

AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund IAU2F USD Acc

Categoria Morningstar™

Alt - Debt Arbitrage

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

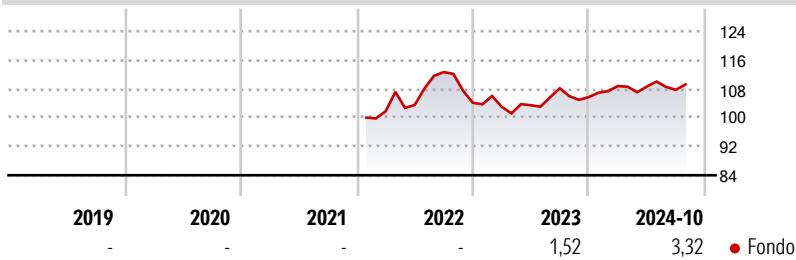
ICE BofA US 3M Trsy Bill TR USD

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	Rend. Cumulati %
3-Mesi	1,26
6-Mesi	1,89
1-Anno	4,19
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 07/11/2024

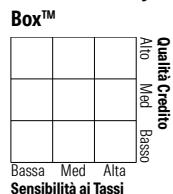
Rendimenti Trimestrali %

Fondo	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-	-	-	-
2024	2,88	-0,12	-0,84	-
2023	-1,10	0,44	4,55	-2,24
2022	-	1,69	8,82	-7,55

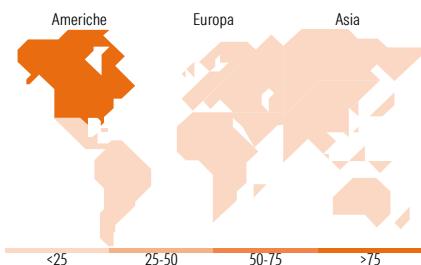
Portafoglio 30/09/2025

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 %

Governativo	37,47
Societario	17,02
Cartolarizzazioni	0,01
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	46,29
Derivati	-0,80

Coupon Range %

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	91,69
America	91,69
Stati Uniti	87,07
Canada	2,81
America Latina e Centrale	1,81
Europa	2,50
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	5,80
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) (07/11/2024)	0,11 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000.000 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	25/01/2022	UCITS	Si	Spese correnti	1,25%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	03/06/2021	ISIN	LU2319525353		
NAV (07/11/2024)	USD 106,27				
Patrimonio Netto (Mln)	168,43 USD				
(30/09/2025)					