

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund RAG GBP Accumulation

Morningstar Categorie Index

Morningstar UK Cautious Target
Allocation NR GBP

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

-

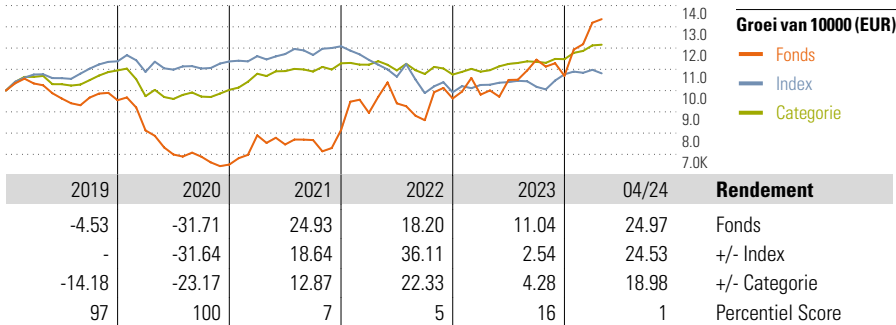
Morningstar Rating™

★★★★

Morningstar Categorie™

Beleggingsdoelstelling

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



Risicomaatstaven

Alpha	16.26	Sharpe Ratio	0.92
Beta	-0.37	Std Deviatie	21.84
R-kwadraat	1.27	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	1.04	5-jr Risico	Hoog
Tracking Error	22.00	10-jr Risico	-

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

Rendementen (17 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	12.20	10.75	8.84
6 Maanden	20.00	13.52	12.19
1 jaar	35.25	29.54	25.70
3 jr gean.	17.93	19.70	13.61
5 jr gean.	6.31	5.71	2.41

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	23.39	-	-	-
2023	1.89	7.03	9.10	-6.67
2022	9.91	4.98	-8.41	11.85
2021	21.09	-5.45	2.77	6.18
2020	-14.88	-13.94	-1.50	-5.36

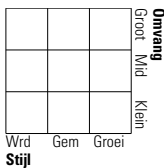
Portefeuille -

Assetverdeling

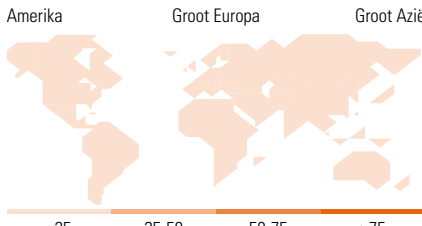
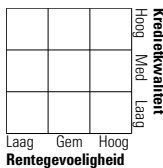
% Long % Short % Netto

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	GBP	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	19 okt 2017	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ronen Israel	ISIN	LU1662506176		
Aanvangsdatum	1 okt 2014				
Koers (17 mei 2024)	GBP 115.19				
Fondsvermogen (mln)	GBP 0.66				