

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund H

Morningstar Categorie Index

Morningstar Euro Cautious Global Target -

Allocation NR EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Morningstar Rating™

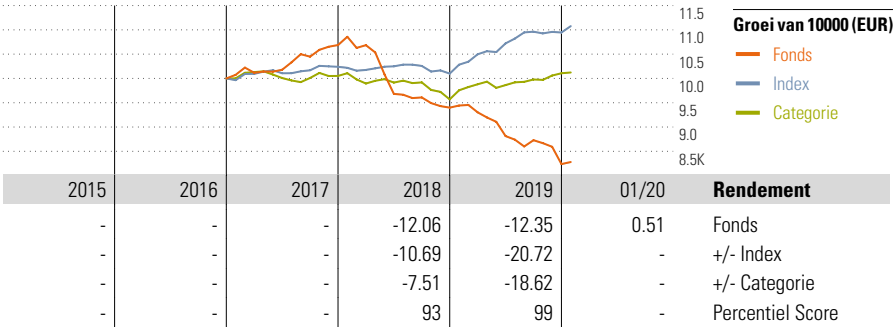
—

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	-6.01	Sharpe Ratio	-1.09
Beta	0.02	Std Deviatie	5.44
R-kwadraat	0.01	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	-1.68	5-jr Risico	-
Tracking Error	5.89	10-jr Risico	-

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

Rendementen (18 feb 2020)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-2.33	-3.85	-5.08
6 Maanden	-3.71	-8.86	-8.67
1 jaar	-11.96	-17.52	-18.42
3 jr gean.	-6.26	-5.34	-8.82
5 jr gean.	-	-	-

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2019	-1.02	-5.26	-0.96	-5.62
2018	-0.03	-9.39	-0.75	-2.19
2017	-	0.62	2.64	2.30

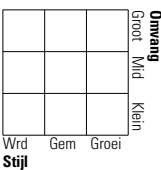
Portefeuille -

Assetverdeling

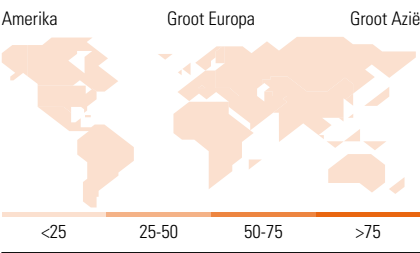
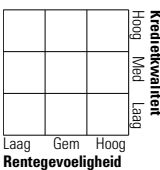
% Long % Short % Netto

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	-
Telefoon	1 (203) 742-3600	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	23 jan 2017	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Ronen Israel	ISIN	LU1278923344		
Aanvangsdatum	1 okt 2014				
Koers (18 feb 2020)	EUR 83.68				
Fondsvermogen (mln)	USD 18.02				