

AQR Sustainable Corporate Arbitrage UCITS Fund IAE3F EUR 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	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %

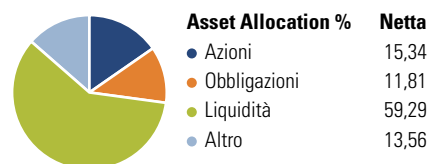
	Fondo
3-Mesi	-1,74
6-Mesi	-2,52
1-Anno	-0,35
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 04/02/2025

Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-	-	-	-
2024	0,30	-1,16	2,87	-3,81
2023	0,20	0,33	1,14	1,65
2022	-	-	-	0,15
2021	-	-	-	-

Portafoglio 30/09/2024



Fixed Income

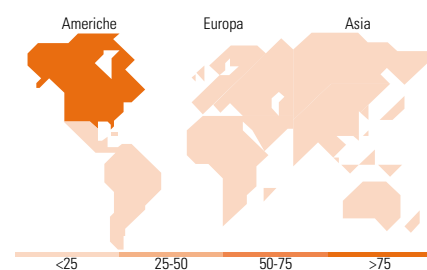
Style Box™



Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva -
Maturità effettiva -
Qualità Credito Media

Fondo



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 %

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

Coupon 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 %

	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)	86,40 EUR	Investimento Min. Ingresso	100.000 EUR
Telefono	1 (203) 742-3600	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	http://www.aqr.com/	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	23/09/2022	UCITS	Si	Spese correnti	0,90%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	03/06/2021	ISIN	LU2463981279		
NAV (04/02/2025)	EUR 101,47				
Patrimonio Netto (Mln)	152,23 USD				

(30/09/2024)