

AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund IAU1F USD Acc

Categoria Morningstar™

Alt - Debt Arbitrage

Benchmark Morningstar

Not Categorized
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Bofa Merrill Lynch 3-month U.S. Trs Bill

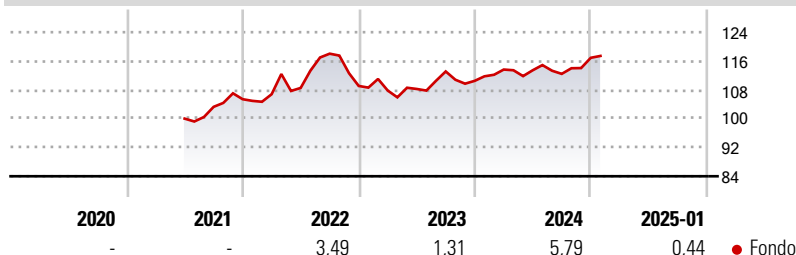
Morningstar Rating™

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").

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,22
3Y Beta	-	3Y Std Dev	7,50
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

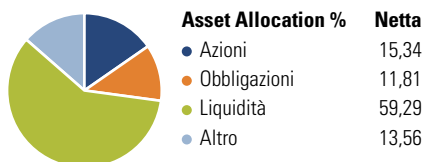
Periodo	Fondo
3-Mesi	3,50
6-Mesi	3,17
1-Anno	4,83
3-Anni Ann.ti	4,54
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

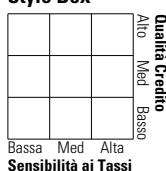
Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-	-	-	-
2024	2,83	-0,17	-0,89	3,97
2023	-1,16	0,39	4,50	-2,30
2022	1,32	1,63	8,77	-7,59
2021	-	-	3,27	2,05

Portafoglio 30/09/2024



Fixed Income

Style Box™

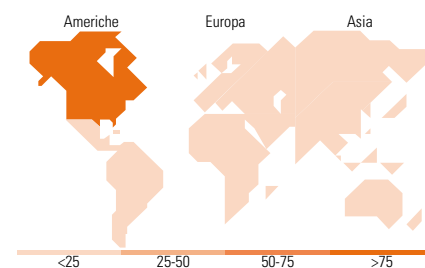


Fondo

Duration Effettiva -

Maturità effettiva -

Qualità Credito Media



Titoli principali

Nome	Settore	%
UBS (Irl) Sel Money Mkt USD...	-	7,85
United States Treasury Bills	-	4,53
United States Treasury Bills	-	4,29
United States Treasury Bills	-	2,98
United States Treasury Bills	-	2,57
MACOM Technology Solutions...	-	2,00
United States Treasury Bills	-	1,95
United States Treasury Bills	-	1,89
United States Treasury Bills	-	1,83
American Airlines Group Inc...	-	1,83
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		31,72
Numero Complessivo di Titoli Azionari		464
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		30

Fixed Income Sector Weightings %

Settore	Fondo
Governativo	23,71
Societario	22,91
Cartolarizzazioni	0,17
Enti Locali	2,12
Liquidità ed equivalenti	51,52
Derivati	-0,42

Coupon Range %

Range	Fondo
0 coupon	59,66
Da 0 a 4 cedole	18,69
Da 4 a 6 cedole	7,13
Da 6 a 8 cedole	6,16
Da 8 a 10 cedole	5,60
Da 10 a 12 cedole	2,70
Oltre 12 cedole	0,05

Ripartizione Geografica %

Regione	Fondo
America	84,49
Stati Uniti	81,02
Canada	2,86
America Latina e Centrale	0,60
Europa	6,98
Regno Unito	2,93
Europa Occidentale - Euro	2,96
Europa Occidentale - Non Euro	0,99
Europa dell'Est	0,01
Africa	0,05
Medio Oriente	0,04
Asia	8,54
Giappone	0,71
Australasia	0,17
Asia - Paesi Sviluppati	5,81
Asia - Emergente	1,84

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC	Patrimonio Classe (Mln)	4,32 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 USD
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-
Data di Partenza	03/06/2021	UCITS	Si	Spese correnti	1,45%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	03/06/2021	ISIN	LU2319525270		
NAV (04/02/2025)	USD 102,78				
Patrimonio Netto (Mln)	152,23 USD				

(30/09/2024)