

AQR UCITS Funds AQR Style Premia UCITS Fund RAEF 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™

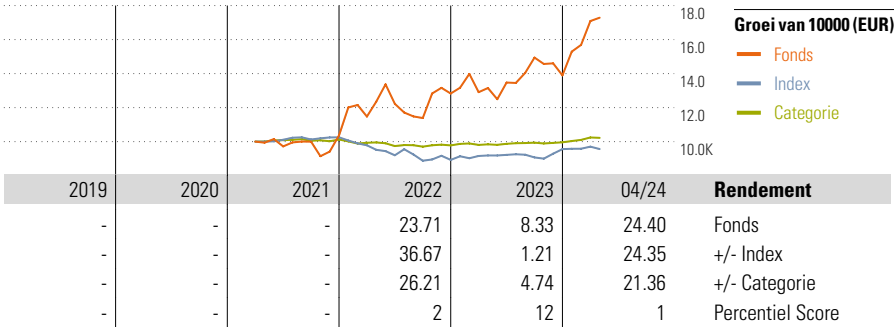
★★★★★

Morningstar Categorie™

Alt - Multistrategy

Beleggingsdoelstelling

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



Risicomaatstaven

Alpha	18.56	Sharpe Ratio	0.93
Beta	-0.30	Std Deviatie	20.78
R-kwadraat	0.82	3-jr Risico	Hoog
Informatie Ratio	0.98	5-jr Risico	-
Tracking Error	22.20	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	13.23	11.71	10.48
6 Maanden	18.55	13.40	13.59
1 jaar	35.33	29.77	28.87
3 jr gean.	17.76	18.68	15.21
5 jr gean.	-	-	-

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	22.99	-	-	-
2023	0.62	4.38	10.90	-6.99
2022	10.65	6.51	-6.82	12.65
2021	-	-	2.85	3.74

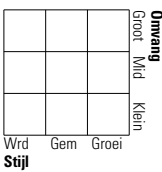
Portefeuille -

Assetverdeling

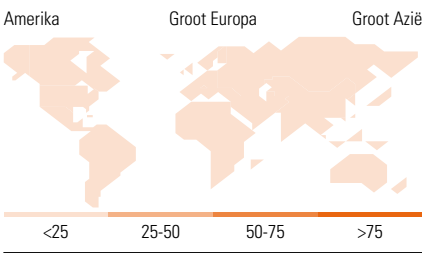
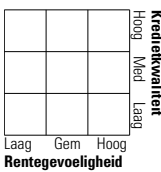
% Long % Short % Netto

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	-
Telefoon	1 (203) 742-3600	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	1 apr 2021	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Ronen Israel	ISIN	LU1662505368		
Aanvangsdatum	1 okt 2014				
Koers (17 mei 2024)	EUR 175.37				
Fondsvermogen (mln)	EUR 2.21				