

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund M USD

Morningstar Categorie Index

Morningstar US Conservative Target
Allocation NR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

-

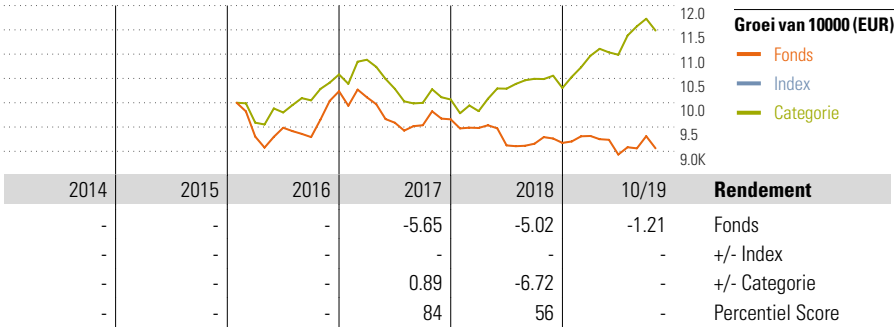
Morningstar Rating™

—

Morningstar Categorie™

Beleggingsdoelstelling

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



Risicomaatstaven

Alpha	-3.81	Sharpe Ratio	-0.22
Beta	0.20	Std Deviatie	6.43
R-kwadraat	1.58	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	-1.32	5-jr Risico	-
Tracking Error	5.36	10-jr Risico	-

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

Rendementen (20 nov 2019)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-0.60	-1.76	-2.99
6 Maanden	-3.23	-10.19	-9.01
1 jaar	-2.51	-10.00	-11.34
3 jr gean.	-3.49	-7.54	-12.80
5 jr gean.	-	-	-

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2019	1.55	-4.10	4.23	-
2018	-1.84	-3.78	0.38	0.18
2017	-1.21	-5.18	-0.53	1.27
2016	-	1.96	-2.02	10.15

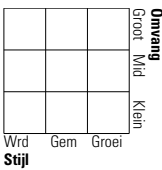
Portefeuille -

Assetverdeling

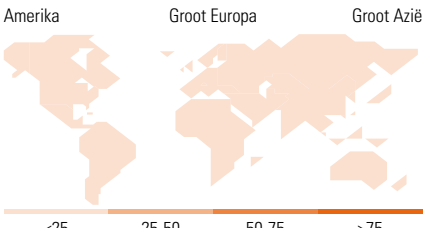
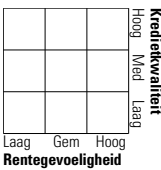
% Long % Short % Netto

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	100,000,000
Telefoon	1 (203) 742-3600	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	1 feb 2016	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ronen Israel	ISIN	LU132539351		
Aanvangsdatum	1 okt 2014				
Koers (20 nov 2019)	USD 91.08				
Fondsvermogen (mln)	USD 0.09				