

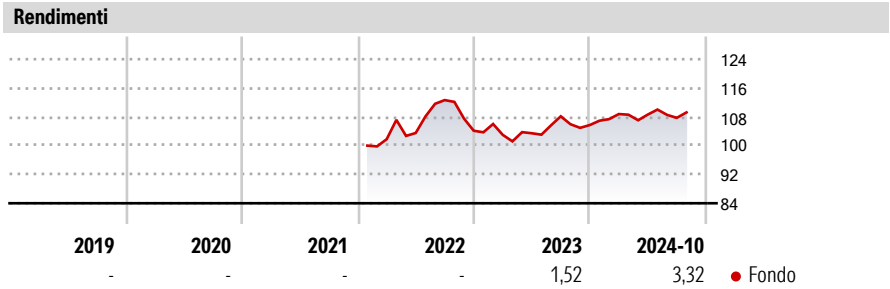
AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund IAU2F USD Acc

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Alt - Debt Arbitrage	Not Categorized Usato nel Report	ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD	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	1,26	Trimestrali %				
6-Mesi	1,89	2026	-	-	-	-
1-Anno	4,19	2025	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	2024	2,88	-0,12	-0,84	-
5-Anni Ann.ti	-	2023	-1,10	0,44	4,55	-2,24
10-Anni Ann.ti	-	2022	-	1,69	8,82	-7,55

Rendimenti aggiornati al 07/11/2024

Portafoglio 30/09/2025

Asset Allocation %

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

Fixed Income Style Box™

Qualità Credito: Alto, Med, Basso
Sensibilità ai Tassi: Bassa, Med, Alta

Duration Effettiva: -
Maturità effettiva: -
Qualità Credito Media: -

Fondo

Americhe Europa Asia

<25 25-50 50-75 >75

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)	0,11 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	(07/11/2024)		Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	25/01/2022	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,25%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	03/06/2021	Inc/Acc	Acc		
NAV (07/11/2024)	USD 106,27	ISIN	LU2319525353		
Patrimonio Netto (Mln)	168,43 USD				
(30/09/2025)					