

# AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund IAE2T

**Categoria Morningstar™**

Alt - Debt Arbitrage

**Benchmark Morningstar**

Not Categorized

Usato nel Report

**Benchmark Dichiarato**

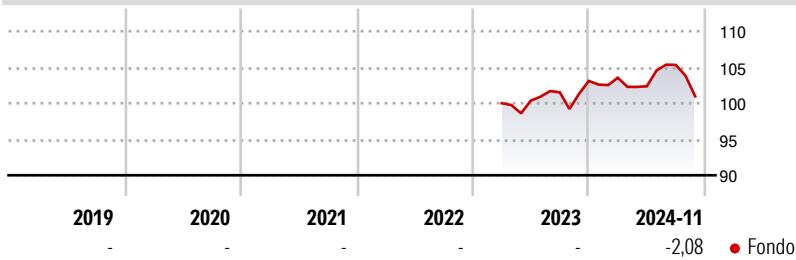
ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

**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.

**Rendimenti**

**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
3-Mesi	-4,29
6-Mesi	-0,68
1-Anno	-1,84
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 20/12/2024

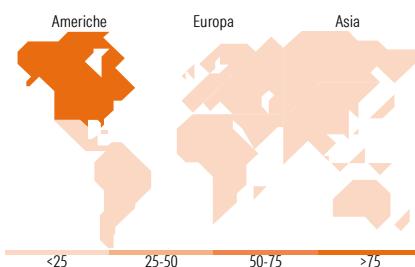
**Portafoglio 30/09/2025**

**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	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	<b>91,69</b>
Stati Uniti	87,07
Canada	2,81
America Latina e Centrale	1,81
Europa	<b>2,50</b>
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	<b>5,80</b>
Giappone	0,26
Australasia	0,01
Asia - Paesi Sviluppati	4,17
Asia - Emergenti	1,36

**Anagrafica**

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln) (20/12/2024)	0,15 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	10/03/2023	UCITS	Si	Spese correnti	1,00%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	15,00%
Data Inizio Gestione	03/06/2021	ISIN	LU2319525866		
NAV (20/12/2024)	EUR 101,27				
Patrimonio Netto (Mln)	168,43 USD				
(30/09/2025)					