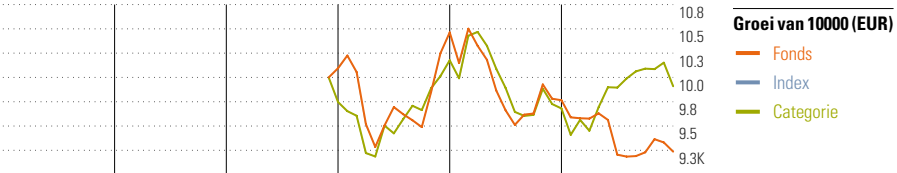
AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund I USD

Morningstar Categorie Index	Benchmark van het fonds	Morningstar Rating™	Morningstar Categorie™
Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD	-	—	

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Beleggingsdoelstelling

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



2013	2014	2015	2016	2017	12/18	Rendement
-	-	-	3.65	-6.67	-5.42	Fonds
-	-	-	-	-	-	+/- Index
-	-	-	1.45	-0.12	-7.11	+/- Categorie
-	-	-	22	86	59	Percentiel Score

Risicomaatstaven			
Alpha	-3.06	Sharpe Ratio	-0.30
Beta	0.34	Std Deviatie	7.42
R-kwadraat	3.64	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	-0.89	5-jr Risico	-
Tracking Error	5.31	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar US Con Tgt Alloc NR USD (waar van toepassing)

Rendementen (2 jan 2019)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-0.39	-1.56	-2.78
6 Maanden	1.07	-5.90	-4.71
1 jaar	-4.34	-11.84	-13.17
3 jr gean.	-2.60	-6.65	-11.91
5 jr gean.	-	-	-

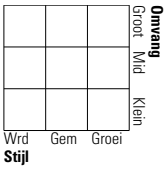
Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2018	-1.94	-3.88	0.26	0.08
2017	-1.32	-6.42	-0.35	1.42
2016	-5.71	1.85	-2.13	10.27

Portefeuille -

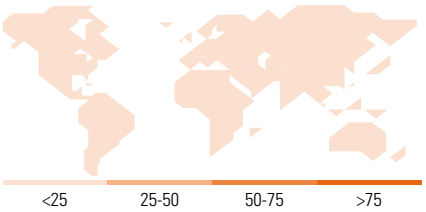
Assetverdeling % Long % Short % Netto

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Geen data beschikbaar

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	500,000,000
Telefoon	1 (203) 742-3600	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	1 dec 2015	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ronen Israel	ISIN	LU1322538973		
Aanvangsdatum	1 okt 2014				
Koers (2 jan 2019)	USD 99.84				
Fondsvermogen (mln)	USD 0.12				

© 2024 Morningstar Benelux. Alle rechten voorbehouden. De informatie aangaande beleggingsfondsen en de fondsportefeuille in dit document weergegeven: (1) is eigendom van Morningstar en is in licentie verstrekt, (2) mag uitsluitend gebruikt worden conform de contractueel opgestelde licentievoorwaarden, (3) dient informatieve doeleinden en mag niet opgevat worden als beleggingsadvies van Morningstar, (4) is met grote zorg samengesteld maar kan desondanks onjuistheden bevatten. Morningstar aanvaardt geen enkele aansprakelijkheid voor beslissingen gebaseerd op de weergegeven informatie.