# **AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund IAE2 EUR Acc**

Categoria Morningstar™

Alt - Debt Arbitrage

### **Benchmark Morningstar**

Not Categorized

#### Benchmark Dichiarato

ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

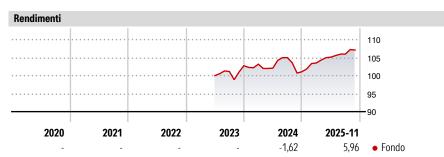
#### Morningstar Rating™

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	1,27	Trimestrali %				
6-Mesi	1,77	2025	2,42	1,55	0,82	-
1-Anno	5,92	2024	0,42	-1,06	2,86	-3,73
3-Anni Ann.ti	-	2023	-	-	1,14	1,59
5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	2021	-	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 10/12/2025						

## Portafoglio 30/06/2025





Pondo

Duration Effettiva Maturity effettiva Qualità Credito Media



Titoli principali		
Nome	Settore	%
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD	-	7,89
United States Treasury Bills	_	4,87
InterDigital, Inc. 3.5%	_	3,96
Carnival Corporation 5.75%	_	3,72
United States Treasury Bills	_	3,64
United States Treasury Bills	_	3,50
United States Treasury Bills	_	2,59
Welltower OP LLC 2.75%	_	2,52
United States Treasury Bills	_	2,19
Stride Inc 1.125%	_	2,14
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		37,02
Numero Complessivo di Titoli Azionar	i	451
Numero Complessivo di Titoli Obbligaz	rionari	47

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	20,51
Societario	36,41
★ Cartolarizzazioni	0,04
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	40,50
Derivati	2,54
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	40,22
Da 0 a 4 cedole	33,01
Da 4 a 6 cedole	18,07
Da 6 a 8 cedole	4,99
Da 8 a 10 cedole	2,60
Da 10 a 12 cedole	0,02
Oltre 12 cedole	1,10

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	90,56
Stati Uniti	86,15
Canada	2,93
America Latina e Centrale	1,48
Europa	3,28
Regno Unito	2,53
Europa Occidentale - Euro	0,51
Europa Occidentale - Non Euro	0,21
Europa dell'Est	0,01
Africa	0,01
Medio Oriente	0,01
Asia	6,16
Giappone	0,35
Australasia	0,10
Asia - Paesi Sviluppati	3,70
Asia - Emergente	2,00

Anagrafica	
Società di Gestione	AQR Capital Management
	LLC
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	20/01/2022
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	03/06/2021
NAV (10/12/2025)	EUR 107,23
Patrimonio Netto (MIn)	163,12 USD
(30/06/2025)	

Patrimonio Classe (MIn)	47,72 EUR
Domicilio Valuta del Fondo UCITS Inc/Acc ISIN	LUSSEMBURGO EUR Si Acc LU2319525940

Investimento Min. Ingresso	80.000.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,75%
Spese correnti	0,75%
Commissione di incentivo	15,00%