

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund RAE EUR Accumulation

Morningstar Categorie Index

Morningstar Euro Cautious Global Target -
Allocation NR EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

Morningstar Rating™

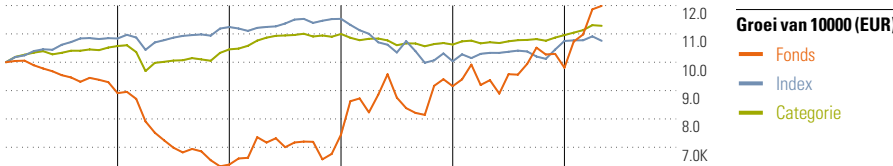
★★★★

Morningstar Categorie™

Alt - Multistrategy

Beleggingsdoelstelling

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



	2019	2020	2021	2022	2023	04/24	Rendement
	-10.89	-28.29	16.58	22.92	7.08	22.26	Fonds
	-19.26	-32.04	14.03	35.89	-0.04	22.21	+/- Index
	-17.16	-27.17	12.43	25.43	3.49	19.22	+/- Categorie
	99	99	3	3	17	1	Percentiel Score

Risicomaatstaven

Alpha	17.19	Sharpe Ratio	0.88
Beta	-0.28	Std Deviatie	20.37
R-kwadraat	0.76	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	0.92	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	21.80	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar EU Cau Gbl Tgt Alloc NR EUR (waar van toepassing)

Rendementen (17 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	11.87	10.35	9.12
6 Maanden	16.57	11.42	11.61
1 jaar	31.60	26.04	25.14
3 jr gean.	16.18	17.10	13.62
5 jr gean.	4.67	3.81	2.74

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	21.02	-	-	-
2023	0.45	4.14	9.76	-6.74
2022	10.50	6.31	-6.95	12.47
2021	15.13	-4.81	2.70	3.58
2020	-11.22	-11.72	-1.87	-6.78

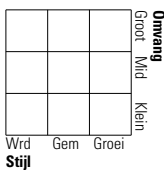
Portefeuille -

Assetverdeling

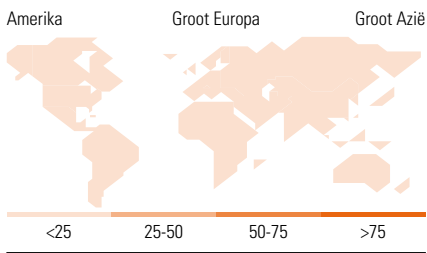
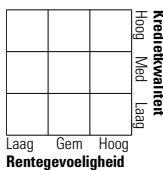
% Long % Short % Netto

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	10,000
Telefoon	1 (203) 742-3600	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	19 okt 2017	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ronen Israel	ISIN	LU1662506093		
Aanvangsdatum	1 okt 2014				
Koers (17 mei 2024)	EUR 107.16				
Fondsvermogen (mln)	EUR 1.98				