

AQR UCITS Funds - AQR Global Risk Parity UCITS Fund Class A1 USD Acc

Morningstar Medalist Rating™
 Bronze

Morningstar Categorie Index
Morningstar EAA USD Mod
Target Allocation NR USD
Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

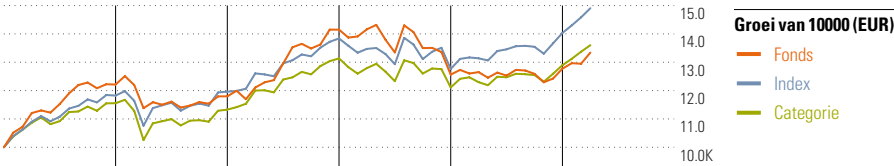
-

Morningstar Rating™
★★★

Morningstar Categorie™
Mixfondsen USD Flexibel

Beleggingsdoelstelling

The Fund seeks efficiently to deliver exposure to a broadly diversified set of global risk premia covering equities, government bonds and eligible, diversified commodity indices. There can be no assurance that the Fund will achieve its investment objective. The Fund is actively managed and will seek to achieve its Investment Objective through exposures to global developed and emerging stocks, developed government bonds, global inflation protected bonds and eligible, diversified commodity indices, among other exposures...



	2019	2020	2021	2022	2023	03/24	Rendement
Fonds	22.14	-3.41	19.93	-11.21	1.67	4.44	Fonds
+/- Index	-	-	4.23	-3.43	-8.28	-1.79	+/- Index
+/- Categorie	6.23	-1.82	3.87	-3.55	-5.14	-1.12	+/- Categorie
Percentiel Score	15	59	22	71	83	75	Percentiel Score

Risicomaatstaven

Alpha	-2.31	Sharpe Ratio	0.27
Beta	0.92	Std Deviatie	9.01
R-kwadraat	80.54	3-jr Risico	Gem
Informatie Ratio	-0.51	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	4.66	10-jr Risico	Gem

Berekeningen met Morningstar EAA USD Mod Tgt Alloc NR USD (waar van toepassing)

Rendementen (19 apr 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	4.04	-0.14	-0.66
6 Maanden	6.71	-2.04	-0.01
1 jaar	4.87	-7.13	-3.35
3 jr gea.	2.48	-2.56	-1.38
5 jr gea.	3.24	-2.69	-0.97

Kwartaalrendementen

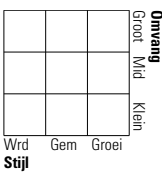
	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	4.44	-	-	-
2023	0.71	-0.98	0.50	1.45
2022	0.09	-5.77	1.16	-6.94
2021	2.61	7.02	4.08	4.93
2020	-6.83	2.02	-0.14	1.76

Portefeuille 30 jun 2023

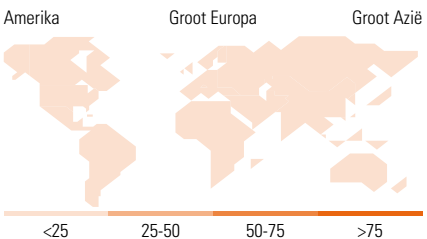
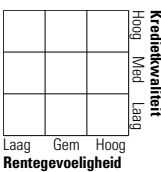
Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	25.43	-25.43
Obligaties	14.68	38.43	-23.75
Kas/ geldmarkt	187.28	38.08	149.20
Overig	0.00	0.01	-0.01

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities	Sector	% Port
UBS (Iri) Sel Money Mkt USD...	—	4.94
United States Treasury Notes...	—	2.93
Germany (Federal Republic Of)...	—	2.76
United States Treasury Notes...	—	2.59
France (Republic Of)...	—	1.42
France (Republic Of)...	—	0.82
United States Treasury Notes...	—	0.79
United States Treasury Notes...	—	0.74
United States Treasury Notes...	—	0.70
United Kingdom of Great...	—	0.56
Totaal Aantal Aandelen		1
Totaal Aantal Obligaties		32
% Van Vermogen In Top 10 Posities		18.25

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	100,000
Telefoon	1 (203) 742-3600	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	http://www.aqr.com/	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	28 aug 2012	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	John Liew	ISIN	LU0995951752		
Aanvangsdatum	28 feb 2012				
Koers (19 apr 2024)	USD 138.32				
Fondsvermogen (mln)	USD 13.10				

*To view the complete Morningstar Analyst Rating™ Research Report for this fund, please [Click here to read a detailed report on this fund.](#)

© 2024 Morningstar Benelux. Alle rechten voorbehouden. De informatie aangaande beleggingsfondsen en de fondsportefeuille in dit document weergegeven: (1) is eigendom van Morningstar en is in licentie verstrekt, (2) mag uitsluitend gebruikt worden conform de contractueel opgestelde licentievoorwaarden, (3) dient informatieve doeleinden en mag niet opgevat worden als beleggingsadvies van Morningstar, (4) is met grote zorg samengesteld maar kan desondanks onjuistheden bevatten. Morningstar aanvaardt geen enkele aansprakelijkheid voor beslissingen gebaseerd op de weergegeven informatie.