aanvangsdatum	1 okt 2014				
Koers (29 mei 2024)	GBP 138.78				
Fondsvermogen (mln)	GBP 14.48				