

AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund IAE2T

Categoria Morningstar™

Alt - Debt Arbitrage

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

Morningstar Rating™

Senza rating

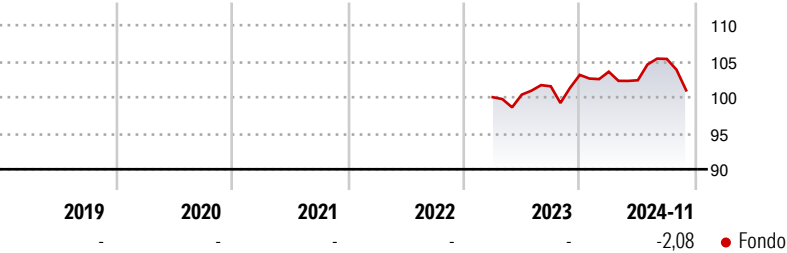
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The investment objective of the Fund is to seek to maximize risk adjusted returns through the implementation of arbitrage strategies. The Fund aims to outperform, after expenses, the ML 3 Month T Bill Index (the "Benchmark"). The Fund is actively managed and will seek to achieve its investment objective by employing a number of arbitrage investment strategies, including Merger Arbitrage, Convertible Arbitrage and Corporate Event Strategies.

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rendimenti



Rend. Cumulati %

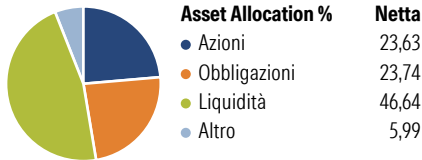
	Fondo
3-Mesi	-4,29
6-Mesi	-0,68
1-Anno	-1,84
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 20/12/2024

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2026	-	-	-	-
2025	-	-	-	-
2024	0,43	-1,15	2,89	-
2023	-	0,36	1,15	1,56
2022	-	-	-	-

Portafoglio 30/09/2025



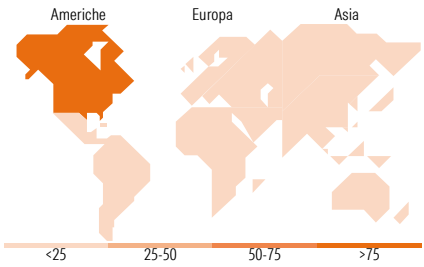
Fixed Income Style

Box™



Fondo

Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	-



Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Bills	—	8,13
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...	—	7,73
United States Treasury Bills	—	5,85
United States Treasury Bills	—	5,49
United States Treasury Bills	—	4,08
United States Treasury Bills	—	3,56
United States Treasury Bills	—	2,90
Welltower OP LLC 2.75%	—	2,82
United States Treasury Bills	—	2,79
United States Treasury Bills	—	2,52
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		45,87
Numero Complessivo di Titoli Azionari		536
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		48

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	37,47
Societario	17,02
Cartolarizzazioni	0,01
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	46,29
Derivati	-0,80

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	72,60
Da 0 a 4 cedole	12,35
Da 4 a 6 cedole	10,38
Da 6 a 8 cedole	1,45
Da 8 a 10 cedole	3,22
Da 10 a 12 cedole	0,01
Oltre 12 cedole	0,00

Ripartizione Geografica %

	Fondo
<b>America</b>	<b>91,69</b>
Stati Uniti	87,07
Canada	2,81
America Latina e Centrale	1,81
<b>Europa</b>	<b>2,50</b>
Regno Unito	2,01
Europa Occidentale - Euro	0,37
Europa Occidentale - Non Euro	0,10
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,01
Medio Oriente	0,01
<b>Asia</b>	<b>5,80</b>
Giappone	0,26
Australasia	0,01
Asia - Paesi Sviluppati	4,17
Asia - Emergente	1,36

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	0,15 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	1 (203) 742-3600	(20/12/2024)		Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	10/03/2023	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,00%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	15,00%
Data Inizio Gestione	03/06/2021	Inc/Acc	Acc		
NAV (20/12/2024)	EUR 101,27	ISIN	LU2319525866		
Patrimonio Netto (Mln)	168,43 USD				

(30/09/2025)