

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 %

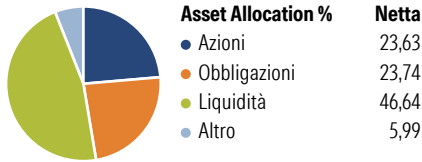
| | Fondo |
|----------------|-------|
| 3-Mesi | 1,27 |
| 6-Mesi | 2,60 |
| 1-Anno | 6,63 |
| 3-Anni Ann.ti | - |
| 5-Anni Ann.ti | - |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

Rendimenti

| | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---------------|------|-------|------|-------|
| Trimestrali % | | | | |
| 2026 | - | - | - | - |
| 2025 | 2,42 | 1,55 | 0,82 | 1,19 |
| 2024 | 0,42 | -1,06 | 2,86 | -3,73 |
| 2023 | - | - | 1,14 | 1,59 |
| 2022 | - | - | - | - |

Portafoglio 30/09/2025



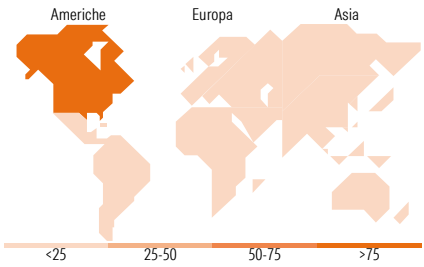
Fixed Income Style

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 |
|-------------------------------|-------|
| America | 91,69 |
| Stati Uniti | 87,07 |
| Canada | 2,81 |
| America Latina e Centrale | 1,81 |
| Europa | 2,50 |
| 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 |
| Asia | 5,80 |
| 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) | 48,47 EUR | Investimento Min. Ingresso | 80.000.000 EUR |
| Telefono | 1 (203) 742-3600 | (02/02/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | http://www.aqr.com/ | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 0,75% |
| Data di Partenza | 20/01/2022 | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | 0,75% |
| Nome del Gestore | - | UCITS | Si | Commissione di incentivo | 15,00% |
| Data Inizio Gestione | 03/06/2021 | Inc/Acc | Acc | | |
| NAV (02/02/2026) | EUR 108,92 | ISIN | LU2319525940 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 168,43 USD | | | | |

(30/09/2025)