



# Basisinformationsblatt

## Zweck

Dieses Informationsblatt stellt Ihnen wesentliche Informationen über dieses Anlageprodukt zur Verfügung. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen dabei zu helfen, die Art, das Risiko, die Kosten sowie die möglichen Gewinne und Verluste dieses Produkts zu verstehen, und Ihnen dabei zu helfen, es mit anderen Produkten zu vergleichen.

## Produkt

# AQR Global Risk Parity UCITS Fund RAE4F

**Der AQR Global Risk Parity UCITS Fund ist ein Teilfonds der AQR UCITS FUNDS**

HERSTELLER: FundRock Management Company S.A.

ISIN: LU1662511259

INTERNET: <https://ucits.aqr.com/>

TELEFONNUMMER: +352 286 797 20

ZUSTÄNDIGE BEHÖRDE: Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“)

VERWALTUNGSGESELLSCHAFT: Die FundRock Management Company S.A. ist in Luxemburg zugelassen und wird durch die CSSF reguliert.

**Zugelassen in:** Dieses PRIIP ist in Luxemburg zugelassen.

**ERSTELLUNGSDATUM 09.09.2024**

## UM WELCHE ART VON PRODUKT HANDELT ES SICH?

**Art:** Der AQR Global Risk Parity UCITS Fund („Fonds“) ist ein Teilfonds der AQR UCITS Funds und erfüllt die Anforderungen an OGAW gemäß Richtlinie 2009/65/EU. Verwaltungsgesellschaft ist die FundRock Management Company S.A. Anlageverwalter des Fonds ist die AQR Capital Management, LLC.

**Ziele:** Das Ziel des Fonds besteht darin, ein ausgewogenes Risiko zwischen verschiedenen Anlagetypen (Anlageklassen) zu bieten und zugleich ökologische, soziale und Unternehmensführungsmerkmale („ESG“-Merkmale) zu fördern. Die Anlagen des Fonds werden Anteile an Unternehmen (Aktien), Anleihen (Darlehen, auf die Zinsen gezahlt werden), Währungen, Rohstoffe und kreditbezogene Vermögenswerte umfassen. Der Fonds strebt ein diversifiziertes Engagement (was bedeutet, dass der Fonds in verschiedene Anlageklassen investieren wird, deren Wertentwicklung sich in der Regel voneinander unterscheidet) in Aktienrisiken, Nominalzinsrisiko, inflationsbezogenem Risiko und Kreditrisiko an (diese Mischung von Risiken wird als die „globalen Risikoprämien“ bezeichnet). Der Nominalzins ist der Zinssatz vor Berücksichtigung der Inflation. Der Fonds wird Unternehmen auswählen, die hervorragende ESG-Merkmale bieten und die Unternehmen mit den schlechtesten ESG-Werten ausschließen, mit dem Ziel, eine geringere CO<sub>2</sub>-Intensität zu erreichen als das Referenz-Anlageuniversum. Daher nimmt der Fonds Offenlegungen nach Artikel 8 der Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor vor.

Der Betrag, der in eine Anlagenklasse investiert wird, ist von der erwarteten Volatilität (statistische Maßzahl für die Preisschwankungen von Vermögenswerten im Laufe der Zeit) und der Korrelation (statistische Maßzahl für die Wertentwicklung von Wertpapieren im Verhältnis zueinander) zwischen den Anlageklassen sowie von anderen Risikoschätzungen abhängig.

Der Fonds wird bestrebt sein, ein gewünschtes Niveau an Volatilität im Portfolio zu erreichen und dabei ein diversifiziertes Engagement in den globalen Risikoprämien zu unterhalten.

Der Fonds wird versuchen, dieses Ziel zu erreichen, indem er vorrangig in die folgenden Instrumente investiert: globale Aktien und aktienähnliche Wertpapiere, Staats- und Unternehmensanleihen, Währungen, Rohstoffe und kreditbezogene Vermögenswerte.

Zusätzlich zu den vorgenannten Anlagen kann der Fonds auch andere Techniken einsetzen, beispielsweise Swaps (Derivatkontrakte, bei denen zwei Parteien die Zahlungsströme oder Verbindlichkeiten aus zwei verschiedenen Finanzinstrumenten austauschen können), Futures (Kontrakte zwischen Käufer und Verkäufer über den Kauf oder Verkauf eines Vermögenswerts zu einem bestimmten Preis an einem bestimmten Tag in der Zukunft), Pensionsgeschäfte (eine kurzfristige Darlehensvereinbarung, bei der eine Partei Wertpapiere an eine andere Partei verkauft und vereinbart, sie zu einem festen Termin und Preis in der Zukunft zurückzukaufen), Kreditderivate und andere Derivate. Derivate sind Anlagen, deren Wert an eine andere Anlage oder an die Wertentwicklung eines anderen variablen Faktors wie zum Beispiel Zinsen gebunden ist. Der Fonds kann auch in strukturierte Produkte ohne eingebettete Derivate („Schuldverschreibungen“) investieren, die ein Engagement in anderen vom Anlageverwalter verwalteten Fonds bieten, die in Metalle, Energie und Agrargüter investieren und möglicherweise Hebelung (Darlehensaufnahme zwecks Anlage) einsetzen.

Die Anlagepolitik des Fonds kann mit einem hohen Maß an Handelsaktivitäten und einem hohen Portfolioumschlag verbunden sein, was erhebliche Transaktionskosten verursachen kann, die vom Fonds getragen werden.

Der Fonds wird aktiv verwaltet. Dies bedeutet, dass die Anlagen nach dem Ermessen des Anlageverwalters ausgewählt werden.

Der Fonds wird nicht unter Bezugnahme auf eine Benchmark verwaltet.

Auf Ihre Anteile werden keine Erträge gezahlt. Sie können Ihre Anlage auf Verlangen täglich einlösen. Es kann nicht garantiert werden, dass der Fonds seine Anlageziele erreicht.

**Kleinanleger-Zielgruppe:** Der Fonds kann für institutionelle Investoren geeignet sein, die als Intermediäre zugunsten von Kleinanlegern handeln, ungeachtet der Tatsache, ob sie als finanziell versierte Investoren einzustufen sein könnten, und/oder (ii) für Kleinanleger, die als finanziell versierte Anleger einzustufen sind. Daher können die Kleinanleger-Anteilsklassen von Kleinanlegern unabhängig von ihrer Einstufung gehalten werden.

**Laufzeit:** Der Fonds hat kein Fälligkeitsdatum. Die FundRock Management Company S.A. ist nicht berechtigt, den Fonds einseitig zu kündigen, und der Fonds kann nicht automatisch gekündigt werden.

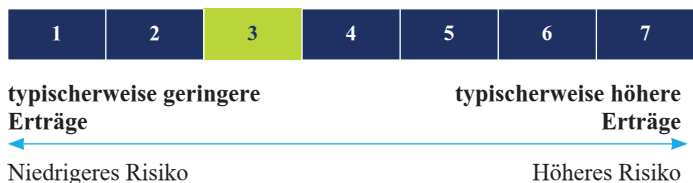
**Stellvertretende Anteilsklassen:** Dieses Dokument beschreibt nicht nur die Klasse RAE4F (LU1662511259), sondern gilt stellvertretend auch für die Klassen RAC4F (LU1662511333), RAS4F (LU1662511762) und RAU4F (LU1662511416). Informationen darüber, welche Anteilsklassen in Ihrem Land vertrieben werden, erhalten Sie von der Verwaltungsgesellschaft.

**Praktische Informationen:** Die Verwahrstelle des Fonds ist J.P. Morgan SE, Niederlassung Luxemburg. Der Prospekt sowie die Halbjahres- und Jahresberichte des Fonds sind in englischer Sprache kostenfrei unter <https://ucits.aqr.com/> erhältlich. Andere praktische Informationen wie die aktuellsten Anteilspreise stehen kostenfrei unter <https://ucits.aqr.com/> zur Verfügung.

## WELCHE RISIKEN BESTEHEN UND WAS KÖNNTE ICH IM GEGENZUG DAFÜR BEKOMMEN?

### RISIKOINDIKATOR

Der Gesamtrisikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln oder wir nicht in der Lage sind, Sie auszubezahlen.



Der Risikoindikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt 5 Jahre lang halten. Wenn Sie die Anlage frühzeitig auflösen, kann das tatsächliche Risiko erheblich davon abweichen und Sie erhalten unter Umständen weniger zurück. Es kann sein, dass Sie Ihr Produkt nicht ohne Weiteres veräußern können oder dass Sie es zu einem Preis veräußern müssen, der den Betrag, den Sie zurückerhalten, erheblich schmälert.

Wir haben dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 3 eingestuft, wobei einer mittelniedrigen Risikoklasse entspricht. Das

Risiko potenzieller Verluste aus der künftigen Wertentwicklung wird als mittelniedrig eingestuft. Bei ungünstigen Marktbedingungen ist es unwahrscheinlich, dass unsere Fähigkeit beeinträchtigt wird, Sie auszuzahlen.

**Bitte beachten Sie das Währungsrisiko. In einigen Fällen erhalten Sie möglicherweise Zahlungen in einer anderen Währung, sodass Ihre endgültige Rendite vom Wechselkurs zwischen den beiden Währungen abhängen wird. Dieses Risiko ist bei dem oben angegebenen Indikator nicht berücksichtigt.**

Der Fonds unterliegt (unter anderem) den folgenden Risikofaktoren:

- Rohstoffrisiko
- Liquiditätsrisiko
- Gegenparteiisiko
- Kreditrisiko
- Risiko von Sicherungsgeschäften
- Risiko von Schwellenmärkten

Dieses Produkt beinhaltet keinen Schutz vor künftigen Marktentwicklungen, sodass Sie das angelegte Kapital ganz oder teilweise verlieren könnten.

## WELCHE RISIKEN BESTEHEN UND WAS KÖNNTE ICH IM GEGENZUG DAFÜR BEKOMMEN? (FORTSETZUNG)

### PERFORMANCE-SZENARIEN

Was Sie aus diesem Produkt erhalten, hängt davon ab, wie sich der Markt künftig entwickelt. Künftige Marktentwicklungen sind ungewiss und können nicht genau vorhergesagt werden.

Das pessimistische, mittlere und optimistische Szenario sind eine Veranschaulichung anhand der schlechtesten, durchschnittlichen und besten Wertentwicklung des Produkts/einer geeigneten Benchmarkin den vergangenen 10 Jahren. Die künftige Marktentwicklung kann hiervon deutlich abweichen.

Das Stressszenario zeigt, was Sie im Fall extremer Marktbedingungen zurückerhalten könnten.

Empfohlene Haltedauer: 5 Jahre		1 Jahr	5 years (Empfohlene Haltedauer)
Anlage 10.000 EUR			
Szenarien			
Mindestens	Es gibt keine garantierte Mindestrendite. Sie könnten Ihre Anlage ganz oder teilweise verlieren.		
Stress	Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten können	6.820 EUR	6.300 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	-31,83%	-8,82%
Pessimistisches	Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten können	8.230 EUR	8.990 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	-17,66%	-2,10%
Mittleres	Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten können	10.420 EUR	12.230 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	4,16%	4,11%
Optimistisches	Was Sie nach Abzug der Kosten erhalten können	11.970 EUR	14.940 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	19,69%	8,36%

In den angeführten Zahlen sind sämtliche Kosten des Produkts selbst enthalten, jedoch unter Umständen nicht alle Kosten, die Sie an Ihren Berater oder Ihre Vertriebsstelle zahlen müssen. Bei den angeführten Zahlen ist Ihre persönliche steuerliche Situation nicht berücksichtigt, die sich ebenfalls darauf auswirken kann, wie viel Sie zurückerhalten.

Das Stressszenario zeigt, was Sie im Fall extremer Marktbedingungen zurückerhalten könnten.

Pessimistisches Szenario: Diese Art von Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen 11-2021 und 09-2024.

Mittleres Szenario: Diese Art von Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen 11-2014 und 11-2019.

Optimistisches Szenario: Diese Art von Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen 11-2016 und 11-2021.

## WAS GESCHIEHT, WENN FUNDROCK MANAGEMENT COMPANY S.A NICHT IN DER LAGE IST, DIE AUSZAHLUNG VORZUNEHMEN?

Die Verwaltungsgesellschaft ist verantwortlich für die Administration und Verwaltung des Fonds und hält in der Regel keine Vermögenswerte des Fonds (Vermögenswerte, die von einer Verwahrstelle gehalten können, werden gemäß den geltenden Bestimmungen in der Regel bei einer Verwahrstelle in ihrem Depotbanken-Netzwerk gehalten). Die Verwaltungsgesellschaft als Hersteller dieses Produkts hat keine Auszahlungsverpflichtung, da das Produkt eine solche Auszahlung nicht vorsieht. Den Anlegern kann jedoch ein Verlust entstehen, wenn der Fonds oder die Verwahrstelle nicht in der Lage sind, die Auszahlung vorzunehmen. Es ist kein Entschädigungs- oder Sicherungssystem vorhanden, um einen solchen Verlust ganz oder teilweise auszugleichen.

## WELCHE KOSTEN ENTSTEHEN?

Die Person, die Ihnen dieses Produkt verkauft oder Sie dazu berät, kann Ihnen weitere Kosten in Rechnung stellen. Sollte dies der Fall sein, informiert Sie die Person über diese Kosten und zeigt Ihnen, wie sich sämtliche Kosten im Zeitverlauf auf Ihre Anlage auswirken werden.

### KOSTEN IM ZEITVERLAUF

Aus den Tabellen geht hervor, welche Beträge Ihrer Anlage entnommen werden, um unterschiedliche Arten von Kosten zu decken. Diese Beträge sind davon abhängig, wie viel Sie investieren, wie lange Sie das Produkt halten und wie gut sich das Produkt entwickelt. Die hier ausgewiesenen Beträge sind Veranschaulichungen auf der Grundlage eines beispielhaften Anlagebetrags und unterschiedlicher möglicher Anlagezeiträume

Wir sind von folgenden Annahmen ausgegangen:

- Im ersten Jahr würden Sie den angelegten Betrag zurückerhalten (0 % Jahresrendite). Für die anderen Haltedauern sind wir davon ausgegangen, dass sich das Produkt so entwickelt wie im mittleren Szenario angegeben.

- 10.000 EUR werden investiert.

Anlage 10.000 EUR Szenarien	Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen	Wenn Sie nach 5 Jahren aussteigen
<b>Gesamtkosten</b> <b>Auswirkung der Kosten pro Jahr (*)</b>	<b>55 EUR</b> 0,55%	<b>300 EUR</b> 0,51% pro Jahr

(\*) Diese Angaben veranschaulichen, wie die Kosten Ihre Rendite pro Jahr während der Haltedauer verringern. Wenn Sie beispielsweise zum Ende der empfohlenen Haltedauer aussteigen, wird Ihre durchschnittliche Rendite pro Jahr voraussichtlich 4,62% vor Kosten und 4,11% nach Kosten betragen.

Wir können einen Teil der Kosten zwischen uns und der Person aufteilen, die Ihnen das Produkt verkauft, um die für Sie erbrachten Dienstleistungen zu decken. Der Betrag wird Ihnen mitgeteilt.

## WELCHE KOSTEN ENTSTEHEN (FORTSETZUNG)

### ZUSAMMENSETZUNG DER KOSTEN

		Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen
<b>Einmalige Kosten bei Einstieg oder Ausstieg</b>		
<b>Einstiegskosten</b>	Wir berechnen keine Einstiegsgebühr für dieses Produkt.	0 EUR
<b>Ausstiegskosten</b>	Wir berechnen keine Ausstiegsgebühr für dieses Produkt.	0 EUR
<b>Jedes Jahr erhobene laufende Kosten</b>		
<b>Verwaltungsgebühren und andere administrative oder Betriebskosten</b>	0,50% des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Hierbei handelt es sich um eine Schätzung auf der Grundlage der tatsächlichen Kosten des letzten Jahres.	50 EUR
<b>Transaktionskosten</b>	0,05% des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Hierbei handelt es sich um eine Schätzung der Kosten, die anfallen, wenn wir die zugrunde liegenden Anlagen für das Produkt kaufen oder verkaufen. Der tatsächliche Betrag hängt davon ab, wie viel wir kaufen und verkaufen.	5 EUR
<b>Zusätzliche Kosten, die unter bestimmten Bedingungen erhoben werden</b>		
<b>Erfolgsgebühr</b>	Für dieses Produkt wird keine Erfolgsgebühr berechnet.	0 EUR

## WIE LANGE SOLLTE ICH DIE ANLAGE HALTEN, UND KANN ICH VORZEITIG GELD ENTNEHMEN?

**Empfohlene Haltedauer:** 5 Jahre.

Das Konzept des Fonds sieht vor, einen Kapitalzuwachs über einen langfristigen Anlagehorizont bei einem mittelniedrigen Risikoniveau zu bieten. Sie können ihr Geld täglich ohne Zahlung einer Vertragsstrafe entnehmen.

## WIE KANN ICH MICH BESCHWEREN?

Beschwerden über das Verhalten der Person, die Sie zu dem Produkt beraten oder es Ihnen verkauft hat, sind direkt an die betreffende Person zu richten. Beschwerden über das Produkt oder das Verhalten der Hersteller dieses Produkts sind an die folgende Anschrift zu richten:

Postanschrift: FundRock Management Company S.A., 33 Rue de Gasperich, 5826 Hesperange, Luxemburg.

E-Mail: [FRMC\\_qualitycare@fundrock.com](mailto:FRMC_qualitycare@fundrock.com)

Internet: <https://www.fundrock.com/policies-and-compliance/frd-complaints-handling-policy/>.

In allen Fällen muss der/die Beschwerdeführer/in seine/ihre Kontaktangaben (Name, Adresse, Telefonnummer oder E-Mail-Adresse) deutlich angeben und eine kurze Erläuterung der Beschwerde geben.

## SONSTIGE ZWECKDIENLICHE ANGABEN

Einzelheiten zur aktuellen Vergütungspolitik der Verwaltungsgesellschaft, insbesondere eine Beschreibung, wie die Vergütung und Leistungen berechnet werden, sowie Angaben zu den für die Vergabe der Vergütung und Leistungen verantwortlichen Personen und zur Zusammensetzung des Vergütungsausschusses sind unter <https://www.fundrock.com/remuneration-policy/> verfügbar und werden in Papierform auf Anfrage kostenlos zur Verfügung gestellt.

Weitere Informationen zum Fonds wie der Prospektnachtrag und der Prospekt, der letzte Jahresbericht und der gegebenenfalls nachfolgende Halbjahresbericht sind unter <https://ucits.aqr.com/> abrufbar.

Die Wertentwicklung wird für volle Kalenderjahre angegeben, da diese Anteilsklasse 2017 aufgelegt wurde, und ist ebenso wie die vorherigen monatlichen Performance-Szenario-Berechnungen verfügbar unter <https://swift.zeidlerlegalservices.com/priip-info/aqr-ucits-funds>.

Die für den Fonds in Luxemburg geltende Steuergesetzgebung kann sich auf Ihre persönliche steuerliche Situation auswirken.