

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund N CHF

Morningstar Categorie Index

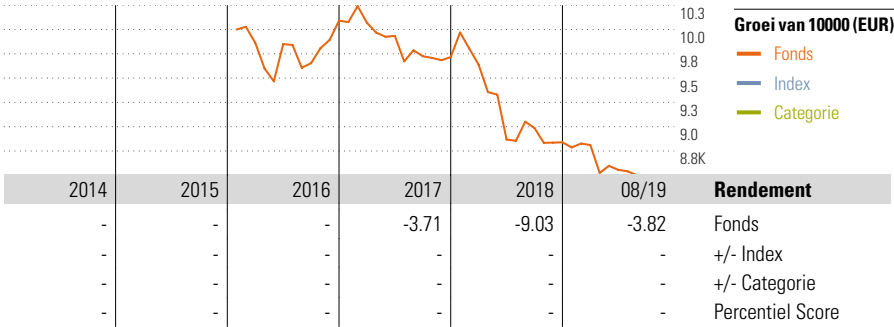
Benchmark van het fonds

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	- Sharpe Ratio	-0.64
Beta	- Std Deviatie	5.42
R-kwadraat	- 3-jr Risico	-
Informatie Ratio	- 5-jr Risico	-
Tracking Error	- 10-jr Risico	-

Rendementen (11 sep 2019)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-0.71	-	-
6 Maanden	-3.33	-	-
1 jaar	-4.81	-	-
3 jr gean.	-3.84	-	-
5 jr gean.	-	-	-

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2019	-0.31	-2.90	-	-
2018	-0.81	-7.98	1.34	-1.64
2017	-0.22	-1.35	-2.10	-0.09
2016	-	-0.13	-1.99	4.53

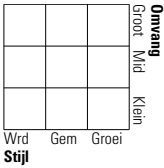
Portefeuille -

Assetverdeling

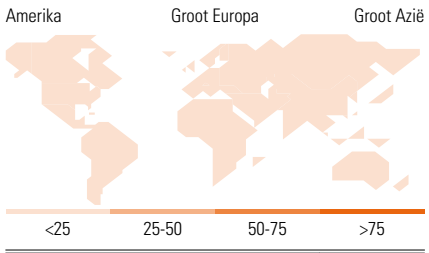
% Long % Short % Netto

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	CHF	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	1 feb 2016	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ronen Israel	ISIN	LU1322539435		
Aanvangsdatum	1 okt 2014				
Koers (11 sep 2019)	CHF 83.86				
Fondsvermogen (mln)	USD 4.78				