

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund K GBP

Morningstar Categorie Index

Morningstar UK Cautious Target
Allocation NR GBP

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

-

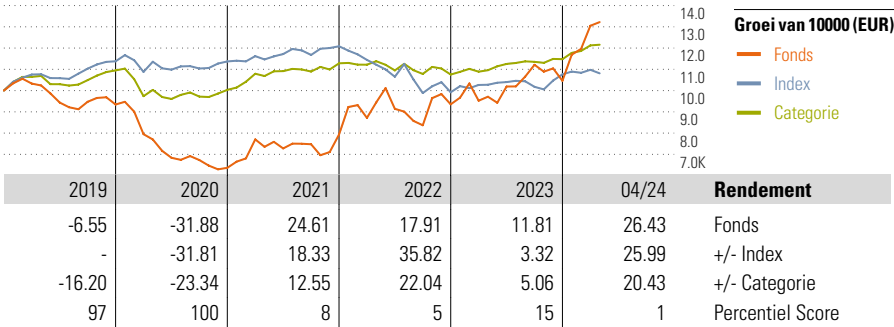
Morningstar Rating™

★★★★

Morningstar Categorie™

Beleggingsdoelstelling

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



Risicomaatstaven

Alpha	16.74	Sharpe Ratio	0.94
Beta	-0.38	Std Deviatie	22.14
R-kwadraat	1.33	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	1.05	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	22.32	10-jr Risico	-

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

Rendementen (17 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	13.33	11.89	9.97
6 Maanden	21.51	15.03	13.70
1 jaar	38.08	32.37	28.53
3 jr gean.	18.54	20.31	14.23
5 jr gean.	6.13	5.54	2.24

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	24.77	-	-	-
2023	1.83	7.00	10.03	-6.73
2022	9.86	4.90	-8.46	11.77
2021	21.01	-5.51	2.70	6.12
2020	-14.93	-13.98	-1.56	-5.43

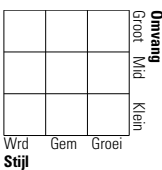
Portefeuille -

Assetverdeling

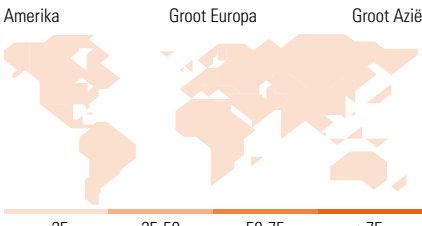
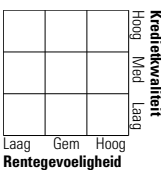
% Long % Short % Netto

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	333,000,000
Telefoon	1 (203) 742-3600	Fondsvaluta	GBP	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	1 dec 2015	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ronen Israel	ISIN	LU132539278		
Aanvangsdatum	1 okt 2014				
Koers (17 mei 2024)	GBP 123.85				
Fondsvermogen (mln)	GBP 0.01				