## **AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund IAG3F GBP Acc**

Categoria Morningstar™

Alt - Debt Arbitrage

**Benchmark Morningstar** 

Not Categorized

## **Benchmark Dichiarato**

ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

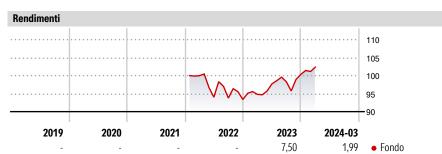
Morningstar Rating™

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	-



Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,34	Trimestrali %				
6-Mesi	3,91	2025	-	-	-	-
1-Anno	7,46	2024	1,99	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	2023	1,54	3,05	0,59	2,13
5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-5,98	-0,26	-0,42
10-Anni Ann.ti	-	2021	-	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 03/04/2024						

## Portafoglio 31/12/2024





Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome	Settore	%
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD	-	8,03
United States Treasury Bills	_	5,76
InterDigital, Inc. 3.5%	_	3,96
United States Treasury Bills	_	2,88
United States Treasury Bills	_	2,78
United States Treasury Bills	-	2,73
Stride Inc 1.125%	_	2,59
United States Treasury Bills	_	2,37
American Airlines Group Inc	_	2,33
United States Treasury Bills	-	2,16
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		35,58
Numero Complessivo di Titoli Azionari	i	442
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	ionari	34

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
₩ Governativo	19,89
Societario	30,97
★ Cartolarizzazioni	0,10
Enti Locali	0,64
Liquidità ed equivalenti	52,39
Derivati	-3,99
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	45,33
Da 0 a 4 cedole	30,88
Da 4 a 6 cedole	8,12
Da 6 a 8 cedole	10,00
Da 8 a 10 cedole	4,31
Da 10 a 12 cedole	1,33
Oltre 12 cedole	0,03

Ripartizione Geografica %	Fondo	
America	89,00	
Stati Uniti	84,55	
Canada	3,57	
America Latina e Centrale	0,88	
Europa	4,44	
Regno Unito	1,42	
Europa Occidentale - Euro	2,24	
Europa Occidentale - Non Euro	0,74	
Europa dell'Est	0,00	
Africa	0,01	
Medio Oriente	0,04	
Asia	6,56	
Giappone	0,77	
Australasia	0,21	
Asia - Paesi Sviluppati	3,53	
Asia - Emergente	2,04	

Anagrafica	
Società di Gestione	AQR Capital Management
	LLC
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	11/01/2022
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	03/06/2021
NAV (03/04/2024)	GBP 103,04
Patrimonio Netto (MIn)	138,14 USD
(31/12/2024)	

Patrimonio Classe (MIn) (04/04/2024)	0,17 GBP
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	GBP
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2319526914

Investimento Min. Ingresso	100.000 GBP
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	1,25%
Commissione di incentivo	-