

AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund IAE2 EUR Acc

Categoria Morningstar™

Alt - Debt Arbitrage

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

Morningstar Rating™

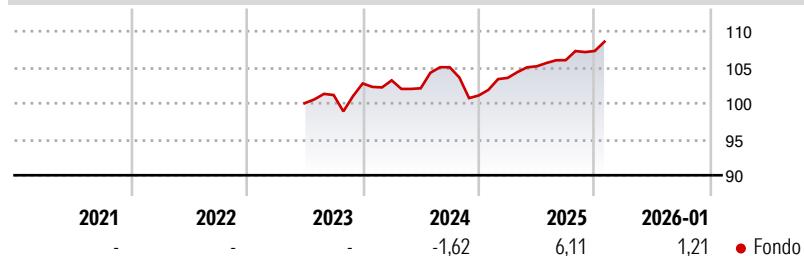
Senza rating

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	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,27	-	-	-	-
6-Mesi	2,60	2026	-	-	-
1-Anno	6,63	2025	2,42	1,55	0,82
3-Anni Ann.ti	-	2024	0,42	-1,06	2,86
5-Anni Ann.ti	-	2023	-	-	1,14
10-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	1,59

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

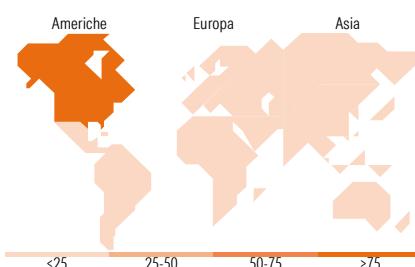
Portafoglio 30/09/2025

Asset Allocation %

• Azioni	23,63
• Obbligazioni	23,74
• Liquidità	46,64
• Altro	5,99

Fixed Income Style Box™


Duration Effettiva
Maturity effettiva
Qualità Credito Media

Fondo

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	
Numeri Complessivi di Titoli Azionari	536	
Numeri Complessivi di Titoli Obbligazionari	48	

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo
Governativo
Societario
Cartolarizzazioni
Enti Locali
Liquidità ed equivalenti
Derivati

Coupon Range %

Fondo
0 coupon
Da 0 a 4 cedole
Da 4 a 6 cedole
Da 6 a 8 cedole
Da 8 a 10 cedole
Da 10 a 12 cedole
Oltre 12 cedole

Ripartizione Geografica %

Fondo
America
Stati Uniti
Canada
America Latina e Centrale
Europa
Regno Unito
Europa Occidentale - Euro
Europa Occidentale - Non Euro
Europa dell'Est
Africa
Medio Oriente
Asia
Giappone
Australasia
Asia - Paesi Sviluppati
Asia - Emergenti

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln) (02/02/2026)	48,47 EUR	Investimento Min. Ingresso	80.000.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,75%
Data di Partenza	20/01/2022	UCITS	Si	Spese correnti	0,75%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	15,00%
Data Inizio Gestione	03/06/2021	ISIN	LU2319525940		
NAV (02/02/2026)	EUR 108,92				
Patrimonio Netto (Mln)	168,43 USD				
(30/09/2025)					