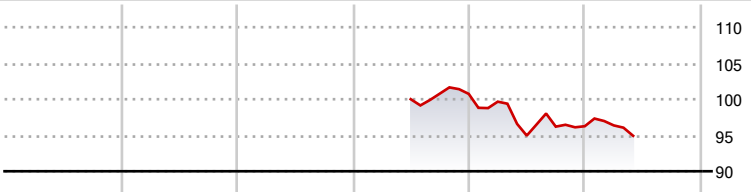
# AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund IAE2F EUR Acc

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Alt - Debt Arbitrage | Not Categorized<br>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.

## Rendimenti




| 2018 | 2019 | 2020 | 2021 | 2022 | 2023-05 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| - | - | - | - | -4,46 | -1,38 | Fondo |

## Misure di Rischio

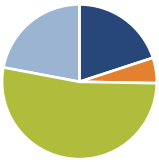
| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | - | 3Y Sharpe Ratio | - |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | - |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

| Rend. Cumulati % | Fondo |
|---|---|
| 3-Mesi | -2,12 |
| 6-Mesi | -1,23 |
| 1-Anno | -1,71 |
| 3-Anni Ann.ti | - |
| 5-Anni Ann.ti | - |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 31/05/2023

| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | - | - | - | - |
| 2023 | 0,11 | - | - | - |
| 2022 | -1,07 | -4,73 | 1,31 | 0,06 |
| 2021 | - | - | 0,77 | -0,03 |

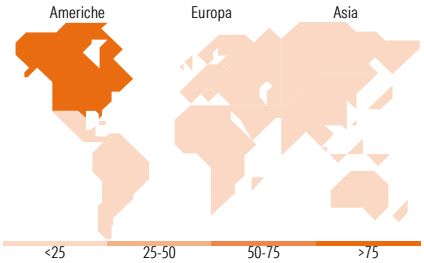
## Portafoglio 30/06/2025



| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 19,98 |
| Obbligazioni | 5,31 |
| Liquidità | 52,68 |
| Altro | 22,03 |

**Fixed Income Style Box™**

| | Fondo |
|---|---|
| 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 Azionari | | 451 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 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 | 03/06/2021 |
| Nome del Gestore | - |
| Data Inizio Gestione | 03/06/2021 |
| NAV (31/05/2023) | EUR 94,73 |
| Patrimonio Netto (Mln) (30/06/2025) | 163,12 USD |

| | |
|---|---|
| Patrimonio Classe (Mln) (31/05/2023) | 1,01 USD |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | EUR |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | LU2319525783 |

| | |
|---|---|
| Investimento Min. Ingresso | 80.000.000 EUR |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | 0,90% |
| Spese correnti | 1,25% |
| Commissione di incentivo | - |

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.