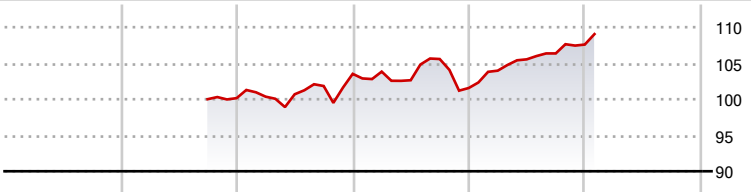
AQR Sustainable Corporate Arbitrage UCITS Fund IAE3F EUR Acc

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Alt - Debt Arbitrage	Not Categorized 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



2021	2022	2023	2024	2025	2026-01	
-	-	3,36	-1,90	5,94	1,35	● Fondo

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-0,11
3Y Beta	-	3Y Std Dev	3,84
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	0,54
6-Mesi	2,00
1-Anno	5,66
3-Anni Ann.ti	2,28
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 12/02/2026

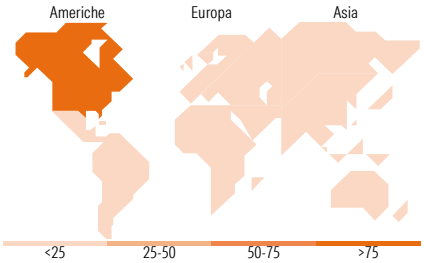
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	2,37	1,51	0,77	1,16
2024	0,30	-1,16	2,87	-3,81
2023	0,20	0,33	1,14	1,65
2022	-	-	-	0,15

Portafoglio 30/09/2025

Asset Allocation %	Netta
● Azioni	23,63
● Obbligazioni	23,74
● Liquidità	46,64
● Altro	5,99

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



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
Numero Complessivo di Titoli Azionari		536
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		48

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	37,47
Societario	17,02
Cartolarizzazioni	0,01
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	46,29
Derivati	-0,80

Coupon Range %	Fondo
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
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 - Emergente	1,36

Anagrafica

Società di Gestione	AQR Capital Management LLC
Telefono	1 (203) 742-3600
Web	http://www.aqr.com/
Data di Partenza	23/09/2022
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	03/06/2021
NAV (12/02/2026)	EUR 107,45
Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2025)	168,43 USD

Patrimonio Classe (Mln) (12/02/2026)	82,40 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2463981279

Investimento Min. Ingresso	100.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	0,90%
Commissione di incentivo	-

© 2026 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.