

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund F GBP

Morningstar Categorie Index

Morningstar UK Cautious Target
Allocation NR GBP

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

-

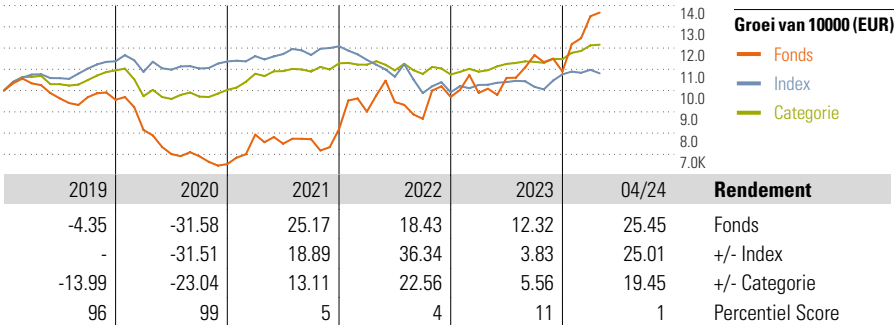
Morningstar Rating™

★★★★

Morningstar Categorie™

Beleggingsdoelstelling

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



Risicomaatstaven

Alpha	16.83	Sharpe Ratio	0.95
Beta	-0.39	Std Deviatie	22.06
R-kwadraat	1.39	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	1.06	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	22.25	10-jr Risico	-

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

Rendementen (29 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	13.03	12.28	9.14
6 Maanden	23.19	18.96	15.60
1 jaar	40.36	33.63	28.62
3 jr gean.	21.62	23.72	16.21
5 jr gean.	7.16	6.57	2.55

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	23.84	-	-	-
2023	1.95	7.12	10.16	-6.63
2022	9.97	5.03	-8.37	11.90
2021	21.14	-5.41	2.82	6.24
2020	-14.84	-13.90	-1.45	-5.31

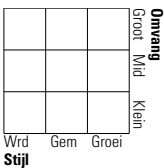
Portefeuille -

Assetverdeling

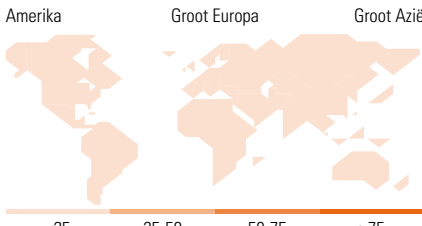
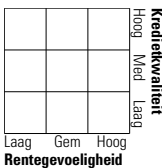
% Long % Short % Netto

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	70,000,000
Telefoon	1 (203) 742-3600	Fondsvaluta	GBP	Min Additioneel	100,000
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	1 okt 2014	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ronen Israel	ISIN	LU1103259161		
Aanvangsdatum	1 okt 2014				
Koers (29 mei 2024)	GBP 142.61				
Fondsvermogen (mln)	GBP 52.46				