

AQR Systematic Total Return Fund C USD Acc

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™

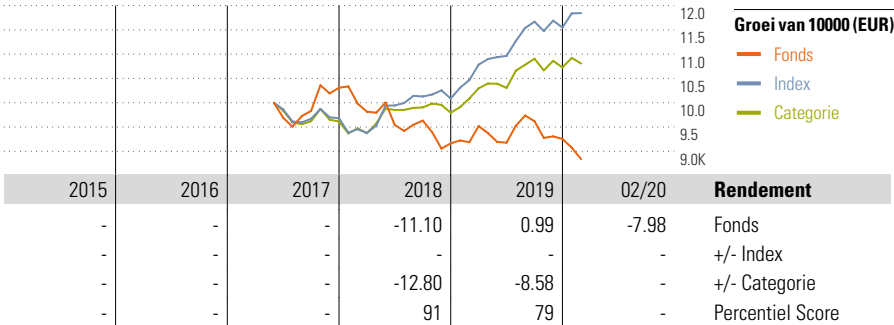
Beleggingsdoelstelling

The investment objective of the Fund is to seek total returns commensurate with its long-term risk target. The Fund will allocate to three investment sub-strategies, each sub-strategy having a distinguishable set of investment objectives (as set out below), namely: the Risk-Balanced Market Exposure Strategy, the Multi Asset Trend Strategy, and the Market Neutral Security Selection Strategy (each is referred to as a "Sub-Strategy" and together the "Sub-Strategies"). There can be no assurance that the Fund will achieve...

Risicomaatstaven

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

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



Rendementen (10 mrt 2020)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-6.10	-8.02	-11.29
6 Maanden	-7.94	-15.48	-12.78
1 jaar	-5.30	-14.73	-17.47
3 jr gean.	-	-	-
5 jr gean.	-	-	-

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2019	3.90	-3.59	4.80	-3.79
2018	-4.78	-2.81	0.97	-4.87
2017	-	-	1.45	4.84

Portefeuille -

Assetverdeling

% Long % Short % Netto

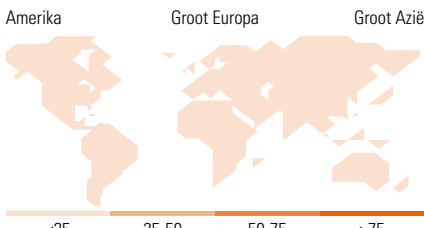
Morningstar Style Box

Stijl Aandelen

	Wrd	Gem	Groei
Stijl			

Stijl vastrentend

	Laag	Gem	Hoog
Rentegevoeligheid			



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	USD	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	nee		
Oprichtingsdatum	31 mei 2017	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	John Huss	ISIN	LU1470531937		
Aanvangsdatum	27 jul 2016				
Koers (10 mrt 2020)	USD 884.73				
Fondsvermogen (mln)	USD 51.96				