

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund Class D CHF Acc

Morningstar Categorie Index

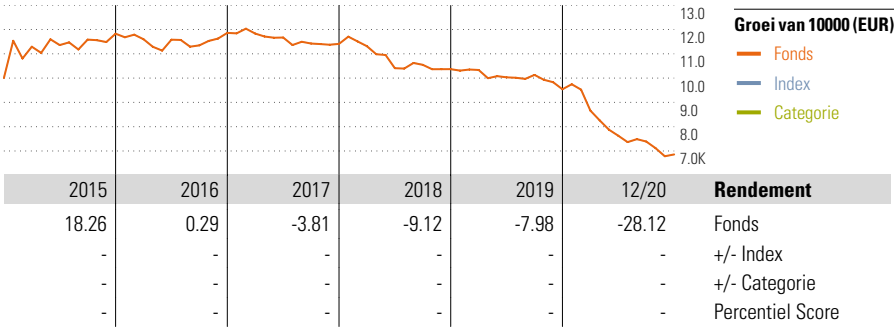
Benchmark van het fonds

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	-	Sharpe Ratio	-1.87
Beta	-	Std Deviatie	8.54
R-kwadraat	-	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	-	5-jr Risico	-
Tracking Error	-	10-jr Risico	-

Rendementen (31 dec 2020)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-7.18	-	-
6 Maanden	-10.08	-	-
1 jaar	-28.12	-	-
3 jr gean.	-15.60	-	-
5 jr gean.	-10.32	-	-

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2020	-9.21	-11.96	-3.12	-7.18
2019	-0.33	-2.93	0.99	-5.82
2018	-0.83	-8.01	1.32	-1.68
2017	-0.24	-1.37	-2.12	-0.12
2016	-1.91	-0.16	-2.01	4.51

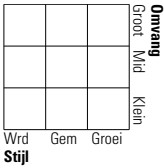
Portefeuille -

Assetverdeling

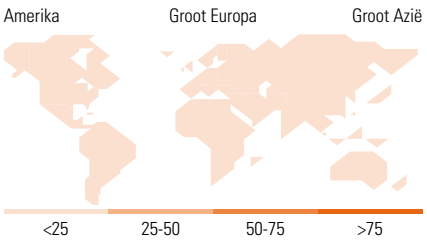
% Long % Short % Netto

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	-

Fondsinformatie

Fondsgroep	AQR Capital Management LLC	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	100,000
Telefoon	1 (203) 742-3600	Fondsvaluta	CHF	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	17 dec 2014	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ronen Israel	ISIN	LU1103258940		
Aanvangsdatum	1 okt 2014				
Koers (31 dec 2020)	CHF 64.62				
Fondsvermogen (mln)	USD 0.03				