

AQR Systematic Total Return Fund C GBP Acc

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™

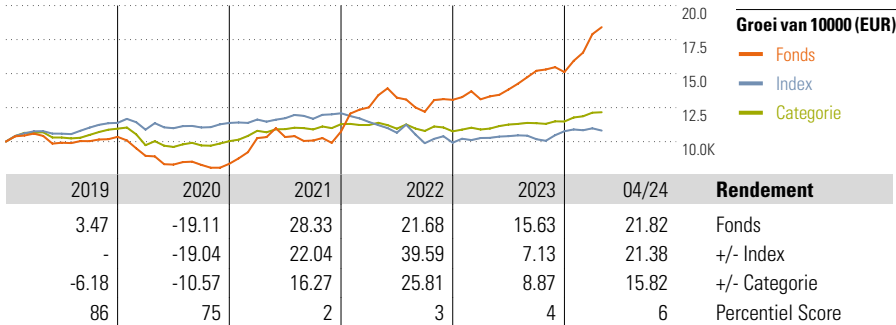
Beleggingsdoelstelling

The 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	14.35	Sharpe Ratio	1.34
Beta	-0.55	Std Deviatie	14.29
R-kwadraat	7.13	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	1.46	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	15.81	10-jr Risico	-

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



Rendementen (23 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	17.12	17.51	15.09
6 Maanden	20.58	13.89	13.05
1 jaar	38.80	33.14	28.95
3 jr gean.	20.92	22.81	16.01
5 jr gean.	12.15	12.05	9.00

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	18.43	-	-	-
2023	0.31	5.51	9.93	-0.61
2022	16.54	5.70	-7.85	7.20
2021	22.57	0.76	-2.48	6.55
2020	-13.47	-7.17	-0.31	1.01

Portefeuille -

Assetverdeling

% Long % Short % Netto

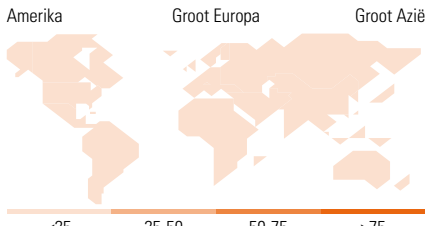
Morningstar Style Box

Stijl Aandelen

	Groot	Mid	Klein
Omvang			
Stijl	Wrd	Gem	Groei

Stijl vastrentend

	Laag	Gem	Hoog
Kredietkwaliteit			
Rentegevoeligheid	Laag	Gem	Hoog



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	GBP	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	nee		
Oprichtingsdatum	17 jan 2017	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	John Huss	ISIN	LU1470532315		
Aanvangsdatum	27 jul 2016				
Koers (23 apr 2024)	GBP 1,595.98				
Fondsvermogen (mln)	GBP 190.62				