

AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund IAU2 USD 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

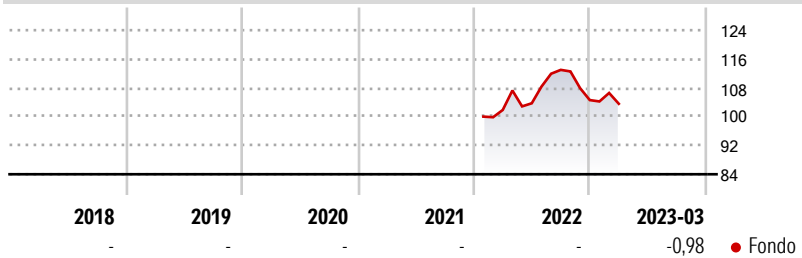
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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 %

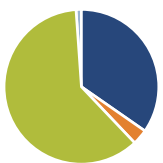
	Fondo
3-Mesi	-3,09
6-Mesi	-8,82
1-Anno	-1,09
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 05/04/2023

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Rendimenti Trimestrali %				
2026	-	-	-	-
2025	-	-	-	-
2024	-	-	-	-
2023	-0,98	-	-	-
2022	-	1,82	8,95	-7,43

Portafoglio 31/12/2025



Asset Allocation %

● Azioni	34,67
● Obbligazioni	3,24
● Liquidità	60,98
● Altro	1,12

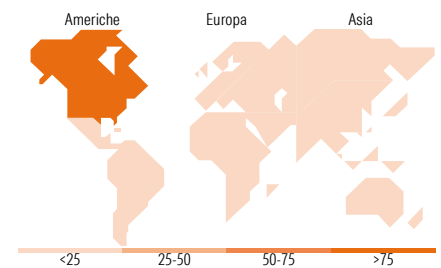
Fixed Income Style

Box™

		Qualità Credito	
		Alto	Basso
Sensibilità ai Tassi	Alta		
	Med		
Bassa			

Duration Effettiva -
Maturità effettiva -
Qualità Credito Media

Fondo



Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Bills	-	8,64
United States Treasury Bills	-	8,60
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...	-	8,22
United States Treasury Bills	-	4,97
United States Treasury Bills	-	3,19
United States Treasury Bills	-	2,02
United States Treasury Bills	-	1,84
United States Treasury Bills	-	1,67
CommScope Technologies LLC 5%	-	1,13
IIP Operating Partnership LP...	-	1,11
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		41,39
Numero Complessivo di Titoli Azionari		592
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		32

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛️ Governativo	30,84
⚙️ Societario	12,55
🏠 Cartolarizzazioni	0,01
🏢 Enti Locali	0,00
🏦 Liquidità ed equivalenti	56,68
📄 Derivati	-0,08
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	63,80
Da 0 a 4 cedole	5,21
Da 4 a 6 cedole	20,11
Da 6 a 8 cedole	5,26
Da 8 a 10 cedole	4,59
Da 10 a 12 cedole	0,01
Oltre 12 cedole	1,03

Ripartizione Geografica %

	Fondo
America	88,68
Stati Uniti	85,23
Canada	1,89
America Latina e Centrale	1,56
Europa	6,60
Regno Unito	2,86
Europa Occidentale - Euro	2,01
Europa Occidentale - Non Euro	1,72
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	4,72
Giappone	0,23
Australasia	0,01
Asia - Paesi Sviluppati	3,57
Asia - Emergente	0,91

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	0,62 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-
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	LU2319525510		
NAV (05/04/2023)	USD 99,33				
Patrimonio Netto (Mln)	159,96 USD				

(31/12/2025)