## **AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund IAG3F GBP Acc**

Usato nel Report

Categoria Morningstar™

**Benchmark Morningstar** Not Categorized Alt - Debt Arbitrage

**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	1,34	Trimestrali %				
6-Mesi	3,91	2025	-	-	-	-
1-Anno	7,46	2024	1,99	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	2023	1,54	3,05	0,59	2,13
5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-5,98	-0,26	-0,42
10-Anni Ann.ti	-	2021	-	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 03/04/2024						

## Portafoglio 30/06/2025





Fixed Income Sector Weightings %

**Fondo Duration Effettiva** Maturity effettiva Qualità Credito Media

Fondo



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
NumeroComplessivodiTitoliObbligazi	onari	47

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		

AQR Capital Management
LLC
1 (203) 742-3600
http://www.aqr.com/
11/01/2022
-
03/06/2021
GBP 103,04
163,12 USD

Patrimonio Classe (MIn)	0,17 GBP
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	GBP
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2319526914

Investimento Min. Ingresso	100.000 GBP
Investimento Min. Successivo	=
T.E.R.	=
Spese correnti	1,25%
Commissione di incentivo	-