

ZUSÄTZLICHE INFORMATIONEN FÜR QUALIFIZIERTE ANLEGER IN DER SCHWEIZ

AQR UCITS FUNDS ist nach Schweizer Gesetz für den Vertrieb an qualifizierte Anleger in der Schweiz zugelassen. Der Schweizer Vertreter ist Carnegie Fund Services SA, 11, rue du Général-Dufour, 1204 Genf. Zahlstelle in der Schweiz ist die Banque Cantonale de Genève (Genfer Kantonalbank), 17, quai de l'Île, 1204 Genf. Anleger in der Schweiz können die Dokumente der Gesellschaft (wie Prospekt, Satzung, Wesentliche Anlegerinformationen (KIIDs) und Geschäftsberichte) unentgeltlich beim Schweizer Vertreter beziehen. Das vorliegende Dokument darf nicht als öffentliches Angebot in der Schweiz herausgegeben, verteilt und verbreitet werden. Die Empfänger des vorliegenden Dokuments in der Schweiz sind angehalten, das Dokument ohne vorgängige Konsultation des Schweizer Vertreters oder eines anderen professionellen Beraters (z. B. Rechtsberater) nicht weiterzugeben. Der Gerichtsstand für Rechtsstreitigkeiten im Zusammenhang mit dem Vertrieb der Fondsanteile an qualifizierte Anleger in der Schweiz ist Genf.

AQR UCITS FUNDS

***Investmentgesellschaft mit veränderlichem
Kapital (SICAV)***

R.C.S. Luxembourg: B 165881

**Halbjahresbericht und
ungeprüfter Abschluss
für die am 30. September 2016
abgeschlossene Berichtsperiode**

Auf der Grundlage dieses Jahresabschlusses können keine Zeichnungen entgegengenommen werden. Zeichnungen können nur über das Antragsformular und auf der Grundlage des aktuellen Prospekts, der Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) sowie des jüngsten Jahres- und Halbjahresberichts entgegenommen werden.

AQR UCITS FUNDS

Inhaltsverzeichnis

Geschäftsleitung und Verwaltung der Gesellschaft	2
Nettovermögensaufstellung (ungeprüft)	4
Erfolgsrechnung (ungeprüft)	5
Veränderung des Nettovermögens (ungeprüft)	6
Anlagenbestand (ungeprüft)	
• AQR Emerging Equities UCITS Fund	7
• AQR Global Core Equity UCITS Fund	17
• AQR Global Defensive Equity UCITS Fund	22
• AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund	28
• AQR Global Risk Parity UCITS Fund	34
• AQR Managed Futures UCITS Fund	38
• AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund	61
• AQR Style Premia UCITS Fund	63
Ausweis über die Veränderung der im Umlauf befindlichen Anteile (ungeprüft)	95
Statistische Informationen (ungeprüft)	97
Anhang zum Abschluss (ungeprüft)	99

AQR UCITS FUNDS

Geschäftsleitung und Verwaltung der Gesellschaft

Verwaltungsrat

Präsident des Verwaltungsrats

Antonio Thomas

Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers, Société cooperative
2, rue Gerhard Mercator
BP 1443
L-1014 Luxemburg

Verwaltungsratsmitglieder

Andrew Bastow

Brendan Kalb

Thomas Nummer

Rechtsberater

In England

Simmons & Simmons LLP
CityPoint
One Ropemaker Street
London EC2Y 9SS
Vereinigtes Königreich

Verwaltungs- und Transferstelle

HedgeServ (Luxemburg) S.à r.l.

2c rue Albert Borschette

1246 Luxemburg

Großherzogtum Luxemburg

In Luxemburg

Arendt & Medernach S.A.
41A, avenue J.F. Kennedy
2082 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Verwahrstelle und Depotbank

J.P. Morgan Bank Luxemburg S.A.

European Bank & Business Centre

6C, route de Treves

2633 Senningerberg

Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter, Promoter und Vertriebsstelle

AQR Capital Management,
LLC Two Greenwich Plaza
Greenwich Connecticut, 06830
USA

Beauftragter für Wertpapierdarlehen

J.P. Morgan Chase Bank N.A.

25 Bank Street

Canary Wharf

London E14 5JP

Vereinigtes Königreich

Unteranlageverwalter

UBS Global Asset Management (Americas) Inc.
One North Wacker Drive
Chicago, IL 60606
USA

Geschäftsleitung und Verwaltung der Gesellschaft (Fortsetzung)

Verwaltungsgesellschaft

FundRock Management Company S.A.
33, rue de Gasperich
5826 Hesperange
Großherzogtum Luxemburg

Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft

Romain Denis
Director - IT Projects & Data Management
(seit 14 .Oktober 2016)

Christophe Douche
Director - Risk & Operations

Gudrun Goebel
Executive Director - Network & Client Relationships

Gregory Nicolas
Director - Legal, Compliance & Corporate
(seit 1. September 2016)

Ross Thomson
Director - Operations Oversight
(bis 1. September 2016)

Revel Wood
Executive Director - Chief Executive Officer

Aline Zanette
Director - US Market
(bis 16. August 2016)

Vertreter in der Schweiz

Carnegie Fund Services S.A.
11, rue du Général-Dufour
1204 Genf
Schweiz

Zahlstelle in der Schweiz

Banque Cantonale de Genève
17, quai de l'Île
1204 Genf
Schweiz

Weitere Zahlstellen

Zahlstelle in Österreich
Société Générale
Prinz Eugen Strasse 8 10/5/Top 11
Wien, 1040 Österreich

Zahlstelle in Belgien

Société Générale Private Banking NV
Kortrijkssteenweg 302
Gent, 9000 Belgien

Zahlstelle in Frankreich

State Street Banque SA
Immeuble Défense Plaza
23-25 Rue Delarivière-Lefoullon
92064 Paris La Défense Cedex, Frankreich

Zahlstelle in Deutschland

Marcard Stein & Co.
Ballindamm, 36
20095 Hamburg,
Deutschland

Zahlstelle in Spanien

Simmons and Simmons LLP
Calle Miguel Ángel 11
28010, Madrid
Spanien

Zahlstelle in Schweden

Skandinaviska Enskilda Banken AB
Kungsträdgårdsgatan
SE-106 40 Stockholm
Schweden

Zahlstelle im Vereinigten Königreich

AQR Capital Management (Europe) LLP
20-22 Bedford Row
London WC1R 4JS
Vereinigtes Königreich

AQR UCITS FUNDS

Nettovermögensaufstellung (ungeprüft)

Zum 30. September 2016

	Anm.	AQR Emerging Equities UCITS Fund USD	AQR Global Core Equity UCITS Fund USD	AQR Global Defensive Equity UCITS Fund USD	AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund USD	AQR Global Parity UCITS Fund USD	AQR Managed Futures UCITS Fund US	AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund* USD	AQR Style Premia UCITS Fund USD	Gesamt EUR
Vermögenswerte										
Anlagekosten		617.444.538	88.974.054	245.482.662	58.895.136	624.252.324	288.783.875	94.560.673	910.659.637	2.613.009.411
Marktwert der Anlagen	2(c)	648.840.718	93.891.017	264.796.897	61.591.553	628.574.786	288.824.984	96.978.564	910.773.299	2.671.191.238
Bankguthaben	2(e)	55.826.135	2.985.799	7.623.232	2.006.192	42.022.698	38.268.794	10.220.365	76.851.467	210.361.463
Forderungen gegenüber Brokern	2(f)	19.947.163	956	-	24.100	59.531.560	25.305.975	-	449.741.075	494.715.044
Einlagen bei Brokern für börsengehandelte und zentral abgewickelte Derivate	2(g)	4.871.140	80.475	205.026	12.836	12.007.938	12.152.312	1.191.489	110.038.752	125.393.611
Forderungen für Nachschussmargen	3(i)	2.375	-	-	1.068	52.156	112.787	174.522	4.197.882	4.050.841
Nicht realisierter Wertzuwachs aus Devisenterminkontrakten	3(c)	5.023.855	-	-	-	703.331	4.578.107	-	7.712.295	16.073.498
Nicht realisierter Wertzuwachs aus Devisenterminkontrakten zu Absicherungszwecken	3(c)	-	-	-	-	739.003	515.020	-	1.756.706	2.685.873
Nicht realisierter Wertzuwachs aus Swaps	3(d,e,f,g,h)	843.750	-	-	-	2.767.524	23.503	-	4.789.274	7.515.100
Dividendenforderungen	2(i)	1.034.538	190.732	713.881	107.958	-	-	-	-	1.826.227
Zinsforderungen	2(i)	-	-	-	-	358.703	38.724	1.857.010	134.911	2.131.538
Forderungen aus verkauften Anlagen		-	3.937.377	-	-	-	-	-	-	3.512.536
Gründungskosten	5(e)	5.222	-	-	-	16.137	8.295	-	10.330	35.670
Sonstige Vermögenswerte		68.602	885	14.771	7.160	110.425	1.762	2.016	148.193	315.638
Total Vermögenswerte		736.463.498	101.087.241	273.353.807	63.750.867	746.884.261	369.830.263	110.423.966	1.566.154.184	3.539.808.277
Verbindlichkeiten										
Verbindlichkeiten gegenüber Brokern	2(f)	1.093.410	-	-	-	-	-	5	-	975.436
Einlagen von Brokern für börsengehandelte und zentral abgewickelte Derivate	2(g)	-	-	-	-	594.666	-	-	-	530.502
Verbindlichkeiten für Nachschussmargen	3(i)	29.705	14.156	41.989	4.793	1.376.603	1.056.033	-	421.911	2.627.405
Nicht realisierter Wertverlust aus Devisenterminkontrakten zu Absicherungszwecken	3(c)	2.305.248	-	-	-	157.791	4.004.756	-	9.308.445	14.073.991
Nicht realisierter Verlust aus Devisenterminkontrakten	3(c)	-	-	-	-	4.914.237	1.868.894	-	8.012.500	13.199.189
Nicht realisierter Wertverlust aus Swaps	3(d,e,f,g,h)	1.068.548	-	-	-	355.418	371.380	-	11.729.482	12.065.505
Verbindlichkeiten für Anlageverwaltungsgebühren	5(b)	206.171	17.264	57.296	10.494	169.784	159.466	32.678	828.298	1.321.603
Verbindlichkeiten für Performancegebühren	5(c)	-	-	-	-	-	107.482	-	-	95.885
Verbindlichkeiten für den Erwerb von Anlagen		-	4.022.001	-	-	2.278.622	-	407.223	-	5.984.072
Verbindlichkeiten für Verwaltungsgesellschaftsgebühren	5(c)	16.734	3.304	6.494	893	12.802	13.010	4.432	25.689	74.364
Sonstige Verbindlichkeiten		140.997	24.820	39.853	41.104	106.122	46.048	19.202	150.137	506.966
Total Verbindlichkeiten		4.860.813	4.081.545	145.632	57.284	9.966.045	7.627.069	463.540	30.476.462	51.454.918
Gesamtnettovermögen		731.602.685	97.005.696	273.208.175	63.693.583	736.918.216	362.203.194	109.960.426	1.535.677.722	3.488.353.359

*Teilfonds aufgelegt am 2. Juni 2016

AQR UCITS FUNDS

Erfolgsrechnung (ungeprüft)

Für den Berichtszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

	Anm.	AQR Emerging Equities UCITS Fund USD	AQR Global Core Equity UCITS Fund USD	AQR Global Defensive Equity UCITS Fund USD	AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund USD	AQR Global Risk Parity UCITS Fund USD	AQR Managed Futures UCITS Fund USD	AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund* USD	AQR Style Premia UCITS Fund USD	Gesamt EUR
Ertrag										
Zinserträge	2(i)	-	-	-	-	5.231.348	652.763	2.128.550	2.267.227	9.143.870
Nettoddividendenerträge abzüglich ausländischer Quellensteuer	2(i)	11.105.142	1.102.476	3.502.447	461.220	-	-	-	-	14.384.215
Nettoertrag aus Wertpapierleihgeschäften	2(k)	24.567	-	-	-	-	-	-	-	21.852
Zinsertrag auf Bankguthaben		18.924	31	173	2	39.982	7.848	876	115.660	163.218
Sonstiger Ertrag		66.768	-	-	-	-	-	-	-	59.390
Total Ertrag		11.215.401	1.102.507	3.502.620	461.222	5.271.330	660.611	2.129.426	2.382.887	23.772.545
Aufwand										
Anlageverwaltungsgebühren	5(b)	1.497.361	105.447	348.881	43.258	1.243.191	761.720	145.905	4.584.843	7.765.797
Verwaltungsgesellschaftsgebühren	5(c)	85.828	7.128	20.054	5.566	90.848	34.101	16.754	164.545	377.877
Performancegebühren	5(c)	-	-	-	-	-	123.779	-	155	110.238
Zeichnungssteuer (Taxe d'abonnement)	6	23.855	4.575	13.179	3.065	31.687	14.342	5.243	69.801	147.430
Rechtskosten	5(b)	17.083	2.013	8.258	2.476	19.984	6.572	986	50.282	95.757
Verwaltungsstellengebühren	5(d)	175.269	22.996	70.896	11.581	176.564	72.788	17.176	341.453	790.511
Verwahrstellengebühren	5(d)	197.695	12.772	23.425	14.422	23.672	21.996	2.420	24.329	285.287
Depotbankgebühren	5(d)	44.658	8.570	17.394	8.570	47.844	16.421	4.419	83.734	206.015
Gebühren für Fachberater	5(b)	68.236	17.359	16.333	15.041	70.354	27.968	7.999	42.938	236.807
Zinsaufwand	2(i)	-	-	-	-	1.099.688	-	-	-	978.163
Bankgebühren		77.698	1.429	2.896	391	32.511	8.415	1.739	92.996	193.976
Abschreibung von Gründungskosten	5(e)	1.212	-	-	-	8.865	1.394	-	1.724	11.737
Sonstiger Aufwand		66.893	9.045	18.562	8.171	42.440	18.541	2.714	103.326	239.889
Total Aufwand		2.255.788	191.334	539.878	112.541	2.887.648	1.108.037	205.355	5.560.126	11.439.484
Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen		8.959.613	911.173	2.962.742	348.681	2.383.682	(447.426)	1.924.071	(3.177.239)	12.333.061
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	2(i)	(26.454.316)	(2.614.156)	760.478	775.502	244.123	18.192	1.006.831	33.656	(23.331.078)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures	3(b)	3.321.189	291.983	346.874	115.896	30.163.288	(4.680.719)	123.900	5.786.226	31.549.040
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten zu Absicherungszwecken	3(c)	3.938.659	(9.748)	(45.372)	(167.521)	1.198.240	1.914.998	34	29.984.730	32.745.746
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten zu Absicherungszwecken -	3(c)	-	-	-	-	(19.325.676)	(6.297.364)	-	(6.574.684)	(28.639.591)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swaps	3(d,e,f,g,h)	8.363.578	-	-	-	17.978.209	(223.435)	660.017	(53.584.290)	(23.843.630)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungsgeschäften	2(h)	(70.172)	20.913	90.991	203.696	(40.962)	(45.510)	78	1.522.290	1.495.523
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) von Anlagen	2(c)	65.126.462	3.736.863	8.959.542	1.236.012	1.766.317	(3.040)	2.417.891	19.780	74.058.881
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) auf Futures	2(c), 3(b)	(1.347.108)	(32.650)	(74.225)	(1.904)	927.807	2.207.744	36.117	(2.960.099)	(1.106.810)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) auf Devisenterminkontrakten	2(c), 3(c)	2.954.266	-	-	-	5.117.313	2.859.659	-	192.376	9.894.356
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) auf Devisenterminkontrakten zu Absicherungszwecken	2(c), 3(c)	-	-	-	-	(28.338.259)	(8.661.517)	-	(49.990.634)	(77.377.202)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) auf Swaps	2(c), 3(d,e,f,g,h)	(1.204.779)	-	-	-	(835.003)	(199.599)	75.679	2.479.084	280.530
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) auf Fremdwährungsumrechnung	2(h)	42.772	(11.356)	(15.188)	1.670	25.121	8.341	8	198.476	222.234
Nettoergebnis der Erfolgsrechnung für die Berichtsperiode		63.630.164	2.293.022	12.985.842	2.512.032	11.264.200	(13.549.676)	6.244.626	(76.070.328)	8.281.060

*Teilfonds aufgelegt am 2. Juni 2016

Die Erläuterungen im Anhang bilden einen wesentlichen Bestandteil dieses Abschlusses.

AQR UCITS FUNDS

Veränderung des Nettovermögens (ungeprüft)

Für den Berichtszeitraum vom 1. April 2016 bis 30. September 2016

Anm.	AQR Emerging Equities UCITS Fund USD	AQR Global Core Equity UCITS Fund USD	AQR Global Defensive Equity UCITS Fund USD	AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund USD	AQR Global Parity UCITS Fund USD	AQR Managed Futures UCITS Fund USD	AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund* USD	AQR Style Premia UCITS Fund USD	Gesamt EUR
Nettovermögen zu Beginn der Berichtsperiode	682.728.818	94.701.531	255.562.479	21.604.401	706.715.817	236.627.037	-	1.194.388.708	2.799.183.472
Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	8.959.613	911.173	2.962.742	348.681	2.383.682	(447.426)	1.924.071	(3.177.239)	12.333.061
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen	2(i)	(26.454.316)	(2.614.156)	760.478	775.502	244.123	18.192	1.006.831	33.656 (23.331.078)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures	3(b)	3.321.189	291.983	346.874	115.896	30.163.288	(4.680.719)	123.900	5.786.226 31.549.040
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten	3(c)	3.938.659	(9.748)	(45.372)	(167.521)	1.198.240	1.914.998	34	29.984.730 32.745.746
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Devisenterminkontrakten zu Absicherungszwecken	3(c)	-	-	-	-	(19.325.676)	(6.297.364)	-	(6.574.684) (6.574.684)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Swaps	3(d,e,f)	8.363.578	-	-	-	17.978.209	(223.435)	660.017	(53.584.290) (23.843.630)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungsgeschäften	2(h)	(70.172)	20.913	90.991	203.696	(40.962)	(45.510)	78	1.522.290 1.495.523
Realisierter Nettogewinn/(-verlust) der Berichtsperiode	(1.941.449)	(1.399.835)	4.115.713	1.276.254	32.600.904	(9.761.264)	3.714.931	(26.009.311)	2.309.071
Einnahmen aus Anteilszeichnungen	21.885.010	11.143	4.815.385	39.577.150	21.520.521	161.608.601	103.723.800	548.332.537	801.853.296
Ausgaben für Anteilsrücknahmen	(36.641.307)	-	(155.531)	-	(2.582.322)	(22.482.768)	(8.000)	(130.973.195)	(171.532.256)
Nettoeinnahmen aus Anteistransaktionen	(14.756.297)	11.143	4.659.854	39.577.150	18.938.199	139.125.833	103.715.800	417.359.342	630.321.040
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs/(-verlusts) von Anlagen	2(c)	65.126.462	3.736.863	8.959.542	1.236.012	1.766.317	(3.040)	2.417.891	19.780 74.058.881
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs/(-verlusts) auf Futures	2(c), 3(b)	(1.347.108)	(32.650)	(74.225)	(1.904)	927.807	2.207.744	36.117	(2.960.099) (1.106.810)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs/(-verlusts) auf Devisenterminkontrakten	2(c), 3(c)	2.954.266	-	-	-	5.117.313	2.859.659	-	192.376 9.894.356
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs/(-verlusts) auf Devisenterminkontrakten zu Absicherungszwecken	2(c), 3(c)	-	-	-	-	(28.338.259)	(8.661.517)	-	(49.990.634) (77.377.202)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs/(-verlusts) auf Swaps	2(c), 3(d,e,f)	(1.204.779)	-	-	-	(835.003)	(199.599)	75.679	2.479.084 280.530
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs/(-verlusts) auf Fremdwährungsumrechnung	2(h)	42.772	(11.356)	(15.188)	1.670	25.121	8.341	8	198.476 222.234
Berichtigung für Fremdwährungsumrechnung									50.567.787
Nettovermögen am Ende der Berichtsperiode	731.602.685	97.005.696	273.208.175	63.693.583	736.918.216	362.203.194	109.960.426	1.535.677.722	3.488.353.359

AQR UCITS FUNDS

AQR Emerging Equities UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien				
Brasilien				
Ambey SA - ADR	USD	790.494	4.798.299	0,66
Banco Bradesco SA - ADR	USD	661.369	5.972.162	0,82
BM&FBovespa SA - Bolsa de Valores Mercadorias e Futuros	BRL	450.200	2.312.837	0,32
Braskem SA	BRL	564.800	4.336.730	0,59
BRF SA	BRL	166.000	2.792.285	0,38
Centrais Eletricas Brasileiras SA	BRL	245.900	1.791.279	0,24
Cia Brasileira de Distribuicao	BRL	12.400	202.019	0,03
Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo - ADR	USD	334.145	3.087.500	0,42
Cia Energetica de Minas Gerais - ADR	USD	237.053	623.449	0,08
Cia Energetica de Sao Paulo	BRL	45.600	206.629	0,03
EDP - Energias do Brasil SA	BRL	126.300	565.702	0,08
Engie Brasil Energia SA	BRL	28.100	334.275	0,05
Equatorial Energia SA	BRL	122.400	1.903.381	0,26
Itau Unibanco Holding SA - ADR	USD	362.019	3.935.147	0,54
Itausa - Investimentos Itau SA	BRL	879.170	2.250.191	0,31
JBS SA	BRL	2.223.700	8.051.481	1,10
Klabin SA	BRL	98.800	523.071	0,07
Kroton Educacional SA	BRL	365.900	1.687.280	0,23
Natura Cosmeticos SA	BRL	208.700	1.994.100	0,27
Petroleo Brasileiro SA	BRL	701.600	2.924.502	0,40
Porto Seguro SA	BRL	110.100	1.008.976	0,14
Raia Drogash SA	BRL	9.300	187.104	0,02
Ultrapar Participacoes SA	BRL	14.100	307.965	0,04
Vale SA	BRL	169.400	802.001	0,11
Total Brasilien			52.598.365	7,19
Chile				
Banco de Chile - ADR	USD	20.923	1.421.299	0,19
Banco Santander Chile - ADR	USD	172.028	3.564.420	0,49
Cencosud SA	CLP	877.544	2.659.220	0,36
Cia Cervecerias Unidas SA - ADR	USD	31.422	639.124	0,09
Empresa Nacional de Electricidad SA/Chile - ADR	USD	8.854	180.445	0,03
Enerjis Chile SA - ADR	USD	113.856	535.123	0,07
Latam Airlines Group SA - ADR	USD	156.113	1.267.638	0,17
Total Chile			10.267.269	1,40
China				
58.com Inc - ADR	USD	12.354	592.992	0,08
Agricultural Bank of China Ltd - H Shares	HKD	882.000	379.564	0,05
Alibaba Group Holding Ltd - ADR	USD	158.800	16.861.384	2,31
Baidu Inc - ADR	USD	42.918	7.837.256	1,07
Bank of China Ltd - H Shares	HKD	5.584.000	2.568.172	0,35
Bank of Communications Co Ltd - H Shares	HKD	2.657.000	2.035.429	0,28
Beijing Enterprises Holdings Ltd	HKD	388.000	1.972.564	0,27
Bell International Holdings Ltd	HKD	3.652.000	2.517.047	0,34
China Cinda Asset Management Co Ltd - H Shares	HKD	6.163.000	2.188.825	0,30
China CITIC Bank Corp Ltd - H Shares	HKD	4.949.000	3.301.682	0,45
China Communications Services Corp Ltd - H Shares	HKD	2.352.000	1.475.284	0,20
China Construction Bank Corp - H Shares	HKD	15.260.000	11.409.071	1,56
China Everbright International Ltd	HKD	356.000	425.360	0,06
China Evergrande Group	HKD	1.660.000	1.126.291	0,15
China Galaxy Securities Co Ltd - H Shares	HKD	3.695.000	3.385.653	0,46
China Merchants Port Holdings Co Ltd	HKD	164.000	438.893	0,06
China Mobile Ltd	HKD	1.320.000	16.124.360	2,20
China Overseas Land & Investment Ltd	HKD	1.272.000	4.340.508	0,59
China Petroleum & Chemical Corp - H Shares	HKD	3.976.000	2.920.495	0,40
China Resources Land Ltd	HKD	904.000	2.535.741	0,35
China Shenhua Energy Co Ltd - H Shares	HKD	101.500	199.734	0,03
China Taiping Insurance Holdings Co Ltd	HKD	493.200	978.669	0,13
China Telecom Corp Ltd - H Shares	HKD	1.130.000	573.885	0,08
China Vanke Co Ltd - H Shares	HKD	415.500	1.082.957	0,15
Chongqing Rural Commercial Bank Co Ltd - H Shares	HKD	3.010.000	1.862.159	0,25
CNOOC Ltd	HKD	2.866.000	3.598.258	0,49
Country Garden Holdings Co Ltd	HKD	919.000	486.871	0,07
Ctrip.com International Ltd - ADR	USD	54.371	2.529.883	0,35
Far East Horizon Ltd	HKD	470.000	446.453	0,06
Geely Automobile Holdings Ltd	HKD	5.860.000	5.258.534	0,72
GOME Electrical Appliances Holding Ltd	HKD	19.729.000	2.428.708	0,33
Great Wall Motor Co Ltd - H Shares	HKD	7.268.000	7.116.954	0,97
Industrial & Commercial Bank of China Ltd - H Shares	HKD	11.644.000	7.344.902	1,00
JD.com Inc - ADR	USD	111.761	2.920.315	0,40
Longfor Properties Co Ltd	HKD	453.500	699.150	0,10
NetEase Inc - ADR	USD	12.373	2.999.586	0,41
New Oriental Education & Technology Group Inc - ADR	USD	21.458	997.797	0,14
PetroChina Co Ltd - H Shares	HKD	3.808.000	2.509.128	0,34
PICC Property & Casualty Co Ltd - H Shares	HKD	1.574.000	2.626.207	0,36
Sinopec Engineering Group Co Ltd - H Shares	HKD	657.500	567.261	0,08
Sinopec Shanghai Petrochemical Co Ltd - H Shares	HKD	7.008.000	3.546.743	0,49
Sinopharm Group Co Ltd - H Shares	HKD	834.000	4.023.802	0,55
Sinotrans Ltd - H Shares	HKD	3.854.000	1.878.441	0,26
Tencent Holdings Ltd	HKD	610.400	16.908.797	2,31
The People's Insurance Co Group of China Ltd - H Shares	HKD	12.623.000	5.170.936	0,71
Vipshop Holdings Ltd - ADR	USD	65.264	977.655	0,13
Weichai Power Co Ltd - H Shares	HKD	1.257.000	1.691.998	0,23
Zhuhou CRRC Times Electric Co Ltd	HKD	45.000	234.543	0,03
Zijin Mining Group Co Ltd - H Shares	HKD	7.162.000	2.301.411	0,32
Total China			168.398.308	23,02
Hongkong				
Nine Dragons Paper Holdings Ltd	HKD	3.600.000	3.381.606	0,46
Sino Biopharmaceutical Ltd	HKD	2.128.000	1.434.232	0,20
Total Hongkong			4.815.838	0,66
Ungarn				
OTP Bank PLC	HUF	31.456	826.105	0,11
Richter Gedeon Nyrt	HUF	30.433	616.528	0,09
Total Ungarn			1.442.633	0,20

AQR UCITS FUNDS

AQR Emerging Equities UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Indien				
Axis Bank Ltd - ADR	USD	16.747	677.416	0,09
Dr Reddy's Laboratories Ltd - ADR	USD	208.185	9.641.047	1,32
ICICI Bank Ltd - ADR	USD	348.934	2.634.452	0,36
Infosys Ltd - ADR	USD	1.077.332	17.086.486	2,34
Reliance Industries Ltd - ADR	USD	101.955	3.349.222	0,46
State Bank of India - ADR	USD	80.340	2.988.648	0,41
Tata Motors Ltd - ADR	USD	215.902	8.664.147	1,18
Wipro Ltd - ADR	USD	529.791	5.160.164	0,70
Total Indien			50.201.582	6,86
Indonesien				
Bank Central Asia Tbk PT	IDR	2.687.100	3.237.014	0,44
Bank Mandiri Persero Tbk PT	IDR	263.900	227.020	0,03
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	IDR	3.351.300	1.428.177	0,19
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	IDR	2.778.500	2.603.638	0,36
Gudang Garam Tbk PT	IDR	364.100	1.730.955	0,24
Indofood CBP Sukses Makmur Tbk PT	IDR	637.400	463.298	0,06
Indofood Sukses Makmur Tbk PT	IDR	2.587.800	1.728.845	0,24
Matahari Department Store Tbk PT	IDR	1.192.900	1.690.808	0,23
Semen Indonesia Persero Tbk PT	IDR	1.014.700	786.757	0,11
Telekomunikasi Indonesia Persero Tbk PT	IDR	13.303.300	4.418.610	0,60
Unilever Indonesia Tbk PT	IDR	196.800	672.293	0,09
United Tractors Tbk PT	IDR	1.647.500	2.236.745	0,31
Total Indonesien			21.224.160	2,90
Malaysia				
AirAsia Bhd	MYR	6.841.600	4.618.794	0,63
AMMB Holdings Bhd	MYR	214.700	212.409	0,03
Axiata Group Bhd	MYR	263.400	332.572	0,05
British American Tobacco Malaysia Bhd	MYR	37.000	439.711	0,06
Genting Bhd	MYR	568.600	1.091.048	0,15
Genting Malaysia Bhd	MYR	506.200	557.303	0,08
Hong Leong Bank Bhd	MYR	100.100	317.879	0,04
IHH Healthcare Bhd	MYR	1.075.300	1.646.319	0,22
IJM Corp Bhd	MYR	364.300	282.871	0,04
Malayan Banking Bhd	MYR	812.400	1.473.963	0,20
MISC Bhd	MYR	517.200	944.278	0,13
Petronas Chemicals Group Bhd	MYR	923.200	1.484.709	0,20
Public Bank Bhd	MYR	753.600	3.611.852	0,49
Tenaga Nasional Bhd	MYR	798.600	2.762.102	0,38
YTL Corp Bhd	MYR	1.109.700	480.441	0,07
Total Malaysia			20.256.251	2,77
Mexiko				
Alfa SAB de CV	MXN	1.074.000	1.684.001	0,23
America Movil SAB de CV - ADR	USD	27.196	312.754	0,04
Arca Continental SAB de CV	MXN	30.300	183.797	0,03
Cemex SAB de CV - ADR	USD	220.694	1.801.966	0,25
Fibra Uno Administracion SA de CV (B)	MXN	772.300	1.412.967	0,19
Fomento Economico Mexicano SAB de CV - ADR	USD	30.037	2.763.404	0,38
Gruma SAB de CV	MXN	411.420	5.363.078	0,73
Grupo Financiero Banorte SAB de CV	MXN	257.100	1.362.948	0,19
Grupo Lala SAB de CV	MXN	283.500	549.044	0,07
Grupo Mexico SAB de CV	MXN	409.400	989.981	0,14
Grupo Televisa SAB - ADR	USD	78.100	2.003.265	0,27
Industrias Penoles SAB de CV	MXN	81.060	1.992.356	0,27
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	MXN	1.177.700	2.701.069	0,37
OHL Mexico SAB de CV	MXN	990.500	1.278.163	0,17
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	MXN	494.500	1.103.331	0,15
Total Mexiko			25.502.124	3,48
Niederlande				
Steinhoff International Holdings NV	ZAR	291.015	1.670.622	0,23
Total Niederlande			1.670.622	0,23
Peru				
Credicorp Ltd	USD	10.300	1.570.853	0,21
Southern Copper Corp	USD	25.000	662.500	0,09
Total Peru			2.233.353	0,30
Philippinen				
Ayala Corp	PHP	21.210	375.323	0,05
Ayala Land Inc	PHP	568.400	461.157	0,06
BDO Unibank Inc	PHP	255.040	578.106	0,08
Globe Telecom Inc	PHP	21.525	905.785	0,12
JG Summit Holdings Inc	PHP	363.700	559.661	0,08
Jollibee Foods Corp	PHP	103.420	527.082	0,07
Metro Pacific Investments Corp	PHP	1.868.000	273.860	0,04
Metropolitan Bank & Trust Co	PHP	241.290	424.908	0,06
PLDT Inc	PHP	19.430	686.862	0,09
SM Investments Corp	PHP	17.865	248.409	0,04
SM Prime Holdings Inc	PHP	466.500	271.256	0,04
Universal Robina Corp	PHP	184.760	678.978	0,09
Total Philippinen			5.991.387	0,82
Polen				
Energa SA	PLN	254.531	497.878	0,07
Eurocash SA	PLN	242.401	2.705.375	0,37
Orange Polska SA	PLN	210.618	329.695	0,05
PGE Polska Grupa Energetyczna SA	PLN	694.951	1.848.086	0,25
Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo SA	PLN	2.869.859	3.819.652	0,52
Total Polen			9.200.686	1,26

AQR UCITS FUNDS

AQR Emerging Equities UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Rumänien				
New Europe Property Investments PLC	ZAR	67.593	762.007	0,10
Total Rumänien			762.007	0,10
Russland				
Gazprom PJSC - ADR	USD	977.806	4.145.897	0,57
Lukoil PJSC - ADR	USD	67.678	3.294.227	0,45
Novatek OJSC - ADR	USD	11.767	1.304.372	0,18
Rosneft PJSC - ADR	USD	152.970	841.335	0,12
Severstal PJSC - ADR	USD	174.205	2.118.333	0,29
Sistema PJSC FC - ADR	USD	259.343	1.932.105	0,26
Surgutneftegas OJSC - ADR	USD	244.177	1.176.811	0,16
Tatneft PJSC - ADR	USD	91.420	2.811.165	0,38
Total Russland			17.624.245	2,41
Südafrika				
Anglo American Platinum Ltd	ZAR	105.635	3.013.104	0,41
AngloGold Ashanti Ltd - ADR	USD	374.146	6.087.355	0,83
Bid Corp Ltd	ZAR	59.557	1.131.993	0,15
Exxaro Resources Ltd	ZAR	132.719	810.927	0,11
Gold Fields Ltd - ADR	USD	1.499.255	7.428.809	1,01
Growthpoint Properties Ltd (B)	ZAR	714.256	1.306.926	0,18
Hyprop Investments Ltd	ZAR	47.587	419.717	0,06
Imperial Holdings Ltd	ZAR	162.392	1.964.349	0,27
Investec Ltd	ZAR	242.509	1.479.472	0,20
Massmart Holdings Ltd	ZAR	21.732	190.133	0,03
Naspers Ltd	ZAR	29.352	5.072.442	0,69
Pick n Pay Stores Ltd	ZAR	100.223	503.329	0,07
Redefine Properties Ltd (S)	ZAR	1.289.077	1.076.643	0,15
Remgro Ltd	ZAR	64.330	1.083.708	0,15
Resilient REIT Ltd (B)	ZAR	53.537	445.980	0,06
RMB Holdings Ltd	ZAR	198.155	845.729	0,12
Sasol Ltd	ZAR	154.945	4.224.763	0,58
Sibanye Gold Ltd	ZAR	237.166	850.396	0,12
Standard Bank Group Ltd	ZAR	44.802	462.170	0,06
Telkom SA SOC Ltd	ZAR	688.188	2.971.596	0,41
The Bidvest Group Ltd	ZAR	67.037	790.944	0,11
The SPAR Group Ltd	ZAR	49.045	684.534	0,09
Truworths International Ltd	ZAR	28.694	148.947	0,02
Woolworths Holdings Ltd/South Africa	ZAR	119.918	677.378	0,09
Total Südafrika			43.671.344	5,97
Südkorea				
AMOREPACIFIC Group	KRW	4.844	729.589	0,10
CJ CheilJedang Corp	KRW	5.399	1.782.158	0,24
CJ Corp	KRW	1.167	197.538	0,03
Coway Co Ltd	KRW	4.182	362.588	0,05
DGB Financial Group Inc	KRW	31.484	258.745	0,03
Dongbu Insurance Co Ltd	KRW	19.918	1.234.322	0,17
Hana Financial Group Inc	KRW	69.807	1.770.368	0,24
Hanmi Pharm Co Ltd	KRW	2.206	1.020.650	0,14
Hanwha Chemical Corp	KRW	234.457	5.174.985	0,71
Hanwha Life Insurance Co Ltd	KRW	94.918	496.515	0,07
Hyundai Department Store Co Ltd	KRW	2.624	282.746	0,04
Hyundai Development Co-Engineering & Construction	KRW	54.761	2.559.759	0,35
Hyundai Glovis Co Ltd	KRW	5.990	985.724	0,13
Hyundai Marine & Fire Insurance Co Ltd	KRW	28.522	940.607	0,13
Hyundai Mobiis Co Ltd	KRW	9.847	2.463.560	0,34
KB Financial Group Inc	KRW	24.849	853.811	0,12
Kia Motors Corp	KRW	68.036	2.610.119	0,36
Korea Electric Power Corp	KRW	87.601	4.300.768	0,59
Korea Zinc Co Ltd	KRW	2.600	1.137.003	0,16
Korean Air Lines Co Ltd	KRW	21.577	686.237	0,09
KT&G Corp	KRW	37.164	4.222.093	0,58
LG Chem Ltd	KRW	15.478	3.405.929	0,47
LG Corp	KRW	50.874	2.996.301	0,41
LG Uplus Corp	KRW	42.325	452.032	0,06
Lotte Chemical Corp	KRW	18.461	5.013.438	0,68
POSCO	KRW	3.653	755.897	0,10
Posco Daewoo Corp	KRW	149.397	3.340.294	0,46
Samsung Electronics Co Ltd	KRW	19.022	27.651.302	3,78
Samsung Life Insurance Co Ltd	KRW	6.448	618.460	0,08
Shinhan Financial Group Co Ltd	KRW	53.536	1.955.150	0,27
Shinsegae Inc	KRW	13.727	2.265.466	0,31
SK Hynix Inc	KRW	10.695	392.169	0,05
SK Innovation Co Ltd	KRW	61.833	9.109.197	1,24
SK Networks Co Ltd	KRW	395.578	2.409.619	0,33
SK Telecom Co Ltd	KRW	12.736	2.607.387	0,36
Woori Bank	KRW	240.678	2.497.935	0,34
Total Südkorea			99.540.461	13,61
Taiwan				
Cathay Financial Holding Co Ltd	TWD	1.498.000	1.922.157	0,26
China Airlines Ltd	TWD	2.327.000	694.947	0,10
China Development Financial Holding Corp	TWD	2.194.000	560.978	0,08
China Life Insurance Co Ltd/Taiwan	TWD	4.243.751	3.890.574	0,53
Chunghwa Telecom Co Ltd	TWD	111.000	391.592	0,05
Compal Electronics Inc	TWD	4.086.097	2.527.669	0,35
CTBC Financial Holding Co Ltd	TWD	2.785.118	1.620.971	0,22
E.Sun Financial Holding Co Ltd	TWD	1.899.700	1.084.002	0,15
Eva Airways Corp	TWD	870.450	397.737	0,05
Far EasTone Telecommunications Co Ltd	TWD	125.000	295.364	0,04

AQR UCITS FUNDS

AQR Emerging Equities UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Taiwan (Fortsetzung)				
First Financial Holding Co Ltd	TWD	2.066.064	1.099.077	0,15
Formosa Petrochemical Corp	TWD	67.000	201.720	0,03
Foxconn Technology Co Ltd	TWD	931.379	2.735.093	0,37
Fubon Financial Holding Co Ltd	TWD	5.621.000	8.331.150	1,14
Hon Hai Precision Industry Co Ltd	TWD	3.069.605	7.753.916	1,06
Hua Nan Financial Holdings Co Ltd	TWD	694.683	356.213	0,05
Innolux Corp	TWD	6.510.000	2.208.251	0,30
Intera Memories Inc	TWD	394.000	347.442	0,05
Inventec Corp	TWD	965.000	790.644	0,11
Lite-On Technology Corp	TWD	429.131	618.939	0,09
MediaTek Inc	TWD	488.000	3.738.981	0,51
Mega Financial Holding Co Ltd	TWD	2.297.000	1.618.115	0,22
Novatek Microelectronics Corp	TWD	267.000	943.976	0,13
Pegatron Corp	TWD	462.000	1.192.493	0,16
Pou Chen Corp	TWD	3.238.000	4.567.127	0,62
Powertech Technology Inc	TWD	2.001.555	5.203.106	0,71
President Chain Store Corp	TWD	27.000	214.758	0,03
Realtek Semiconductor Corp	TWD	176.000	585.704	0,08
SinoPac Financial Holdings Co Ltd	TWD	1.091.517	322.640	0,04
Taiwan Cooperative Financial Holding Co Ltd	TWD	434.420	192.174	0,03
Taiwan Fertilizer Co Ltd	TWD	388.000	520.439	0,07
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd - ADR	USD	615.075	18.698.280	2,56
Teco Electric and Machinery Co Ltd	TWD	228.000	196.898	0,03
Uni-President Enterprises Corp	TWD	1.064.000	1.998.978	0,27
Wistron Corp	TWD	1.546.929	1.152.911	0,16
Zhen Ding Technology Holding Ltd	TWD	438.000	963.746	0,13
Total Taiwan			81.990.989	11,21
Thailand				
Bangkok Bank PCL - ADR	THB	341.400	1.603.073	0,22
Home Product Center PCL - ADR	THB	2.112.900	610.408	0,08
Kasikornbank PCL - ADR	THB	62.500	338.668	0,05
Krung Thai Bank PCL - ADR	THB	2.262.300	1.150.655	0,16
PTT Exploration & Production PCL - ADR	THB	1.012.200	2.371.185	0,32
PTT Global Chemical PCL - ADR	THB	1.964.200	3.337.313	0,46
Thai Oil PCL - ADR	THB	1.453.600	2.876.787	0,39
Thai Union Group PCL - ADR	THB	8.262.700	5.107.135	0,70
The Siam Commercial Bank PCL - ADR	THB	74.100	317.050	0,04
Total Thailand			17.712.274	2,42
Türkei				
Akbank TAS	TRY	261.937	700.744	0,10
Arcelik AS	TRY	449.202	3.190.627	0,44
BIM Birlesik Magazalar AS	TRY	40.577	677.951	0,09
Eregli Demir ve Çelik Fabrikaları TAS	TRY	1.304.694	1.803.865	0,25
Haci Omer Sabanci Holding AS	TRY	311.116	963.945	0,13
Petkim Petrokimya Holding AS	TRY	600.988	896.997	0,12
TAV Havalimanları Holding AS	TRY	140.529	579.607	0,08
Tofas Türk Otomobil Fabrikası AS	TRY	123.739	901.164	0,12
Türkiyemspi Halk Bankası AS	TRY	107.311	325.337	0,04
Yapi ve Kredi Bankası AS	TRY	166.468	202.428	0,03
Total Türkei			10.242.665	1,40
Vereinigte Staaten				
Mobile TeleSystems PJSC - ADR	USD	456.156	3.494.155	0,48
Total Vereinigte Staaten			3.494.155	0,48
Total Stammaktien				
Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Total Anlagen (Gesamtkosten: \$617.444.538)			648.840.718	88,69
Sonstige Vermögenswerte/(Verbindlichkeiten)				
NETTOVERMÖGEN			82.761.967	11,31
			731.602.685	100,00

(B) Immobilienfonds
ADR-American Depository Receipt

Derivate
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Börsengehandelte Futures

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	% des Nettovermögens
FTSE KLCI Futures	Barclays Capital Inc.	MYR	(1.832.712)	22	31/10/2016	(3.219)	(0,00)
FTSE KLCI Futures	Barclays Capital Inc.	MYR	(250.452)	3	31/10/2016	(569)	(0,00)
FTSE KLCI Futures	Barclays Capital Inc.	MYR	(1.841.297)	22	31/10/2016	(5.295)	(0,00)
FTSE KLCI Futures	Barclays Capital Inc.	MYR	(1.836.582)	22	31/10/2016	(4.155)	(0,00)
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	39.376.652	(83)	15/12/2016	76.280	0,01
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	218.205.249	(468)	15/12/2016	153.249	0,02
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	97.531.736	(208)	15/12/2016	108.069	0,02
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	465.063	(1)	15/12/2016	241	0,00
H-Shares Index Futures	Barclays Capital Inc.	HKD	(34.541.567)	71	28/10/2016	(59.525)	(0,01)
H-Shares Index Futures	Barclays Capital Inc.	HKD	(23.808.712)	49	28/10/2016	(37.233)	(0,00)
H-Shares Index Futures	Barclays Capital Inc.	HKD	(13.581.400)	28	28/10/2016	(18.236)	(0,00)
KOSPI 200 Index Futures	Barclays Capital Inc.	KRW	(7.317.480.352)	56	08/12/2016	(79.793)	(0,01)
KOSPI 200 Index Futures	Barclays Capital Inc.	KRW	(7.293.943.552)	56	08/12/2016	(58.422)	(0,01)

AQR UCITS FUNDS

AQR Emerging Equities UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Börsengehandelte Futures (Fortsetzung)

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust) in USD	% des Nettovermögens
KOSPI 200 Index Futures	Barclays Capital Inc.	KRW	(7.355.029,556)	56	08/12/2016	(113.887)	(0,02)
MSCI Taiwan Index Futures	Barclays Capital Inc.	USD	(2.118.008)	61	28/10/2016	(33.638)	(0,00)
MSCI Taiwan Index Futures	Barclays Capital Inc.	USD	(514.239)	15	28/10/2016	(1.689)	(0,00)
SET50 Futures	Barclays Capital Inc.	THB	(40.523.183)	213	29/12/2016	(7.313)	(0,00)
SET50 Futures	Barclays Capital Inc.	THB	(2.081.048)	11	29/12/2016	(40)	(0,00)
SET50 Futures	Barclays Capital Inc.	THB	(40.307.204)	213	29/12/2016	(1.080)	(0,00)
SET50 Futures	Barclays Capital Inc.	THB	(40.092.071)	213	29/12/2016	5.129	0,00
SGX Nifty 50 Futures	Barclays Capital Inc.	USD	3.009.518	(172)	27/10/2016	33.574	0,00
SGX Nifty 50 Futures	Barclays Capital Inc.	USD	2.207.776	(126)	27/10/2016	27.724	0,00
KOSPI 200 Index Futures	J.P. Morgan Securities	KRW	(914.676.994)	7	08/12/2016	(9.967)	(0,00)
MEX BOLSA Index Futures	J.P. Morgan Securities	MXN	(4.640.232)	10	16/12/2016	6.219	0,00
Total Futures						(23.576)	(0,00)

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust) in USD	% des Nettovermögens
Citibank, N.A.	BRL	240.000	USD	72.275	21/12/2016*	(116)	(0,00)
Citibank, N.A.	BRL	840.000	USD	255.942	21/12/2016*	(3.389)	(0,00)
Citibank, N.A.	BRL	1.000.000	USD	298.241	21/12/2016*	2.418	0,00
Citibank, N.A.	BRL	2.200.000	USD	659.024	21/12/2016*	2.426	0,00
Citibank, N.A.	BRL	3.880.000	USD	1.173.986	21/12/2016*	(7.428)	(0,00)
Citibank, N.A.	BRL	4.800.000	USD	1.436.355	21/12/2016*	6.209	0,00
Citibank, N.A.	BRL	5.360.000	USD	1.593.260	21/12/2016*	18.274	0,00
Citibank, N.A.	BRL	5.560.000	USD	1.626.076	21/12/2016*	45.590	0,01
Citibank, N.A.	BRL	5.800.000	USD	1.733.309	21/12/2016*	10.514	0,00
Citibank, N.A.	BRL	5.920.000	USD	1.784.740	21/12/2016*	(4.838)	(0,00)
Citibank, N.A.	BRL	6.363.832	USD	1.868.014	21/12/2016*	45.331	0,01
Citibank, N.A.	BRL	6.720.000	USD	2.000.194	21/12/2016*	20.236	0,00
Citibank, N.A.	BRL	7.200.000	USD	2.142.632	21/12/2016*	22.114	0,00
Citibank, N.A.	BRL	7.391.132	USD	2.177.585	21/12/2016*	44.627	0,01
Citibank, N.A.	BRL	8.419.700	USD	2.512.164	21/12/2016*	19.297	0,00
Citibank, N.A.	BRL	8.528.680	USD	2.534.390	21/12/2016*	29.837	0,00
Citibank, N.A.	BRL	10.454.056	USD	3.129.500	21/12/2016*	13.609	0,00
Citibank, N.A.	BRL	10.878.079	USD	3.307.777	21/12/2016*	(37.182)	(0,01)
Citibank, N.A.	BRL	15.358.921	USD	4.565.754	21/12/2016*	52.048	0,01
Citibank, N.A.	CLP	4.000.000	USD	5.890	21/12/2016*	156	0,00
Citibank, N.A.	CLP	8.000.000	USD	12.002	21/12/2016*	.90	0,00
Citibank, N.A.	CLP	20.000.000	USD	30.027	21/12/2016*	201	0,00
Citibank, N.A.	CLP	24.000.000	USD	35.463	21/12/2016*	810	0,00
Citibank, N.A.	CLP	24.000.000	USD	35.442	21/12/2016*	831	0,00
Citibank, N.A.	CLP	28.000.000	USD	41.990	21/12/2016*	329	0,00
Citibank, N.A.	CLP	36.000.000	USD	53.258	21/12/2016*	1.153	0,00
Citibank, N.A.	CLP	40.000.000	USD	59.657	21/12/2016*	799	0,00
Citibank, N.A.	CLP	64.000.000	USD	94.463	21/12/2016*	2.267	0,00
Citibank, N.A.	CLP	100.000.000	USD	150.990	21/12/2016*	152	0,00
Citibank, N.A.	COP	100.000.000	USD	33.921	21/12/2016*	426	0,00
Citibank, N.A.	COP	1.120.000.000	USD	375.177	21/12/2016*	9.512	0,00
Citibank, N.A.	COP	4.119.455.664	USD	1.415.577	21/12/2016*	(659)	(0,00)
Citibank, N.A.	COP	4.205.160.077	USD	1.452.941	21/12/2016*	(8.587)	(0,00)
Citibank, N.A.	COP	6.596.323.401	USD	2.199.314	21/12/2016*	66.339	0,01
Citibank, N.A.	COP	7.159.060.858	USD	2.425.043	21/12/2016*	33.894	0,00
Citibank, N.A.	HKD	1.200.000	USD	154.781	21/12/2016	.97	0,00
Citibank, N.A.	HKD	2.000.000	USD	258.196	21/12/2016	(65)	(0,00)
Citibank, N.A.	HKD	3.200.000	USD	412.973	21/12/2016	37	0,00
Citibank, N.A.	HKD	4.000.000	USD	516.218	21/12/2016	44	0,00
Citibank, N.A.	HKD	5.200.000	USD	670.950	21/12/2016	191	0,00
Citibank, N.A.	HKD	6.000.000	USD	774.306	21/12/2016	87	0,00
Citibank, N.A.	HKD	7.600.000	USD	980.747	21/12/2016	151	0,00
Citibank, N.A.	HKD	9.200.000	USD	1.186.739	21/12/2016	664	0,00
Citibank, N.A.	HKD	17.220.000	USD	2.220.101	21/12/2016	(174)	(0,00)
Citibank, N.A.	HKD	66.358.000	USD	8.564.510	21/12/2016	20	0,00
Citibank, N.A.	HUF	1.110.659	USD	4.072	21/12/2016	(51)	(0,00)
Citibank, N.A.	HUF	1.888.682	USD	6.828	21/12/2016	10	0,00
Citibank, N.A.	HUF	2.382.259	USD	8.593	21/12/2016	33	0,00
Citibank, N.A.	HUF	2.618.400	USD	9.470	21/12/2016	10	0,00
Citibank, N.A.	IDR	104.235.564	USD	7.733	21/12/2016*	182	0,00
Citibank, N.A.	IDR	112.707.790	USD	8.499	21/12/2016*	60	0,00
Citibank, N.A.	IDR	156.755.846	USD	11.616	21/12/2016*	288	0,00
Citibank, N.A.	IDR	1.000.000.000	USD	75.160	21/12/2016*	780	0,00
Citibank, N.A.	IDR	5.200.000.000	USD	392.751	21/12/2016*	2.139	0,00
Citibank, N.A.	IDR	10.800.000.000	USD	816.515	21/12/2016*	3.640	0,00
Citibank, N.A.	INR	24.400.000	USD	359.990	21/12/2016*	2.217	0,00
Citibank, N.A.	INR	34.800.000	USD	513.268	21/12/2016*	3.321	0,00
Citibank, N.A.	INR	54.400.000	USD	803.074	21/12/2016*	4.469	0,00
Citibank, N.A.	INR	94.000.000	USD	1.383.131	21/12/2016*	12.255	0,00
Citibank, N.A.	INR	114.400.000	USD	1.701.580	21/12/2016*	(3.365)	(0,00)
Citibank, N.A.	INR	151.200.000	USD	2.243.580	21/12/2016*	913	0,00
Citibank, N.A.	KRW	40.000.000	USD	36.274	21/12/2016*	28	0,00
Citibank, N.A.	KRW	40.000.000	USD	36.590	21/12/2016*	(288)	(0,00)
Citibank, N.A.	KRW	200.000.000	USD	179.986	21/12/2016*	1.522	0,00
Citibank, N.A.	KRW	440.000.000	USD	395.754	21/12/2016*	3.563	0,00
Citibank, N.A.	KRW	695.077.736	USD	634.678	21/12/2016*	(3.868)	(0,00)
Citibank, N.A.	KRW	757.274.493	USD	673.836	21/12/2016*	13.420	0,00
Citibank, N.A.	KRW	760.000.000	USD	680.699	21/12/2016*	9.030	0,00
Citibank, N.A.	KRW	920.000.000	USD	835.687	21/12/2016*	(751)	(0,00)
Citibank, N.A.	KRW	974.742.834	USD	877.557	21/12/2016*	7.060	0,00
Citibank, N.A.	KRW	1.002.036.885	USD	915.315	21/12/2016*	(5.927)	(0,00)
Citibank, N.A.	KRW	1.303.269.438	USD	1.164.054	21/12/2016*	18.714	0,00
Citibank, N.A.	KRW	2.160.000.000	USD	1.927.804	21/12/2016*	32.481	0,00
Citibank, N.A.	MXN	1.600.000	USD	81.534	21/12/2016	159	0,00
Citibank, N.A.	MXN	1.600.000	USD	82.595	21/12/2016	(902)	(0,00)
Citibank, N.A.	MXN	2.000.000	USD	103.782	21/12/2016	(1.666)	(0,00)
Citibank, N.A.	MXN	2.400.000	USD	119.722	21/12/2016	2.817	0,00
Citibank, N.A.	MYR	40.000	USD	9.705	21/12/2016*	(70)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Emerging Equities UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust) in USD	% des Nettovermögens
Citibank, N.A.	MYR	80.000	USD	19.296	21/12/2016*	(26)	(0,00)
Citibank, N.A.	MYR	80.000	USD	19.316	21/12/2016*	(46)	(0,00)
Citibank, N.A.	MYR	120.000	USD	29.095	21/12/2016*	(189)	(0,00)
Citibank, N.A.	MYR	120.000	USD	28.909	21/12/2016*	(4)	(0,00)
Citibank, N.A.	MYR	120.000	USD	28.895	21/12/2016*	10	0,00
Citibank, N.A.	MYR	240.000	USD	57.832	21/12/2016*	(21)	(0,00)
Citibank, N.A.	MYR	240.000	USD	57.866	21/12/2016*	(56)	(0,00)
Citibank, N.A.	MYR	300.000	USD	72.385	21/12/2016*	(122)	(0,00)
Citibank, N.A.	PEN	100.000	USD	29.210	21/12/2016*	(36)	(0,00)
Citibank, N.A.	PEN	100.000	USD	29.308	21/12/2016*	(135)	(0,00)
Citibank, N.A.	PEN	100.000	USD	29.603	21/12/2016*	(430)	(0,00)
Citibank, N.A.	PEN	100.000	USD	29.395	21/12/2016*	(221)	(0,00)
Citibank, N.A.	PEN	740.399	USD	217.158	21/12/2016*	(1.158)	(0,00)
Citibank, N.A.	PHP	400.000	USD	8.311	21/12/2016*	(112)	(0,00)
Citibank, N.A.	PHP	400.000	USD	8.608	21/12/2016*	(409)	(0,00)
Citibank, N.A.	PHP	800.000	USD	16.420	21/12/2016*	(23)	(0,00)
Citibank, N.A.	PHP	1.000.000	USD	21.464	21/12/2016*	(967)	(0,00)
Citibank, N.A.	PHP	1.200.000	USD	25.669	21/12/2016*	(1.072)	(0,00)
Citibank, N.A.	PHP	1.200.000	USD	25.036	21/12/2016*	(440)	(0,00)
Citibank, N.A.	PHP	1.600.000	USD	32.929	21/12/2016*	(134)	(0,00)
Citibank, N.A.	PHP	1.600.000	USD	33.123	21/12/2016*	(328)	(0,00)
Citibank, N.A.	PHP	2.000.000	USD	42.612	21/12/2016*	(1.619)	(0,00)
Citibank, N.A.	PHP	2.800.000	USD	59.919	21/12/2016*	(2.528)	(0,00)
Citibank, N.A.	PLN	40.000	USD	10.413	21/12/2016	(10)	(0,00)
Citibank, N.A.	PLN	40.000	USD	10.327	21/12/2016	76	0,00
Citibank, N.A.	PLN	40.000	USD	10.361	21/12/2016	42	0,00
Citibank, N.A.	PLN	120.000	USD	31.309	21/12/2016	(99)	(0,00)
Citibank, N.A.	PLN	120.000	USD	31.280	21/12/2016	(71)	(0,00)
Citibank, N.A.	PLN	120.000	USD	31.200	21/12/2016	9	0,00
Citibank, N.A.	PLN	120.000	USD	31.428	21/12/2016	(219)	(0,00)
Citibank, N.A.	PLN	160.000	USD	41.214	21/12/2016	398	0,00
Citibank, N.A.	PLN	200.000	USD	51.353	21/12/2016	662	0,00
Citibank, N.A.	PLN	400.000	USD	103.013	21/12/2016	1.018	0,00
Citibank, N.A.	RUB	9.000.000	USD	135.804	21/12/2016*	4.009	0,00
Citibank, N.A.	RUB	28.000.000	USD	419.163	21/12/2016*	15.812	0,00
Citibank, N.A.	RUB	66.400.000	USD	991.789	21/12/2016*	39.724	0,01
Citibank, N.A.	RUB	111.200.000	USD	1.669.122	21/12/2016*	58.351	0,01
Citibank, N.A.	RUB	148.800.000	USD	2.236.609	21/12/2016*	74.972	0,01
Citibank, N.A.	RUB	284.000.000	USD	4.258.058	21/12/2016*	153.831	0,02
Citibank, N.A.	THB	1.000.000	USD	28.715	21/12/2016	(128)	(0,00)
Citibank, N.A.	THB	1.000.000	USD	28.592	21/12/2016	251	0,00
Citibank, N.A.	THB	1.000.000	USD	28.927	21/12/2016	(64)	(0,00)
Citibank, N.A.	THB	2.000.000	USD	57.850	21/12/2016	(164)	(0,00)
Citibank, N.A.	THB	2.000.000	USD	57.715	21/12/2016	(29)	(0,00)
Citibank, N.A.	THB	3.000.000	USD	86.674	21/12/2016	(144)	(0,00)
Citibank, N.A.	THB	5.000.000	USD	142.972	21/12/2016	1.245	0,00
Citibank, N.A.	THB	6.000.000	USD	172.567	21/12/2016	493	0,00
Citibank, N.A.	THB	7.000.000	USD	202.327	21/12/2016	(424)	(0,00)
Citibank, N.A.	THB	7.000.000	USD	200.184	21/12/2016	1.719	0,00
Citibank, N.A.	THB	9.000.000	USD	259.728	21/12/2016	(139)	(0,00)
Citibank, N.A.	TRY	40.000	USD	13.199	21/12/2016	(80)	(0,00)
Citibank, N.A.	TRY	200.000	USD	65.943	21/12/2016	(346)	(0,00)
Citibank, N.A.	TRY	240.000	USD	79.610	21/12/2016	(893)	(0,00)
Citibank, N.A.	TRY	240.000	USD	79.015	21/12/2016	(299)	(0,00)
Citibank, N.A.	TRY	440.000	USD	145.325	21/12/2016	(1.011)	(0,00)
Citibank, N.A.	TRY	700.000	USD	231.161	21/12/2016	(1.571)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	230.302	BRL	760.000	21/12/2016*	1.801	0,00
Citibank, N.A.	USD	294.420	BRL	1.000.000	21/12/2016*	(6.240)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	508.423	BRL	1.720.000	21/12/2016*	(8.711)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	712.451	BRL	2.360.000	21/12/2016*	2.895	0,00
Citibank, N.A.	USD	964.865	BRL	3.200.000	21/12/2016*	2.756	0,00
Citibank, N.A.	USD	1.119.040	BRL	3.840.000	21/12/2016*	(35.492)	(0,01)
Citibank, N.A.	USD	1.810.557	BRL	6.120.000	21/12/2016*	(29.478)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	17.535	CLP	12.000.000	21/12/2016*	(602)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	36.281	CLP	24.000.000	21/12/2016*	7	0,00
Citibank, N.A.	USD	84.264	CLP	56.000.000	21/12/2016*	(375)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	88.125	CLP	60.000.000	21/12/2016*	(2.560)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	88.235	CLP	60.000.000	21/12/2016*	(2.450)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	368.699	CLP	248.000.000	21/12/2016*	(6.131)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	389.621	CLP	264.000.000	21/12/2016*	(9.391)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	436.761	CLP	292.000.000	21/12/2016*	(4.571)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	558.846	CLP	380.000.000	21/12/2016*	(15.490)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.796.887	CLP	1.222.336.800	21/12/2016*	(50.567)	(0,01)
Citibank, N.A.	USD	101.095	COP	300.000.000	21/12/2016*	(1.947)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	328.247	COP	1.000.000.000	21/12/2016*	(15.225)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	397.508	COP	1.160.000.000	21/12/2016*	(919)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	458.796	COP	1.360.000.000	21/12/2016*	(8.326)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	511.909	COP	1.480.000.000	21/12/2016*	3.571	0,00
Citibank, N.A.	USD	772.355	COP	2.280.000.000	21/12/2016*	(10.761)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	972.422	COP	2.800.000.000	21/12/2016*	10.700	0,00
Citibank, N.A.	USD	982.480	COP	2.960.000.000	21/12/2016*	(34.197)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.379.782	COP	4.120.000.000	21/12/2016*	(35.323)	(0,01)
Citibank, N.A.	USD	2.394.404	COP	7.200.000.000	21/12/2016*	(78.594)	(0,01)
Citibank, N.A.	USD	361.215	HKD	2.800.000	21/12/2016	(168)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	361.363	HKD	2.800.000	21/12/2016	(21)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	412.988	HKD	3.200.000	21/12/2016	(22)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	464.641	HKD	3.600.000	21/12/2016	5	0,00
Citibank, N.A.	USD	464.705	HKD	3.600.000	21/12/2016	69	0,00
Citibank, N.A.	USD	619.201	HKD	4.800.000	21/12/2016	(314)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	671.128	HKD	5.200.000	21/12/2016	(13)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	722.302	HKD	5.600.000	21/12/2016	(465)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	929.038	HKD	7.200.000	21/12/2016	(233)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	107.174	INR	7.200.000	21/12/2016*	294	0,00
Citibank, N.A.	USD	390.762	INR	26.400.000	21/12/2016*	(1.133)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	893.882	KRW	1.000.000.000	21/12/2016*	(13.657)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	925.125	KRW	1.040.000.000	21/12/2016*	(18.716)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.143.877	KRW	1.280.000.000	21/12/2016*	(17.772)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	3.409.745	KRW	3.800.000.000	21/12/2016*	(38.903)	(0,01)
Citibank, N.A.	USD	5.787.510	KRW	6.480.000.000	21/12/2016*	(93.342)	(0,01)
Citibank, N.A.	USD	20.157	MXN	400.000	21/12/2016	(266)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	99.980	MXN	2.000.000	21/12/2016	(2.136)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	124.143	MXN	2.400.000	21/12/2016	1.604	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Emerging Equities UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust) in USD	% des Nettovermögens
Citibank, N.A.	USD	161.861	MXN	3.200.000	21/12/2016	(1.525) (2.903)	(0,00) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	180.906	MXN	3.600.000	21/12/2016	541	0,00
Citibank, N.A.	USD	245.620	MXN	4.800.000	21/12/2016	141.747	0,02
Citibank, N.A.	USD	4.729.599	MXN	89.855.631	21/12/2016	126.440	0,02
Citibank, N.A.	USD	4.771.617	MXN	90.978.369	21/12/2016	63	0,00
Citibank, N.A.	USD	9.698	MYR	40.000	21/12/2016*	1.252	0,00
Citibank, N.A.	USD	242.130	MYR	1.000.000	21/12/2016*	56.047	0,01
Citibank, N.A.	USD	1.621.750	MYR	6.500.000	21/12/2016*	39.203	0,01
Citibank, N.A.	USD	2.245.640	MYR	9.160.000	21/12/2016*	114.882	0,02
Citibank, N.A.	USD	4.974.535	MYR	20.174.800	21/12/2016*	(197)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	28.977	PEN	100.000	21/12/2016*	66	0,00
Citibank, N.A.	USD	29.240	PEN	100.000	21/12/2016*	173	0,00
Citibank, N.A.	USD	29.347	PEN	100.000	21/12/2016*	186	0,00
Citibank, N.A.	USD	29.360	PEN	100.000	21/12/2016*	238	0,00
Citibank, N.A.	USD	29.412	PEN	100.000	21/12/2016*	251	0,00
Citibank, N.A.	USD	29.425	PEN	100.000	21/12/2016*	3	0,00
Citibank, N.A.	USD	8.202	PHP	400.000	21/12/2016*	108	0,00
Citibank, N.A.	USD	8.307	PHP	400.000	21/12/2016*	315	0,00
Citibank, N.A.	USD	24.911	PHP	1.200.000	21/12/2016*	342	0,00
Citibank, N.A.	USD	24.938	PHP	1.200.000	21/12/2016*	41.541	0,01
Citibank, N.A.	USD	999.446	PHP	46.734.254	21/12/2016*	46.824	0,01
Citibank, N.A.	USD	1.034.692	PHP	48.196.146	21/12/2016*	(77)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	10.326	PLN	40.000	21/12/2016	(3.577)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	166.409	PLN	653.597	21/12/2016	(3.876)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	289.382	PLN	1.127.582	21/12/2016	(39)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	304.946	PLN	1.172.676	21/12/2016	(5.241)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	348.445	PLN	1.353.872	21/12/2016	(1.818)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	409.629	PLN	1.595.183	21/12/2016	3.968	0,00
Citibank, N.A.	USD	585.279	PLN	2.257.402	21/12/2016	117	0,00
Citibank, N.A.	USD	1.259.954	PLN	4.829.288	21/12/2016	140	0,00
Citibank, N.A.	USD	86.646	THB	3.000.000	21/12/2016	(863)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	86.670	THB	3.000.000	21/12/2016	(134)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	173.378	THB	6.000.000	21/12/2016	23	0,00
Citibank, N.A.	USD	228.436	THB	8.000.000	21/12/2016	318	0,00
Citibank, N.A.	USD	574.930	THB	19.962.800	21/12/2016	(2.310)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	13.206	TRY	40.000	21/12/2016	(862)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	26.277	TRY	80.000	21/12/2016	87	0,00
Citibank, N.A.	USD	26.646	TRY	80.000	21/12/2016	38	0,00
Citibank, N.A.	USD	26.699	TRY	80.000	21/12/2016	408	0,00
Citibank, N.A.	USD	39.654	TRY	120.000	21/12/2016	295	0,00
Citibank, N.A.	USD	40.099	TRY	120.000	21/12/2016	741	0,00
Citibank, N.A.	USD	66.021	TRY	200.000	21/12/2016	424	0,00
Citibank, N.A.	USD	93.302	TRY	280.000	21/12/2016	1.466	0,00
Citibank, N.A.	USD	104.431	TRY	316.334	21/12/2016	678	0,00
Citibank, N.A.	USD	217.744	TRY	659.028	21/12/2016	1.592	0,00
Citibank, N.A.	USD	619.380	TRY	1.861.611	21/12/2016	8.798	0,00
Citibank, N.A.	USD	707.681	TRY	2.119.532	21/12/2016	12.504	0,00
Citibank, N.A.	USD	897.253	TRY	2.695.381	21/12/2016	13.205	0,00
Citibank, N.A.	USD	1.166.003	TRY	3.525.314	21/12/2016	9.749	0,00
Citibank, N.A.	USD	412.043	TWD	13.000.000	21/12/2016*	(4.778)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	711.560	TWD	22.400.000	21/12/2016*	(6.654)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.049.301	TWD	33.200.000	21/12/2016*	(15.195)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.307.560	TWD	41.170.000	21/12/2016*	(12.478)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	2.148.491	TWD	68.000.000	21/12/2016*	(31.801)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	81.591	ZAR	1.200.000	21/12/2016	(4.030)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	87.424	ZAR	1.200.000	21/12/2016	1.803	0,00
Citibank, N.A.	USD	672.910	ZAR	9.600.000	21/12/2016	(12.059)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.199.069	ZAR	17.600.000	21/12/2016	(56.707)	(0,01)
Citibank, N.A.	USD	1.972.992	ZAR	29.200.000	21/12/2016	(110.454)	(0,02)
Citibank, N.A.	USD	3.169.916	ZAR	45.200.000	21/12/2016	(55.145)	(0,01)
Citibank, N.A.	ZAR	2.800.000	USD	193.843	21/12/2016	5.939	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	8.400.000	USD	605.954	21/12/2016	(6.606)	(0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	11.600.000	USD	824.863	21/12/2016	2.808	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	12.400.000	USD	900.728	21/12/2016	(15.976)	(0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	20.528.841	USD	1.440.525	21/12/2016	24.227	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	27.913.756	USD	1.964.547	21/12/2016	27.124	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	29.809.278	USD	2.055.324	21/12/2016	71.595	0,01
Citibank, N.A.	ZAR	47.166.911	USD	3.192.712	21/12/2016	172.690	0,02
Citibank, N.A.	ZAR	68.438.414	USD	4.709.412	21/12/2016	173.731	0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	360.000	USD	108.412	21/12/2016*	(175)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	1.260.000	USD	383.914	21/12/2016*	(5.084)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	1.500.000	USD	447.363	21/12/2016*	3.626	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	3.300.000	USD	988.538	21/12/2016*	3.638	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	5.820.000	USD	1.760.982	21/12/2016*	(11.145)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	7.200.000	USD	2.155.436	21/12/2016*	9.311	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	8.040.000	USD	2.389.893	21/12/2016*	27.407	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	8.340.000	USD	2.439.117	21/12/2016*	68.381	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	8.700.000	USD	2.599.967	21/12/2016*	15.768	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	8.880.000	USD	2.677.114	21/12/2016*	(7.260)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	9.545.750	USD	2.802.025	21/12/2016*	67.993	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	10.080.000	USD	3.000.295	21/12/2016*	30.351	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	10.800.000	USD	3.213.953	21/12/2016*	33.167	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	11.086.696	USD	3.266.381	21/12/2016*	66.936	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	12.629.551	USD	3.768.251	21/12/2016*	28.941	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	12.793.019	USD	3.801.589	21/12/2016*	44.750	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	15.681.084	USD	4.694.256	21/12/2016*	20.407	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	16.317.119	USD	4.961.672	21/12/2016*	(55.779)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	23.038.381	USD	6.848.639	21/12/2016*	78.063	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	6.000.000	USD	8.835	21/12/2016*	234	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	12.000.000	USD	18.002	21/12/2016*	135	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	30.000.000	USD	45.041	21/12/2016*	301	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	36.000.000	USD	53.195	21/12/2016*	1.216	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	36.000.000	USD	53.164	21/12/2016*	1.247	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	42.000.000	USD	62.985	21/12/2016*	494	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	54.000.000	USD	79.887	21/12/2016*	1.729	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	96.000.000	USD	141.695	21/12/2016*	3.401	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	1.680.000.000	USD	562.766	21/12/2016*	14.267	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Emerging Equities UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust) in USD	% des Nettovermögens
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	6.179.183,495	USD	2.123.368	21/12/2016*	(992)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	6.307.740,117	USD	2.179.415	21/12/2016*	(12.883)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	9.894.485,101	USD	3.298.975	21/12/2016*	99.504	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	10.738.591,287	USD	3.637.569	21/12/2016*	50.837	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	1.800,000	USD	232.172	21/12/2016	146	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	4.800,000	USD	619.466	21/12/2016	48	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	6.000,000	USD	774.317	21/12/2016	76	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	7.800,000	USD	1.006.426	21/12/2016	285	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	9.000,000	USD	1.161.457	21/12/2016	133	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	11.400,000	USD	1.471.115	21/12/2016	232	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	13.800,000	USD	1.780.077	21/12/2016	1.028	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	25.800,000	USD	3.330.155	21/12/2016	(265)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	99.537,000	USD	12.846.780	21/12/2016	14	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	1.665.988	USD	6.108	21/12/2016	(76)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	2.833.023	USD	10.243	21/12/2016	15	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	3.573.389	USD	12.889	21/12/2016	49	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	3.927.600	USD	14.205	21/12/2016	15	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	IDR	156.353,346	USD	11.600	21/12/2016*	274	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	IDR	169.061,686	USD	12.749	21/12/2016*	90	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	IDR	235.133,768	USD	17.424	21/12/2016*	432	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	IDR	7.800.000,000	USD	589.127	21/12/2016*	3.207	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	IDR	16.200.000,000	USD	1.224.774	21/12/2016*	5.459	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	36.600,000	USD	539.985	21/12/2016*	3.325	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	52.200,000	USD	769.904	21/12/2016*	4.981	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	81.600,000	USD	1.204.612	21/12/2016*	6.702	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	141.000,000	USD	2.074.699	21/12/2016*	18.380	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	171.600,000	USD	2.552.372	21/12/2016*	(5.050)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	226.800,000	USD	3.365.375	21/12/2016*	1.366	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	60.000,000	USD	54.410	21/12/2016*	42	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	60.000,000	USD	54.885	21/12/2016*	(433)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	300.000,000	USD	269.980	21/12/2016*	2.282	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	660.000,000	USD	593.632	21/12/2016*	5.344	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.042.616,603	USD	952.018	21/12/2016*	(5.803)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.135.911,740	USD	1.010.756	21/12/2016*	20.129	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.140.000,000	USD	1.021.051	21/12/2016*	13.544	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.380.000,000	USD	1.253.532	21/12/2016*	(1.128)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.462.114,250	USD	1.316.337	21/12/2016*	10.589	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.503.055,329	USD	1.372.974	21/12/2016*	(8.892)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.954.904,155	USD	1.746.082	21/12/2016*	28.069	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	3.240.000,000	USD	2.891.709	21/12/2016*	48.717	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	MXN	2.400,000	USD	122.355	21/12/2016	184	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	MXN	2.400,000	USD	123.892	21/12/2016	(1.353)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MXN	3.000,000	USD	155.673	21/12/2016	(2.499)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MXN	3.600,000	USD	179.621	21/12/2016	4.188	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	MYR	60,000	USD	14.558	21/12/2016*	(105)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MYR	120,000	USD	28.944	21/12/2016*	(38)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MYR	120,000	USD	28.974	21/12/2016*	(69)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MYR	180,000	USD	43.642	21/12/2016*	(284)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MYR	180,000	USD	43.363	21/12/2016*	(5)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MYR	180,000	USD	43.342	21/12/2016*	16	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	MYR	360,000	USD	86.747	21/12/2016*	(32)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MYR	360,000	USD	86.800	21/12/2016*	(84)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PEN	1.110.598	USD	325.738	21/12/2016*	(1.737)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PHP	600,000	USD	12.467	21/12/2016*	(169)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PHP	600,000	USD	12.912	21/12/2016*	(614)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PHP	1.200,000	USD	24.631	21/12/2016*	(34)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PHP	1.800,000	USD	38.503	21/12/2016*	(1.609)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PHP	1.800,000	USD	37.554	21/12/2016*	(660)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PHP	2.400,000	USD	49.393	21/12/2016*	(201)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PHP	2.400,000	USD	49.684	21/12/2016*	(491)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PHP	4.200,000	USD	89.878	21/12/2016*	(3.792)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	60,000	USD	15.620	21/12/2016	(15)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	60,000	USD	15.475	21/12/2016	130	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	60,000	USD	15.541	21/12/2016	63	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	180,000	USD	46.963	21/12/2016	(149)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	180,000	USD	46.916	21/12/2016	(102)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	180,000	USD	46.800	21/12/2016	14	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	180,000	USD	47.142	21/12/2016	(328)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	240,000	USD	61.822	21/12/2016	597	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	600,000	USD	154.488	21/12/2016	1.558	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	RUB	42.000,000	USD	628.746	21/12/2016*	23.717	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	RUB	99.600,000	USD	1.487.685	21/12/2016*	59.584	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	RUB	166.800,000	USD	2.503.685	21/12/2016*	87.523	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	RUB	223.200,000	USD	3.354.918	21/12/2016*	112.454	0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	RUB	426.000,000	USD	6.387.096	21/12/2016*	230.739	0,03
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	60,000	USD	19.803	21/12/2016	(124)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	300,000	USD	98.888	21/12/2016	(492)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	360,000	USD	119.414	21/12/2016	(1.339)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	360,000	USD	118.523	21/12/2016	(449)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	660,000	USD	217.988	21/12/2016	(1.517)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	345.453	BRL	1.140.000	21/12/2016*	2.701	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	441.629	BRL	1.500.000	21/12/2016*	(9.360)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	762.633	BRL	2.580.000	21/12/2016*	(13.068)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.068.675	BRL	3.540.000	21/12/2016*	4.341	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.447.296	BRL	4.800.000	21/12/2016*	4.132	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.678.558	BRL	5.760.000	21/12/2016*	(53.239)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.715.832	BRL	9.180.000	21/12/2016*	(44.220)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	26.302	CLP	18.000.000	21/12/2016*	(903)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	54.421	CLP	36.000.000	21/12/2016*	11	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	126.395	CLP	84.000.000	21/12/2016*	(563)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	132.187	CLP	90.000.000	21/12/2016*	(3.840)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	553.048	CLP	372.000.000	21/12/2016*	(9.197)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	584.431	CLP	396.000.000	21/12/2016*	(14.088)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	655.141	CLP	438.000.000	21/12/2016*	(6.857)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	838.269	CLP	570.000.000	21/12/2016*	(23.236)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.695.327	CLP	1.833.505.200	21/12/2016*	(75.854)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	492.370	COP	1.500.000.000	21/12/2016*	(22.838)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	596.262	COP	1.740.000.000	21/12/2016*	(1.379)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	688.193	COP	2.040.000.000	21/12/2016*	(12.490)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	767.863	COP	2.220.000.000	21/12/2016*	5.355	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.158.531	COP	3.420.000.000	21/12/2016*	(16.144)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.458.631	COP	4.200.000.000	21/12/2016*	16.048	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Emerging Equities UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.473.718	COP	4.440.000.000	21/12/2016*	(51.298)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.069.670	COP	6.180.000.000	21/12/2016*	(52.987)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	387.196	HKD	3.000.000	21/12/2016	(1)	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	541.817	HKD	4.200.000	21/12/2016	(258)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	542.048	HKD	4.200.000	21/12/2016	(27)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	619.497	HKD	4.800.000	21/12/2016	(18)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	696.992	HKD	5.400.000	21/12/2016	38	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	697.025	HKD	5.400.000	21/12/2016	71	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	928.800	HKD	7.200.000	21/12/2016	(472)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.006.691	HKD	7.800.000	21/12/2016	(20)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.083.449	HKD	8.400.000	21/12/2016	(701)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.303.522	HKD	10.800.000	21/12/2016	(386)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	160.761	INR	10.800.000	21/12/2016*	440	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	586.143	INR	39.600.000	21/12/2016*	(1.701)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.340.822	KRW	1.500.000.000	21/12/2016*	(20.487)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.387.685	KRW	1.560.000.000	21/12/2016*	(28.076)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.715.814	KRW	1.920.000.000	21/12/2016*	(26.661)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	5.114.612	KRW	5.700.000.000	21/12/2016*	(58.361)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	8.681.255	KRW	9.720.000.000	21/12/2016*	(140.024)	(0,02)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	30.235	MXN	600.000	21/12/2016	(400)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	149.969	MXN	3.000.000	21/12/2016	(3.205)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	186.214	MXN	3.600.000	21/12/2016	2.405	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	242.942	MXN	4.800.000	21/12/2016	(2.136)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	271.363	MXN	5.400.000	21/12/2016	(4.350)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	368.298	MXN	7.200.000	21/12/2016	680	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	7.094.390	MXN	134.783.447	21/12/2016	212.612	0,03
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	7.157.416	MXN	136.467.553	21/12/2016	189.650	0,03
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	14.547	MYR	60.000	21/12/2016*	95	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.368.456	MYR	13.740.000	21/12/2016*	58.801	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	7.461.793	MYR	30.262.200	21/12/2016*	172.314	0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	12.303	PHP	600.000	21/12/2016*	4	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	12.460	PHP	600.000	21/12/2016*	162	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	37.367	PHP	1.800.000	21/12/2016*	472	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	37.408	PHP	1.800.000	21/12/2016*	513	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.499.167	PHP	70.101.391	21/12/2016*	62.310	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.552.036	PHP	72.294.219	21/12/2016*	70.234	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	15.490	PLN	60.000	21/12/2016	(115)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	249.612	PLN	980.395	21/12/2016	(5.366)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	434.073	PLN	1.691.375	21/12/2016	(5.814)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	457.419	PLN	1.759.014	21/12/2016	(60)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	522.667	PLN	2.030.810	21/12/2016	(5.499)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	614.442	PLN	2.392.773	21/12/2016	(7.862)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	877.918	PLN	3.386.102	21/12/2016	(2.729)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.889.928	PLN	7.243.931	21/12/2016	5.950	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	862.394	THB	29.944.200	21/12/2016	(1.293)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	19.809	TRY	60.000	21/12/2016	130	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	39.415	TRY	120.000	21/12/2016	57	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	39.966	TRY	120.000	21/12/2016	608	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	40.049	TRY	120.000	21/12/2016	691	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	59.456	TRY	180.000	21/12/2016	419	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	60.127	TRY	180.000	21/12/2016	1.089	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	139.953	TRY	420.000	21/12/2016	2.198	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	156.646	TRY	474.499	21/12/2016	1.017	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	326.616	TRY	988.542	21/12/2016	2.388	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	929.070	TRY	2.792.418	21/12/2016	13.195	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.061.520	TRY	3.179.297	21/12/2016	18.754	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.345.878	TRY	4.043.072	21/12/2016	19.806	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.749.002	TRY	5.287.972	21/12/2016	14.621	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.067.339	TWD	33.600.000	21/12/2016*	(9.982)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.573.949	TWD	49.800.000	21/12/2016*	(22.794)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.961.338	TWD	61.755.000	21/12/2016*	(18.720)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	122.343	ZAR	1.800.000	21/12/2016	(6.089)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	131.135	ZAR	1.800.000	21/12/2016	2.704	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.008.471	ZAR	14.400.000	21/12/2016	(18.982)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.798.601	ZAR	26.400.000	21/12/2016	(85.063)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.959.485	ZAR	43.800.000	21/12/2016	(165.685)	(0,02)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	4.754.868	ZAR	67.800.000	21/12/2016	(82.724)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	4.200.000	USD	290.407	21/12/2016	9.267	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	12.600.000	USD	908.932	21/12/2016	(9.910)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	17.400.000	USD	1.237.296	21/12/2016	4.210	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	18.600.000	USD	1.351.093	21/12/2016	(23.966)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	30.793.261	USD	2.160.790	21/12/2016	36.337	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	41.870.635	USD	2.946.825	21/12/2016	40.683	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	44.713.917	USD	3.082.990	21/12/2016	107.389	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	70.750.366	USD	4.789.074	21/12/2016	259.028	0,04
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	102.657.621	USD	7.064.127	21/12/2016	260.588	0,04
Total Devisenterminkontrakte						2.718.607	0,37

* Nicht lieferbare Terminkontrakte. (Siehe Anmerkung 3)

Außerbörslich gehandelte Total-Return-Swaps

Referenzwert	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
BOVESPA Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	BRL	1.190.166	13/10/2016	6.203	0,00
BOVESPA Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	BRL	6.703.470	13/10/2016	(7.392)	(0,00)
BOVESPA Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	BRL	10.054.376	13/10/2016	33.647	0,00
H-SHARES Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	HKD	99.767.113	28/10/2016	(52.503)	(0,01)
H-SHARES Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	HKD	168.349.980	28/10/2016	(292.746)	(0,04)
KOSPI2 Index Futures Dec16	Bank of America, N.A.	KRW	30.354.261.400	08/12/2016	(248.751)	(0,03)
SGX Nifty 50 Futures Oct16	Bank of America, N.A.	USD	26.518.386	27/10/2016	617.292	0,08
WIG20 INDEX Futures Dec16	Bank of America, N.A.	PLN	1.742.827	16/12/2016	3.081	0,00
WIG20 INDEX Futures Dec16	Bank of America, N.A.	PLN	2.476.233	16/12/2016	(4.273)	(0,00)
WIG20 INDEX Futures Dec16	Bank of America, N.A.	PLN	619.245	16/12/2016	(1.020)	(0,00)
BIST 30 Futures Oct16	Goldman Sachs & Co	TRY	1.148.954	31/10/2016	(2.942)	(0,00)
BIST 30 Futures Oct16	Goldman Sachs & Co	TRY	2.078.838	31/10/2016	(11.379)	(0,00)
BIST 30 Futures Oct16	Goldman Sachs & Co	TRY	1.386.609	31/10/2016	(6.779)	(0,00)
H-SHARES Index Futures Oct16	Goldman Sachs & Co	HKD	97.402.642	28/10/2016	(118.988)	(0,02)
H-SHARES Index Futures Oct16	Goldman Sachs & Co	HKD	97.332.241	28/10/2016	(109.908)	(0,01)

AQR UCITS FUNDS

AQR Emerging Equities UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Total-Return-Swaps (Fortsetzung)

Referenzwert	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
H-SHARES Index Futures Oct16	Goldman Sachs & Co	HKD	92.890.510	28/10/2016	(156.112)	(0,02)
KOSPI2 Index Futures Dec16	Goldman Sachs & Co	KRW	260.955.200	08/12/2016	(2.502)	(0,00)
KOSPI2 Index Futures Dec16	Goldman Sachs & Co	KRW	260.721.900	08/12/2016	(2.290)	(0,00)
KOSPI2 Index Futures Dec16	Goldman Sachs & Co	KRW	262.334.900	08/12/2016	(3.754)	(0,00)
MSCI Hong Kong Net Return Index	Goldman Sachs & Co	HKD	7.788	28/12/2016	7.618	0,00
MSCI Taiwan Index Futures Oct16	Goldman Sachs & Co	USD	2.841.093	28/10/2016	(39.153)	(0,01)
MSCI Taiwan Index Futures Oct16	Goldman Sachs & Co	USD	582.557	28/10/2016	(1.667)	(0,00)
SGX Nifty 50 Futures Oct16	Goldman Sachs & Co	USD	2.624.801	27/10/2016	46.803	0,01
SGX Nifty 50 Futures Oct16	Goldman Sachs & Co	USD	2.613.234	27/10/2016	35.235	0,01
SGX Nifty 50 Futures Oct16	Goldman Sachs & Co	USD	2.636.779	27/10/2016	58.781	0,01
TAIEX Futures Oct16	Goldman Sachs & Co	TWD	9.073.611	19/10/2016	1.799	0,00
MSCI Brazil Net Return Index Dec16	Goldman Sachs & Co	BRL	(6.943)	27/12/2016	(6.323)	(0,00)
MSCI Mexico Net Return Index Dec16	Goldman Sachs & Co	MXN	23.163	26/12/2016	22.108	0,00
MSCI Poland Net Return Index Dec16	Goldman Sachs & Co	PLN	(73)	23/12/2016	(66)	(0,00)
MSCI South Africa Net Return Index	Goldman Sachs & Co	ZAR	(6.189)	27/12/2016	6.286	0,00
MSCI Turkey Net Return Index Dec16	Goldman Sachs & Co	TRY	8.515	23/12/2016	4.897	0,00
Total Total-Return-Swaps						(224.798)
						(0,03)

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Core Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien				
Australien				
Aristocrat Leisure Ltd	AUD	2.592	31.484	0,03
BHP Billiton Ltd	AUD	8.991	155.907	0,16
Caltex Australia Ltd	AUD	6.258	164.958	0,17
CIMIC Group Ltd	AUD	12.373	273.435	0,28
Cochlear Ltd	AUD	1.085	117.476	0,12
Commonwealth Bank of Australia	AUD	1.308	72.770	0,07
Dexus Property Group (ß)	AUD	14.575	102.385	0,11
Flight Centre Travel Group Ltd	AUD	7.894	220.571	0,23
Fortescue Metals Group Ltd	AUD	45.396	173.872	0,18
Harvey Norman Holdings Ltd	AUD	9.776	39.040	0,04
Qantas Airways Ltd	AUD	70.333	168.547	0,17
Scentre Group (ß)	AUD	23.466	84.663	0,09
The GPT Group (ß)	AUD	10.598	41.176	0,04
Treasury Wine Estates Ltd	AUD	55.580	471.382	0,49
Westpac Banking Corp	AUD	3.402	77.192	0,08
Total Australien			2.194.858	2,26
Belgien				
KBC Group NV	EUR	1.801	102.657	0,11
Umicore SA	EUR	3.567	222.393	0,23
Total Belgien			325.050	0,34
Kanada				
Alimentation Couche-Tard Inc	CAD	1.366	65.976	0,07
Bank of Montreal	CAD	2.214	145.675	0,15
CAE Inc	CAD	10.870	153.473	0,16
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD	1.765	136.905	0,14
CGI Group Inc	CAD	9.643	460.599	0,48
Dollarama Inc	CAD	803	63.517	0,07
First Quantum Minerals Ltd	CAD	22.575	186.145	0,19
Great-West Lifeco Inc	CAD	2.476	61.116	0,06
Metro Inc	CAD	2.768	91.823	0,09
National Bank of Canada	CAD	1.925	68.528	0,07
Open Text Corp	CAD	5.360	348.216	0,36
Royal Bank of Canada	CAD	4.338	269.744	0,28
Saputo Inc	CAD	1.986	69.124	0,07
Seven Generations Energy Ltd	CAD	14.888	353.519	0,36
The Bank of Nova Scotia	CAD	3.297	176.066	0,18
The Toronto-Dominion Bank	CAD	5.856	260.505	0,27
Total Kanada			2.910.931	3,00
China				
Yangtze River Shipbuilding Holdings Ltd	SGD	339.400	187.239	0,19
Total China			187.239	0,19
Dänemark				
AP Moeller - Maersk A/S	DKK	38	55.395	0,06
DSV A/S	DKK	2.187	108.168	0,11
ISS A/S	DKK	4.222	173.295	0,18
Pandora A/S	DKK	2.690	324.316	0,33
Vestas Wind Systems A/S	DKK	4.488	368.832	0,38
Total Dänemark			1.030.006	1,06
Finnland				
Elisa OYJ	EUR	773	28.178	0,03
Neste OYJ	EUR	15.181	645.801	0,67
Nokian Renkaat OYJ	EUR	1.483	53.695	0,05
Orion OYJ	EUR	743	29.017	0,03
Total Finnland			756.691	0,78
Frankreich				
Atos SE	EUR	3.121	335.365	0,35
AXA SA	EUR	1.350	28.124	0,03
BNP Paribas SA	EUR	3.890	195.634	0,20
Capgemini SA	EUR	919	89.695	0,09
Cie Generale des Etablissements Michelin	EUR	2.605	285.817	0,30
CNP Assurances	EUR	52.614	877.293	0,90
Orange SA	EUR	10.800	167.430	0,17
Peugeot SA	EUR	22.144	332.619	0,34
Renault SA	EUR	1.925	155.774	0,16
Safran SA	EUR	399	28.347	0,03
SCOR SE	EUR	3.475	106.498	0,11
Societe Generale SA	EUR	2.583	87.760	0,09
Technip SA	EUR	804	49.523	0,05
Thales SA	EUR	4.070	374.288	0,39
TOTAL SA	EUR	4.543	214.648	0,22
Unibail-Rodamco SE (ß)	EUR	325	87.070	0,09
Valeo SA	EUR	642	36.860	0,04
Total Frankreich			3.452.745	3,56
Deutschland				
adidas AG	EUR	1.567	269.451	0,28
Allianz SE	EUR	2.875	419.116	0,43
Covestro AG	EUR	4.648	270.096	0,28
Deutsche Lufthansa-Reg	EUR	63.119	690.764	0,71
Deutsche Wohnen Ag-Br	EUR	2.209	79.758	0,08
Hannover Rueck Se	EUR	3.726	392.272	0,40
HeidelbergCement AG	EUR	545	50.969	0,05
HOCHTIEF AG	EUR	401	56.278	0,06
Infineon Technologies Ag	EUR	15.488	272.832	0,28
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	EUR	2.085	383.415	0,40
OSRAM Licht AG	EUR	6.285	364.869	0,38
SAP SE	EUR	748	67.203	0,07
Siemens Ag-Reg	EUR	2.457	284.919	0,29
Total Deutschland			3.601.942	3,71

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Core Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Hongkong				
CK Hutchison Holdings Ltd	HKD	2.500	31.892	0,03
CLP Holdings Ltd	HKD	35.000	362.507	0,37
Li & Fung Ltd	HKD	82.000	42.131	0,04
Link REIT (B)	HKD	7.500	55.269	0,06
New World Development Co Ltd	HKD	22.000	28.711	0,03
PCCW Ltd	HKD	12.000	7.373	0,01
WH Group Ltd	HKD	693.000	558.834	0,58
Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	HKD	140.500	580.577	0,60
Total Hongkong			1.667.294	1,72
Italien				
Assicurazioni Generali SpA	EUR	3.563	42.655	0,04
Ferrari NV	EUR	379	19.488	0,02
Mediobanca SpA	EUR	20.987	132.801	0,14
Prysmian SpA	EUR	5.900	154.229	0,16
UnipolSai SpA	EUR	21.852	34.954	0,04
Total Italien			384.127	0,40
Japan				
Alfresa Holdings Corp	JPY	3.000	63.273	0,07
Amada Holdings Co Ltd	JPY	24.100	249.685	0,26
Astellas Pharma Inc	JPY	4.200	65.473	0,07
Bridgestone Corp	JPY	5.400	198.353	0,20
Central Japan Railway Co	JPY	1.900	324.230	0,33
Chubu Electric Power Co Inc	JPY	39.500	574.712	0,59
Daiichi Sankyo Co Ltd	JPY	3.100	74.251	0,08
Fuji Heavy Industries Ltd	JPY	20.400	761.041	0,78
Hitachi Chemical Co Ltd	JPY	11.400	260.879	0,27
Hitachi High-Technologies Corp	JPY	800	31.890	0,03
Hoya Corp	JPY	3.600	144.205	0,15
Iida Group Holdings Co Ltd	JPY	400	8.035	0,01
ITOCHU Corp	JPY	23.100	289.588	0,30
JGC Corp	JPY	4.000	69.344	0,07
JTEKT Corp	JPY	9.800	146.324	0,15
Kuraray Co Ltd	JPY	3.300	48.802	0,05
Mazda Motor Corp	JPY	2.000	30.411	0,03
Medipal Holdings Corp	JPY	4.300	74.287	0,08
Mitsubishi Chemical Holdings Corp	JPY	10.200	63.653	0,07
Mitsubishi Electric Corp	JPY	31.000	395.071	0,41
Mitsubishi Tanabe Pharma Corp	JPY	13.100	279.823	0,29
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	JPY	44.600	223.523	0,23
Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	JPY	13.000	59.387	0,06
Mitsui Chemicals Inc	JPY	21.000	99.504	0,10
Mixi Inc	JPY	13.300	479.998	0,50
Mizuho Financial Group Inc	JPY	211.500	353.533	0,36
NHK Spring Co Ltd	JPY	8.400	81.112	0,08
Nippon Telegraph & Telephone Corp	JPY	8.800	401.226	0,41
Nissan Motor Co Ltd	JPY	4.400	42.973	0,04
Nitto Denko Corp	JPY	900	58.175	0,06
NTT DOCOMO Inc	JPY	4.000	101.236	0,10
Obayashi Corp	JPY	4.200	41.498	0,04
ORIX Corp	JPY	9.200	135.003	0,14
Resona Holdings Inc	JPY	24.800	103.874	0,11
Seiko Epson Corp	JPY	1.500	28.764	0,03
Shionogi & Co Ltd	JPY	1.400	71.549	0,07
Sompo Japan Nipponkoa Holdings Inc	JPY	2.600	76.559	0,08
Sumitomo Corp	JPY	23.200	258.483	0,27
Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	JPY	2.600	50.202	0,05
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	JPY	5.800	194.244	0,20
Sumitomo Rubber Industries Ltd	JPY	1.800	27.127	0,03
T&D Holdings Inc	JPY	2.400	26.925	0,03
TDK Corp	JPY	2.800	186.509	0,19
Tohoku Electric Power Co Inc	JPY	4.300	56.077	0,06
Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	JPY	6.500	28.050	0,03
Toppan Printing Co Ltd	JPY	34.000	305.845	0,32
Toyota Motor Corp	JPY	500	28.840	0,03
Yamaguchi Financial Group Inc	JPY	10.000	106.337	0,11
Yokogawa Electric Corp	JPY	4.300	56.991	0,06
Total Japan			7.836.874	8,08
Niederlande				
ING Groep NV - ADR	EUR	11.092	133.412	0,14
Koninklijke Ahold Delhaize NV	EUR	39.428	893.218	0,92
Royal Dutch Shell PLC	GBP	11.494	299.343	0,31
Wolters Kluwer NV	EUR	13.854	588.573	0,60
Total Niederlande			1.914.546	1,97
Singapur				
Ascendas Real Estate Investment Trust (B)	SGD	44.800	82.946	0,08
Suntec Real Estate Investment Trust (B)	SGD	76.000	95.771	0,10
Total Singapur			178.717	0,18
Südafrika				
Investec PLC	GBP	25.265	153.481	0,16
Total Südafrika			153.481	0,16
Spanien				
Aena SA	EUR	3.110	457.906	0,47
Banco de Sabadell SA	EUR	65.179	81.319	0,09
Banco Santander SA	EUR	7.305	31.591	0,03
Iberdrola SA	EUR	12.658	85.829	0,09
Repsol SA	EUR	15.335	207.137	0,21
Total Spanien			863.782	0,89

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Core Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Schweden				
Electrolux AB	SEK	4.046	100.914	0,10
Husqvarna AB	SEK	5.419	46.829	0,05
Investor AB	SEK	1.306	47.440	0,05
Securitas AB	SEK	20.012	333.997	0,35
Svenska Cellulosa AB SCA	SEK	949	27.977	0,03
Swedish Match AB	SEK	10.928	399.496	0,41
Total Schweden			956.653	0,99
Schweiz				
ABB Ltd	CHF	15.861	354.028	0,37
Actelion Ltd	CHF	1.640	283.624	0,29
Baloise Holding AG	CHF	389	46.719	0,05
Coca-Cola HBC AG	GBP	24.642	568.322	0,59
Galenica AG	CHF	321	342.541	0,35
Lonza Group AG	CHF	411	78.022	0,08
Nestle SA	CHF	2.383	187.896	0,19
Novartis AG	CHF	630	49.318	0,05
Roche Holding AG	CHF	1.569	387.382	0,40
SGS SA	CHF	260	578.730	0,60
Sika AG	CHF	23	111.061	0,11
Swiss Life Holding AG	CHF	1.492	380.357	0,39
Swiss Re AG	CHF	5.680	508.412	0,52
Syngenta AG	CHF	260	113.737	0,12
Total Schweiz			3.990.149	4,11
Vereinigtes Königreich				
3i Group PLC	GBP	2.830	23.833	0,02
Aggreko PLC	GBP	4.042	50.101	0,05
Ashtead Group PLC	GBP	3.463	56.618	0,06
AstraZeneca PLC	GBP	1.019	65.994	0,07
Barratt Developments PLC	GBP	65.997	416.520	0,43
BT Group PLC	GBP	76.921	386.423	0,40
DCC PLC	GBP	1.041	94.494	0,10
Dixons Carphone PLC	GBP	10.759	50.969	0,05
Fiat Chrysler Automobiles NV	EUR	53.573	329.689	0,34
HSBC Holdings PLC	GBP	49.956	373.343	0,39
Imperial Brands PLC	GBP	900	46.218	0,05
Kingfisher PLC	GBP	22.937	111.668	0,12
Land Securities Group PLC (B)	GBP	2.609	35.337	0,04
Legal & General Group PLC	GBP	39.256	110.826	0,11
Lloyds Banking Group PLC	GBP	77.414	54.263	0,06
Marks & Spencer Group PLC	GBP	8.148	34.103	0,04
National Grid PLC	GBP	22.078	314.522	0,32
Persimmon PLC	GBP	24.625	572.726	0,59
Prudential PLC	GBP	13.013	229.822	0,24
Reckitt Benckiser Group PLC	GBP	2.211	208.392	0,22
Royal Mail PLC	GBP	97.647	614.494	0,63
SABMiller PLC	GBP	2.781	162.297	0,17
Segro PLC (B)	GBP	14.047	81.758	0,08
Taylor Wimpey PLC	GBP	255.782	505.213	0,52
The British Land Co PLC (B)	GBP	10.052	81.911	0,08
Unilever PLC	GBP	3.705	175.420	0,18
Vodafone Group PLC	GBP	38.558	110.708	0,11
William Hill PLC	GBP	10.618	41.724	0,04
WPP PLC	GBP	11.306	264.836	0,27
Total Vereinigtes Königreich			5.604.222	5,78
Vereinigte Staaten				
3M Co	USD	984	173.725	0,18
AbbVie Inc	USD	4.807	300.389	0,31
Accenture PLC	USD	634	77.443	0,08
Activision Blizzard Inc	USD	12.271	541.274	0,56
Aetna Inc	USD	6.581	756.749	0,78
Aflac Inc	USD	790	56.730	0,06
Akamai Technologies Inc	USD	1.405	73.439	0,08
Alphabet Inc	USD	884	685.454	0,71
Alphabet Inc	USD	1.583	1.271.735	1,31
Altria Group Inc	USD	7.933	499.303	0,51
Amazon.com Inc	USD	1.775	1.481.575	1,53
American Tower Corp (B)	USD	1.401	159.350	0,16
Amgen Inc	USD	4.680	775.102	0,80
Anthem Inc	USD	5.060	629.363	0,65
Apple Inc	USD	14.532	1.639.936	1,69
Applied Materials Inc	USD	19.474	580.520	0,60
Arrow Electronics Inc	USD	2.415	154.294	0,16
AT&T Inc	USD	11.596	474.334	0,49
AutoZone Inc	USD	240	183.634	0,19
AvalonBay Communities Inc (B)	USD	440	78.399	0,08
Avery Dennison Corp	USD	600	46.368	0,05
Avnet Inc	USD	365	14.903	0,02
Bank of America Corp	USD	39.348	600.844	0,62
Baxter International Inc	USD	9.674	455.258	0,47
Berkshire Hathaway Inc	USD	3.347	484.043	0,50
Best Buy Co Inc	USD	15.446	583.241	0,60
Biogen Inc	USD	2.531	779.649	0,80
Boston Properties Inc (B)	USD	508	69.164	0,07
Campbell Soup Co	USD	757	41.317	0,04
Carnival Corp	USD	7.766	377.738	0,39
CenturyLink Inc	USD	5.732	158.318	0,16
Charter Communications Inc	USD	392	105.903	0,11

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Core Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Chubb Ltd	USD	988	123.411	0,13
Cigna Corp	USD	737	96.223	0,10
Cintas Corp	USD	2.930	327.047	0,34
Cisco Systems Inc	USD	33.951	1.072.003	1,11
Citigroup Inc	USD	8.449	391.358	0,40
Citrix Systems Inc	USD	7.488	639.700	0,66
Comcast Corp	USD	1.283	85.114	0,09
Consolidated Edison Inc	USD	2.900	219.878	0,23
Crown Castle International Corp (B)	USD	1.116	104.603	0,11
Darden Restaurants Inc	USD	3.160	191.528	0,20
Dell Technologies Inc - VMware Inc	USD	619	29.495	0,03
Delta Air Lines Inc	USD	2.770	108.002	0,11
Dick's Sporting Goods Inc	USD	1.750	98.910	0,10
Digital Realty Trust Inc	USD	290	28.243	0,03
Discover Financial Services	USD	866	48.652	0,05
Dollar General Corp	USD	913	62.833	0,06
DR Horton Inc	USD	4.244	127.532	0,13
Dr Pepper Snapple Group Inc	USD	5.656	513.395	0,53
Dun & Bradstreet Corp/The	USD	212	28.650	0,03
eBay Inc	USD	19.137	628.650	0,65
Edwards Lifesciences Corp	USD	429	51.394	0,05
EI du Pont de Nemours & Co	USD	2.642	176.565	0,18
Electronic Arts Inc	USD	3.288	278.526	0,29
Eli Lilly & Co	USD	668	53.460	0,06
Equifax Inc	USD	1.387	185.594	0,19
Equinix Inc (L)	USD	184	65.997	0,07
Equity Residential (B)	USD	1.215	78.076	0,08
Everest Re Group Ltd	USD	2.368	450.157	0,46
Expedia Inc	USD	2.407	281.571	0,29
Express Scripts Holding Co	USD	990	68.280	0,07
Facebook Inc	USD	10.419	1.329.777	1,37
Fiserv Inc	USD	1.186	117.426	0,12
Foot Locker Inc	USD	6.336	424.765	0,44
General Motors Co	USD	8.237	260.783	0,27
Gilead Sciences Inc	USD	8.889	699.831	0,72
H&R Block Inc	USD	130	2.945	0,00
Hasbro Inc	USD	551	43.573	0,05
HCA Holdings Inc	USD	2.368	177.245	0,18
HCP Inc (L)	USD	1.478	56.652	0,06
Hewlett Packard Enterprise Co	USD	4.883	111.381	0,12
Hormel Foods Corp	USD	6.716	255.074	0,26
HP Inc	USD	16.498	256.214	0,26
IDEXX Laboratories Inc	USD	1.962	219.312	0,23
Ingredion Inc	USD	1.857	245.050	0,25
Intel Corp	USD	30.359	1.144.534	1,18
International Business Machines Corp	USD	1.711	272.323	0,28
Jacobs Engineering Group Inc	USD	4.153	215.541	0,22
Johnson & Johnson	USD	12.149	1.436.012	1,48
JPMorgan Chase & Co	USD	17.010	1.127.253	1,16
Juniper Networks Inc	USD	4.311	102.559	0,11
Kohl's Corp	USD	4.783	207.008	0,21
Laboratory Corp of America Holdings	USD	2.810	379.996	0,39
Lam Research Corp	USD	8.709	814.553	0,84
Lear Corp	USD	491	58.773	0,06
Lowe's Cos Inc	USD	3.368	240.543	0,25
Mallinckrodt PLC	USD	7.265	501.285	0,52
Marathon Petroleum Corp	USD	4.167	166.805	0,17
Masco Corp	USD	7.971	271.014	0,28
McDonald's Corp	USD	2.104	242.781	0,25
Medtronic PLC	USD	2.083	178.513	0,18
Merck & Co Inc	USD	8.209	511.749	0,53
Michael Kors Holdings Ltd	USD	16.408	766.582	0,79
Microfutures Corp	USD	24.858	1.425.855	1,47
Monsanto Co	USD	1.246	126.805	0,13
Mylan NV	USD	4.619	176.215	0,18
Nasdaq Inc	USD	4.379	297.378	0,31
New York Community Bancorp Inc	USD	1.267	18.010	0,02
NIKE Inc	USD	5.529	290.162	0,30
Northrop Grumman Corp	USD	1.984	421.144	0,43
NVIDIA Corp	USD	11.468	785.902	0,81
O'Reilly Automotive Inc	USD	1.286	359.681	0,37
PepsiCo Inc	USD	4.932	534.777	0,55
Pfizer Inc	USD	26.870	903.638	0,93
Prologis Inc (L)	USD	1.732	93.251	0,10
Public Service Enterprise Group Inc	USD	17.345	731.092	0,75
Public Storage (L)	USD	488	109.029	0,11
Quest Diagnostics Inc	USD	1.919	159.469	0,16
Quintiles Transnational Holdings Inc	USD	7.787	619.689	0,64
Raytheon Co	USD	1.755	237.171	0,24
Realty Income Corp	USD	717	48.139	0,05
Regions Financial Corp	USD	9.988	97.183	0,10
Reynolds American Inc	USD	6.244	294.092	0,30
Ross Stores Inc	USD	5.845	372.034	0,38
S&P Global Inc	USD	743	93.975	0,10
SCANA Corp	USD	1.000	72.880	0,08
Scripps Networks Interactive Inc	USD	2.580	164.836	0,17
Simon Property Group Inc (S)	USD	1.035	214.348	0,22
Skyworks Solutions Inc	USD	5.787	429.974	0,44
Sprint Corp	USD	10.602	69.231	0,07
Starbucks Corp	USD	809	43.613	0,05
State Street Corp	USD	1.189	81.875	0,08
SunTrust Banks Inc	USD	3.266	141.614	0,15
Synopsys Inc	USD	3.265	193.059	0,20
Target Corp	USD	10.639	722.707	0,75
TEGNA Inc	USD	6.058	130.368	0,13
Tesoro Corp	USD	2.269	175.893	0,18
Texas Instruments Inc	USD	5.657	397.008	0,41

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Core Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
The Estee Lauder Cos Inc	USD	5.979	525.315	0,54
The Gap Inc	USD	8.679	189.897	0,20
The Home Depot Inc	USD	5.608	716.142	0,74
The Kraft Heinz Co	USD	1.703	151.686	0,16
The Kroger Co	USD	16.316	486.217	0,50
The PNC Financial Services Group Inc	USD	802	71.715	0,07
The Priceline Group Inc	USD	301	443.021	0,46
The Procter & Gamble Co	USD	5.642	504.000	0,52
The Progressive Corp	USD	4.064	127.284	0,13
The TJX Cos Inc	USD	2.931	217.597	0,22
The Travelers Cos Inc	USD	3.515	402.046	0,41
The Western Union Co	USD	6.818	140.417	0,14
TripAdvisor Inc	USD	2.668	168.751	0,17
Tyson Foods Inc	USD	16.626	1.247.116	1,29
United Continental Holdings Inc	USD	9.734	501.106	0,52
United Rentals Inc	USD	2.086	161.206	0,17
United Therapeutics Corp	USD	6.574	758.179	0,78
UnitedHealth Group Inc	USD	5.338	739.954	0,76
Universal Health Services Inc	USD	552	67.217	0,07
Valero Energy Corp	USD	8.720	455.446	0,47
Ventas Inc (B)	USD	1.096	78.419	0,08
VeriSign Inc	USD	3.984	309.477	0,32
Verizon Communications Inc	USD	5.220	273.632	0,28
Viacom Inc	USD	3.128	117.644	0,12
VMware Inc	USD	4.155	303.606	0,31
Vornado Realty Trust (B)	USD	552	55.890	0,06
Wal-Mart Stores Inc	USD	20.835	1.499.912	1,55
Wells Fargo & Co	USD	5.512	243.355	0,25
Welltower Inc (B)	USD	1.162	87.615	0,09
Xilinx Inc	USD	801	43.558	0,05
Total Vereinigte Staaten			55.881.710	57,61
Total Stammaktien			93.891.017	96,79
Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Total Anlagen (Gesamtkosten: \$88.974.054)			93.891.017	96,79
Sonstige Vermögenswerte/(Verbindlichkeiten)			3.114.679	3,21
NETTOVERMÖGEN			97.005.696	100,00

(B) Immobilienfonds
ADR-American Depository Receipt

Derivate
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Börsengehandelte Futures

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust) in USD	% des Nettovermögens
mini MSCI EAFE Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(172.245)	2	16/12/2016	(2.795)	(0,00)
mini MSCI EAFE Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(422.174)	5	16/12/2016	1.451	0,00
S&P 500 E Mini Index Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(423.200)	4	16/12/2016	7.200	0,01
S&P 500 E Mini Index Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(108.545)	1	16/12/2016	(945)	(0,00)
S&P 500 E Mini Index Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(537.963)	5	16/12/2016	37	0,00
S&P TSX 60 Index Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	(170.721)	1	15/12/2016	686	0,00
Total Futures						5.634	0,01

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Defensive Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Australien				
AGL Energy Ltd	AUD	59.469	870.071	0,32
Aurizon Holdings Ltd	AUD	104.281	376.672	0,14
Australia & New Zealand Banking Group Ltd	AUD	11.117	236.238	0,09
Bendigo & Adelaide Bank Ltd	AUD	62.384	516.379	0,19
Boral Ltd	AUD	12.687	65.835	0,02
Brambles Ltd	AUD	17.767	163.533	0,06
Caltex Australia Ltd	AUD	33.796	890.846	0,33
CIMIC Group Ltd	AUD	1.554	34.342	0,01
Coca-Cola Amatil Ltd	AUD	42.078	330.783	0,12
Cochlear Ltd	AUD	15.945	1.726.408	0,63
Commonwealth Bank of Australia	AUD	1.872	104.147	0,04
CSL Ltd	AUD	3.484	286.162	0,10
Flight Centre Travel Group Ltd	AUD	21.068	588.675	0,22
Medibank Pvt Ltd	AUD	267.434	509.059	0,19
Newcrest Mining Ltd	AUD	61.095	1.041.241	0,38
Ramsay Health Care Ltd	AUD	2.423	147.222	0,05
REA Group Ltd	AUD	5.090	220.707	0,08
Sonic Healthcare Ltd	AUD	31.605	534.363	0,20
South32 Ltd	AUD	61.374	114.226	0,04
Tabcorp Holdings Ltd	AUD	15.853	60.599	0,02
Tatts Group Ltd	AUD	66.835	187.526	0,07
Telstra Corp Ltd	AUD	635.555	2.527.760	0,92
TPG Telecom Ltd	AUD	52.375	347.012	0,13
Transurban Group	AUD	74.196	647.923	0,24
Wesfarmers Ltd	AUD	55.491	1.878.864	0,69
Woodside Petroleum Ltd	AUD	27.797	613.096	0,22
Woolworths Ltd	AUD	123.763	2.213.261	0,81
Total Australien			17.232.950	6,31
Österreich				
ANDRITZ AG	EUR	876	47.266	0,02
Total Österreich			47.266	0,02
Belgien				
Colruyt SA	EUR	26.468	1.452.016	0,53
Proximus SADP	EUR	18.467	546.599	0,20
UCB SA	EUR	1.008	77.908	0,03
Total Belgien			2.076.523	0,76
Bermuda				
Arch Capital Group Ltd	USD	4.919	388.847	0,14
Marvell Technology Group Ltd	USD	4.250	57.332	0,02
RenaissanceRe Holdings Ltd	USD	683	81.858	0,03
Total Bermuda			528.037	0,19
Kanada				
Agnico Eagle Mines Ltd	CAD	35.944	1.989.395	0,73
Alimentation Couche-Tard Inc	CAD	4.391	212.081	0,08
Bank of Montreal	CAD	10.802	710.740	0,26
Barrick Gold Corp	CAD	54.277	984.521	0,36
BCE Inc	CAD	68.278	3.174.328	1,16
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD	12.383	960.509	0,35
Eldorado Gold Corp	CAD	70.240	281.817	0,10
Empire Co Ltd	CAD	39.622	602.037	0,22
Franco-Nevada Corp	CAD	17.647	1.256.693	0,46
George Weston Ltd	CAD	2.855	238.810	0,09
Goldcorp Inc	CAD	50.583	847.294	0,31
Intact Financial Corp	CAD	9.736	708.329	0,26
Kinross Gold Corp	CAD	238.703	1.020.542	0,37
Loblaw Cos Ltd	CAD	11.968	617.388	0,23
Metro Inc	CAD	13.798	457.723	0,17
Peyto Exploration & Development Corp	CAD	3.678	104.813	0,04
Rogers Communications Inc	CAD	8.810	376.189	0,14
Royal Bank of Canada	CAD	13.876	862.831	0,31
Saputo Inc	CAD	10.779	375.168	0,14
Shaw Communications Inc	CAD	43.745	894.921	0,33
Silver Wheaton Corp	CAD	52.314	1.458.886	0,53
The Bank of Nova Scotia	CAD	21.788	1.163.523	0,43
The Toronto-Dominion Bank	CAD	16.703	743.035	0,27
Yamana Gold Inc	CAD	92.443	413.208	0,15
Total Kanada			20.454.781	7,49
China				
Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	SGD	205.500	113.370	0,04
Total China			113.370	0,04
Dänemark				
Coloplast A/S	DKK	16.420	1.269.104	0,47
ISS A/S	DKK	4.858	199.400	0,07
Novo Nordisk A/S	DKK	25.689	1.064.092	0,39
William Demant Holding A/S	DKK	16.150	329.135	0,12
Total Dänemark			2.861.731	1,05
Finnland				
Kone OYJ	EUR	11.559	578.015	0,21
Orion OYJ	EUR	16.717	652.864	0,24
Sampo OYJ	EUR	1.965	86.014	0,03
Total Finnland			1.316.893	0,48
Frankreich				
Aerports de Paris	EUR	1.721	169.418	0,06
Alstom SA	EUR	3.386	89.176	0,03
Cie Generale des Etablissements Michelin	EUR	4.363	478.702	0,18
CNP Assurances	EUR	7.750	129.225	0,05

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Defensive Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien				
Frankreich (Fortsetzung)				
Danone SA	EUR	7.641	561.362	0,21
Dassault Systemes	EUR	5.400	466.091	0,17
Essilor International SA	EUR	736	94.259	0,04
Hermes International	EUR	1.673	675.501	0,25
Iliad SA	EUR	1.479	305.548	0,11
Imerys SA	EUR	2.830	202.392	0,07
L'Oréal SA	EUR	9.843	1.845.906	0,68
Pernod Ricard SA	EUR	517	60.735	0,02
Sanofi	EUR	4.460	336.812	0,12
Societe BIC SA	EUR	3.774	553.133	0,20
Sodexo SA	EUR	490	57.700	0,02
Thales SA	EUR	3.444	316.720	0,12
TOTAL SA	EUR	18.650	881.176	0,32
Vinci SA	EUR	1.210	92.123	0,03
Total Frankreich			7.315.979	2,68
Deutschland				
Beiersdorf AG	EUR	15.353	1.430.318	0,52
Henkel Ag & Co Kgaa Vorzug	EUR	5.211	702.705	0,26
HUGO BOSS AG	EUR	795	43.194	0,02
Man Se	EUR	12.580	1.315.393	0,48
Merck KGaA	EUR	841	89.502	0,03
SAP SE	EUR	2.184	196.220	0,07
TUI AG	GBP	8.986	127.544	0,05
Total Deutschland			3.904.876	1,43
Hongkong				
BOC Hong Kong Holdings Ltd	HKD	268.000	909.067	0,33
CK Hutchison Holdings Ltd	HKD	65.500	835.566	0,31
CLP Holdings Ltd	HKD	159.000	1.646.816	0,60
Hang Seng Bank Ltd	HKD	57.700	1.033.480	0,38
HK Electric Investments & HK Electric Investments Ltd	HKD	64.000	62.767	0,02
HKT Trust & HKT Ltd	HKD	529.000	745.262	0,27
Hong Kong & China Gas Co Ltd	HKD	653.840	1.237.564	0,46
MTR Corp Ltd	HKD	228.000	1.257.880	0,46
Power Assets Holdings Ltd	HKD	34.000	332.189	0,12
SJM Holdings Ltd	HKD	1.047.000	772.778	0,28
The Bank of East Asia Ltd	HKD	65.400	266.446	0,10
Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	HKD	72.000	297.520	0,11
Total Hongkong			9.397.335	3,44
Italien				
Enel SpA	EUR	11.493	51.094	0,02
Luxottica Group SpA	EUR	1.336	63.483	0,02
Snam SpA	EUR	28.219	155.946	0,06
Total Italien			270.523	0,10
Japan				
ABC-Mart Inc	JPY	7.800	530.409	0,19
Ajinomoto Co Inc	JPY	8.000	177.821	0,06
Asahi Group Holdings Ltd	JPY	5.400	196.220	0,07
Astellas Pharma Inc	JPY	85.100	1.326.601	0,49
Bandai Namco Holdings Inc	JPY	27.200	829.821	0,30
Benesse Holdings Inc	JPY	13.100	334.000	0,12
Bridgestone Corp	JPY	15.600	573.020	0,21
Calbee Inc	JPY	12.100	457.425	0,17
Canon Inc	JPY	39.500	1.144.692	0,42
Chugai Pharmaceutical Co Ltd	JPY	8.800	317.049	0,12
Eisai Co Ltd	JPY	2.500	155.859	0,06
FamilyMart UNY Holdings Co Ltd	JPY	3.300	220.160	0,08
FANUC Corp	JPY	2.500	421.062	0,15
Fast Retailing Co Ltd	JPY	800	256.292	0,09
Fuji Heavy Industries Ltd	JPY	6.600	246.219	0,09
GungHo Online Entertainment Inc	JPY	160.200	392.561	0,14
Hakuhodo DY Holdings Inc	JPY	51.600	602.705	0,22
Hirose Electric Co Ltd	JPY	2.000	261.983	0,10
Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	JPY	10.400	560.283	0,20
Hitachi Chemical Co Ltd	JPY	6.000	137.305	0,05
Hitachi Metals Ltd	JPY	22.500	275.614	0,10
Hoshizaki Corp	JPY	1.400	127.385	0,05
Hoya Corp	JPY	7.300	292.415	0,11
Japan Airlines Co Ltd	JPY	25.500	747.576	0,27
Japan Airport Terminal Co Ltd	JPY	2.200	83.744	0,03
Japan Tobacco Inc	JPY	7.100	290.117	0,11
Kajima Corp	JPY	36.000	251.331	0,09
Kakaku.com Inc	JPY	6.000	108.412	0,04
Kamigumi Co Ltd	JPY	37.000	321.925	0,12
Kao Corp	JPY	23.200	1.308.357	0,48
KDDI Corp	JPY	29.300	904.731	0,33
Keihan Holdings Co Ltd	JPY	4.000	27.937	0,01
Kirin Holdings Co Ltd	JPY	9.400	155.777	0,06
Komatsu Ltd	JPY	8.400	191.319	0,07
Kose Corp	JPY	5.900	602.088	0,22
Kurita Water Industries Ltd	JPY	10.800	255.981	0,09
Lawson Inc	JPY	800	63.143	0,02
M3 Inc	JPY	5.000	170.726	0,06
Makita Corp	JPY	1.600	113.665	0,04
McDonald's Holdings Co Japan Ltd	JPY	41.700	1.228.457	0,45
Miraca Holdings Inc	JPY	4.200	208.675	0,08
Mitsubishi Electric Corp	JPY	5.000	63.721	0,02
Mitsubishi Tanabe Pharma Corp	JPY	30.600	653.632	0,24
Mixi Inc	JPY	15.500	559.396	0,20
Nabtesco Corp	JPY	7.100	200.466	0,07
NH Foods Ltd	JPY	7.000	168.863	0,06
Nikon Corp	JPY	11.500	171.381	0,06

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Defensive Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Japan (Fortsetzung)				
Nippon Express Co Ltd	JPY	22.000	102.506	0,04
Nippon Telegraph & Telephone Corp	JPY	14.600	665.671	0,24
Nissin Foods Holdings Co Ltd	JPY	14.300	868.380	0,32
Nitori Holdings Co Ltd	JPY	2.700	322.840	0,12
Nitto Denko Corp	JPY	5.000	323.195	0,12
Nomura Research Institute Ltd	JPY	2.510	86.385	0,03
Obayashi Corp	JPY	19.000	187.730	0,07
Omron Corp	JPY	9.300	332.870	0,12
Oracle Corp Japan	JPY	15.200	856.763	0,31
Oriental Land Co Ltd	JPY	3.400	206.655	0,08
Osaka Gas Co Ltd	JPY	371.000	1.553.023	0,57
Otsuka Corp	JPY	7.800	369.574	0,14
Otsuka Holdings Co Ltd	JPY	29.400	1.336.265	0,49
Park24 Co Ltd	JPY	22.800	740.667	0,27
Pola Orbs Holdings Inc	JPY	1.500	134.004	0,05
Recruit Holdings Co Ltd	JPY	64.100	2.610.198	0,96
Rinnai Corp	JPY	500	46.370	0,02
Sankyo Co Ltd	JPY	9.300	317.098	0,12
Secom Co Ltd	JPY	4.100	305.038	0,11
Seven & i Holdings Co Ltd	JPY	11.800	556.420	0,20
Shimamura Co Ltd	JPY	3.100	376.558	0,14
Shin-Etsu Chemical Co Ltd	JPY	1.400	97.331	0,04
Shionogi & Co Ltd	JPY	600	30.664	0,01
SMC Corp/Japan	JPY	500	143.665	0,05
Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	JPY	6.400	123.576	0,04
Sundrug Co Ltd	JPY	700	58.642	0,02
Suntory Beverage & Food Ltd	JPY	14.100	608.101	0,22
Suzuki Motor Corp	JPY	1.300	43.341	0,02
Sysmex Corp	JPY	5.500	406.384	0,15
Taisei Corp	JPY	57.000	426.732	0,16
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	JPY	9.400	449.496	0,16
Toho Co Ltd/Tokyo	JPY	3.200	106.031	0,04
Toho Gas Co Ltd	JPY	139.000	1.299.665	0,48
Tokyo Gas Co Ltd	JPY	282.000	1.252.522	0,46
Toray Industries Inc	JPY	13.000	126.249	0,05
Toyo Suisan Kaisha Ltd	JPY	25.600	1.083.213	0,40
Trend Micro Inc	JPY	2.700	93.938	0,03
Tsuruha Holdings Inc	JPY	500	57.676	0,02
USS Co Ltd	JPY	7.300	122.969	0,04
Yamato Holdings Co Ltd	JPY	7.700	178.925	0,07
Yamazaki Baking Co Ltd	JPY	12.000	294.336	0,11
Total Japan			37.989.987	13,90
Luxemburg				
Millicom International Cellular SA - ADR	SEK	4.219	218.560	0,08
Total Luxemburg			218.560	0,08
Niederlande				
Koninklijke Ahold Delhaize NV	EUR	27.166	615.429	0,22
Total Niederlande			615.429	0,22
Norwegen				
Norsk Hydro ASA	NOK	21.387	92.216	0,03
Orkla ASA	NOK	50.701	524.338	0,19
Telenor ASA	NOK	64.989	1.109.332	0,41
Yara International ASA	NOK	2.321	76.857	0,03
Total Norwegen			1.802.743	0,66
Portugal				
Jeronimo Martins SGPS SA	EUR	1.897	32.513	0,01
Total Portugal			32.513	0,01
Singapur				
ComfortDelGro Corp Ltd	SGD	220.700	455.775	0,17
DBS Group Holdings Ltd	SGD	97.200	1.099.555	0,40
Genting Singapore PLC	SGD	73.400	40.483	0,02
Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	SGD	148.100	941.473	0,34
Singapore Airlines Ltd	SGD	144.900	1.118.723	0,41
Singapore Press Holdings Ltd	SGD	299.700	838.664	0,31
Singapore Telecommunications Ltd	SGD	740.200	2.160.585	0,79
StarHub Ltd	SGD	305.300	768.970	0,28
United Overseas Bank Ltd	SGD	45.200	625.366	0,23
Total Singapur			8.049.594	2,95
Südafrika				
Mondi PLC	GBP	34.875	733.224	0,27
Total Südafrika			733.224	0,27
Spanien				
Enagas SA	EUR	2.371	71.215	0,03
Endesa SA	EUR	31.802	678.033	0,25
Ferrovial SA	EUR	3.246	68.388	0,02
Iberdrola SA	EUR	147.163	997.857	0,36
Industria de Diseno Textil SA	EUR	15.133	557.415	0,20
Mapfre SA	EUR	87.104	238.533	0,09
Red Electrica Corp SA	EUR	18.688	402.627	0,15
Total Spanien			3.014.068	1,10
Schweden				
Assa Abloy AB	SEK	3.847	77.817	0,03
Atlas Copco AB	SEK	8.473	252.749	0,09
Hennes & Mauritz AB	SEK	56.645	1.580.275	0,58
ICA Gruppen AB	SEK	19.909	651.580	0,24
Skanska AB	SEK	2.559	59.448	0,02

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Defensive Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Schweden (Fortsetzung)				
Svenska Cellulosa AB SCA	SEK	5.757	169.721	0,06
Swedish Match AB	SEK	33.298	1.217.277	0,45
Telé2 AB	SEK	94.045	805.595	0,30
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	SEK	58.785	421.454	0,15
Telia Co AB	SEK	154.149	684.445	0,25
Total Schweden			5.920.361	2,17
Schweiz				
ABB Ltd	CHF	11.950	266.732	0,10
Actelion Ltd	CHF	3.719	643.168	0,24
Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	CHF	36	206.355	0,08
Coca-Cola HBC AG	GBP	12.570	289.904	0,11
Geberit AG	CHF	397	173.505	0,06
Kuehne + Nagel International AG	CHF	8.960	1.293.909	0,47
Nestle SA	CHF	29.636	2.336.752	0,86
Novartis AG	CHF	8.823	690.681	0,25
Roche Holding AG	CHF	6.461	1.595.202	0,58
Schindler Holding AG	CHF	2.877	535.483	0,20
SGS SA	CHF	47	104.617	0,04
Sika AG	CHF	57	275.239	0,10
Sonova Holding AG	CHF	6.086	853.802	0,31
Swisscom AG	CHF	1.049	494.003	0,18
Wolseley PLC	GBP	1.651	92.856	0,03
Total Schweiz			9.852.208	3,61
Vereinigtes Königreich				
Admiral Group PLC	GBP	9.061	243.675	0,09
Associated British Foods PLC	GBP	20.655	691.754	0,25
AstraZeneca PLC	GBP	14.694	951.639	0,35
BAE Systems PLC	GBP	23.294	157.903	0,06
British American Tobacco PLC	GBP	10.121	648.022	0,24
BT Group PLC	GBP	188.576	947.337	0,35
Bunzl PLC	GBP	19.300	571.185	0,21
Centrica PLC	GBP	31.129	92.329	0,03
Compass Group PLC	GBP	8.799	170.310	0,06
Diageo PLC	GBP	37.167	1.066.417	0,39
Direct Line Insurance Group PLC	GBP	6.331	29.885	0,01
easyJet PLC	GBP	9.808	129.150	0,05
GlaxoSmithKline PLC	GBP	31.294	664.641	0,24
HSBC Holdings PLC	GBP	156.821	1.171.993	0,43
Imperial Brands PLC	GBP	705	36.204	0,01
Kingfisher PLC	GBP	87.499	425.985	0,16
National Grid PLC	GBP	70.964	1.010.951	0,37
Next PLC	GBP	4.532	279.903	0,10
Reckitt Benckiser Group PLC	GBP	17.560	1.655.072	0,61
Royal Mail PLC	GBP	195.294	1.228.988	0,45
Sky PLC	GBP	12.938	150.203	0,06
Smith & Nephew PLC	GBP	62.567	1.006.681	0,37
SSE PLC	GBP	13.552	276.474	0,10
Tate & Lyle PLC	GBP	6.019	57.958	0,02
Travis Perkins PLC	GBP	1.898	37.587	0,01
Unilever NV - AQR	EUR	3.008	138.143	0,05
Vodafone Group PLC	GBP	131.837	378.531	0,14
William Hill PLC	GBP	10.278	40.388	0,01
WPP PLC	GBP	12.153	284.677	0,10
Total Vereinigtes Königreich			14.543.985	5,32
Vereinigte Staaten				
3M Co	USD	7.824	1.381.327	0,51
Abbott Laboratories	USD	10.668	446.029	0,16
Accenture PLC	USD	5.417	661.687	0,24
Adobe Systems Inc	USD	526	56.582	0,02
Aetna Inc	USD	1.367	157.191	0,06
Alleghany Corp	USD	54	28.212	0,01
Alliant Energy Corp	USD	3.738	145.259	0,05
Alphabet Inc	USD	242	194.416	0,07
Altria Group Inc	USD	19.050	1.199.007	0,44
Ameren Corp	USD	9.170	454.282	0,17
American Electric Power Co Inc	USD	18.632	1.200.460	0,44
American Water Works Co Inc	USD	10.128	757.574	0,28
AmerisourceBergen Corp	USD	2.296	182.440	0,07
Anthem Inc	USD	4.422	550.008	0,20
Apple Inc	USD	735	82.945	0,03
Archer-Daniels-Midland Co	USD	2.256	94.391	0,03
AT&T Inc	USD	60.148	2.460.354	0,90
Atmos Energy Corp	USD	3.629	272.102	0,10
Automatic Data Processing Inc	USD	4.688	408.653	0,15
AutoZone Inc	USD	335	256.322	0,09
Avery Dennison Corp	USD	16.053	1.240.576	0,45
Axis Capital Holdings Ltd	USD	18.929	1.021.220	0,37
Baxter International Inc	USD	1.490	70.119	0,03
Becton Dickinson and Co	USD	4.070	721.041	0,26
Bed Bath & Beyond Inc	USD	2.236	95.075	0,03
Best Buy Co Inc	USD	3.296	124.457	0,05
Biogen Inc	USD	469	144.471	0,05
Bristol-Myers Squibb Co	USD	12.741	686.867	0,25
Brown-Forman Corp	USD	6.274	296.760	0,11
Campbell Soup Co	USD	10.573	577.074	0,21
Cardinal Health Inc	USD	2.353	180.993	0,07
Cerner Corp	USD	1.737	106.860	0,04
CH Robinson Worldwide Inc	USD	23.833	1.684.993	0,62
Chipotle Mexican Grill Inc	USD	587	246.012	0,09
Chubb Ltd	USD	802	100.178	0,04
Church & Dwight Co Inc	USD	24.156	1.151.517	0,42
Cintas Corp	USD	6.140	685.347	0,25
Cisco Systems Inc	USD	15.539	490.644	0,18

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Defensive Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Markt- wert in USD	% des Netto- vermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
CMS Energy Corp	USD	3.038	128.659	0,05
Colgate-Palmolive Co	USD	34.421	2.544.056	0,93
ConAgra Foods Inc	USD	1.212	56.540	0,02
Consolidated Edison Inc	USD	19.612	1.486.982	0,54
Core Laboratories NV	USD	1.491	165.844	0,06
Costco Wholesale Corp	USD	14.166	2.173.064	0,79
CR Bard Inc	USD	4.294	954.256	0,35
CVS Health Corp	USD	8.193	725.490	0,27
Danaher Corp	USD	11.225	870.499	0,32
Darden Restaurants Inc	USD	1.827	110.734	0,04
DENTSPLY SIRONA Inc	USD	777	45.991	0,02
Dick's Sporting Goods Inc	USD	4.125	233.145	0,08
Dominion Resources Inc	USD	14.581	1.091.825	0,40
Dr Pepper Snapple Group Inc	USD	4.311	391.309	0,14
DTE Energy Co	USD	8.180	768.838	0,28
Duke Energy Corp	USD	21.895	1.754.665	0,64
Edison International	USD	13.598	993.198	0,36
Edwards Lifesciences Corp	USD	5.241	627.872	0,23
Eli Lilly & Co	USD	16.882	1.351.066	0,49
Emerson Electric Co	USD	8.053	431.319	0,16
EOG Resources Inc	USD	1.403	134.520	0,05
Equifax Inc	USD	3.400	454.954	0,17
Everest Re Group Ltd	USD	4.154	789.675	0,29
Eversource Energy	USD	13.471	735.786	0,27
Exelon Corp	USD	7.072	235.851	0,09
Expeditors International of Washington Inc	USD	19.465	1.002.253	0,37
Express Scripts Holding Co	USD	7.058	486.790	0,18
Exxon Mobil Corp	USD	6.334	551.311	0,20
F5 Networks Inc	USD	7.787	963.563	0,35
Facebook Inc	USD	3.171	404.715	0,15
Fastenal Co	USD	5.578	231.320	0,08
FedEx Corp	USD	5.441	949.890	0,35
Franklin Resources Inc	USD	4.967	173.150	0,06
Gartner Inc	USD	3.020	265.760	0,10
General Mills Inc	USD	15.483	986.886	0,36
Genuine Parts Co	USD	2.209	221.452	0,08
H&R Block Inc	USD	10.652	241.268	0,09
Henry Schein Inc	USD	4.843	782.919	0,29
Honeywell International Inc	USD	6.238	725.417	0,27
Hormel Foods Corp	USD	9.438	358.455	0,13
HP Inc	USD	13.491	209.515	0,08
IDEXX Laboratories Inc	USD	2.950	329.751	0,12
Illinois Tool Works Inc	USD	4.876	584.194	0,21
Illumina Inc	USD	1.610	286.161	0,10
Intel Corp	USD	12.177	459.073	0,17
International Business Machines Corp	USD	4.826	768.106	0,28
Intuit Inc	USD	2.976	325.277	0,12
Intuitive Surgical Inc	USD	1.442	1.037.750	0,38
Jazz Pharmaceuticals PLC	USD	1.812	221.771	0,08
Johnson & Johnson	USD	24.396	2.883.607	1,06
Kellogg Co	USD	7.162	555.485	0,20
Kimberly-Clark Corp	USD	5.828	732.929	0,27
L Brands Inc	USD	1.564	108.729	0,04
Lowe's Cos Inc	USD	4.661	332.889	0,12
lululemon athletica Inc	USD	8.349	505.782	0,18
Marathon Petroleum Corp	USD	2.957	118.369	0,04
McCormick & Co Inc	USD	4.285	428.157	0,16
McDonald's Corp	USD	9.256	1.068.050	0,39
McKesson Corp	USD	2.215	362.330	0,13
Mead Johnson Nutrition Co	USD	12.094	950.226	0,35
Medtronic PLC	USD	2.440	209.108	0,08
Merck & Co Inc	USD	16.556	1.032.101	0,38
Mettler-Toledo International Inc	USD	1.231	506.101	0,18
Michael Kors Holdings Ltd	USD	9.507	444.167	0,16
Microsfutures Corp	USD	1.295	74.281	0,03
Mondelez International Inc	USD	2.109	91.763	0,03
Monster Beverage Corp	USD	3.365	489.708	0,18
NetApp Inc	USD	18.280	645.467	0,24
Newmont Mining Corp	USD	21.243	839.523	0,31
NextEra Energy Inc	USD	7.811	968.408	0,35
NIKE Inc	USD	4.317	226.556	0,08
Northrop Grumman Corp	USD	4.095	869.246	0,32
NVIDIA Corp	USD	10.664	730.804	0,27
Oracle Corp	USD	1.275	50.005	0,02
Paychex Inc	USD	3.901	223.371	0,08
PepsiCo Inc	USD	29.031	3.147.831	1,15
Pfizer Inc	USD	30.057	1.010.817	0,37
PG&E Corp	USD	14.482	895.857	0,33
Philip Morris International Inc	USD	18.406	1.801.395	0,66
Pinnacle West Capital Corp	USD	6.470	497.025	0,18
PPL Corp	USD	7.819	272.414	0,10
Public Service Enterprise Group Inc	USD	31.317	1.320.012	0,48
Ralph Lauren Corp	USD	1.648	165.608	0,06
Raytheon Co	USD	9.170	1.239.234	0,45
Republic Services Inc	USD	5.016	252.154	0,09
ResMed Inc	USD	18.126	1.178.371	0,43
Reynolds American Inc	USD	5.182	244.072	0,09
Robert Half International Inc	USD	20.433	761.129	0,28
Rockwell Automation Inc	USD	1.966	236.333	0,09
Roper Technologies Inc	USD	542	98.162	0,04
Ross Stores Inc	USD	3.267	207.945	0,08
SCANA Corp	USD	5.177	377.300	0,14
Sempra Energy	USD	1.211	130.207	0,05
Skyworks Solutions Inc	USD	2.883	214.207	0,08
Southwest Airlines Co	USD	3.400	129.404	0,05
Stanley Black & Decker Inc	USD	649	79.321	0,03
Starbucks Corp	USD	5.573	300.440	0,11

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Defensive Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
USA (Fortsetzung)				
Stryker Corp	USD	12.988	1.507.907	0,55
Sysco Corp	USD	39.456	1.922.296	0,70
T Rowe Price Group Inc	USD	2.136	140.474	0,05
Target Corp	USD	3.283	223.014	0,08
Texas Instruments Inc	USD	2.579	180.994	0,07
The Allstate Corp	USD	1.923	132.668	0,05
The Clorox Co	USD	7.341	918.726	0,34
The Coca-Cola Co	USD	51.500	2.166.090	0,79
The Estee Lauder Cos Inc	USD	18.128	1.592.726	0,58
The Gap Inc	USD	3.639	79.621	0,03
The Hershey Co	USD	14.604	1.390.009	0,51
The Home Depot Inc	USD	1.288	164.478	0,06
The Kroger Co	USD	13.748	409.690	0,15
The Procter & Gamble Co	USD	29.325	2.619.602	0,96
The Sherwin-Williams Co	USD	799	220.268	0,08
The Southern Co	USD	43.490	2.255.826	0,83
The TJX Cos Inc	USD	16.567	1.229.934	0,45
The Travelers Cos Inc	USD	2.426	277.486	0,10
The Walt Disney Co	USD	2.695	249.746	0,09
Thermo Fisher Scientific Inc	USD	540	85.028	0,03
Thomson Reuters Corp	CAD	9.902	407.410	0,15
UGI Corp	USD	1.767	81.052	0,03
Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	USD	257	61.256	0,02
United Continental Holdings Inc	USD	3.636	187.181	0,07
United Parcel Service Inc	USD	5.563	605.087	0,22
United Technologies Corp	USD	3.082	311.744	0,11
United Therapeutics Corp	USD	12.000	1.383.960	0,51
UnitedHealth Group Inc	USD	7.608	1.054.621	0,39
US Bancorp	USD	1.939	82.737	0,03
Varian Medical Systems Inc	USD	12.587	1.250.015	0,46
Verizon Communications Inc	USD	28.332	1.485.163	0,54
VF Corp	USD	1.187	66.496	0,02
Viacom Inc	USD	1.231	46.298	0,02
Visa Inc	USD	818	66.986	0,02
VMware Inc	USD	4.353	318.074	0,12
Walgreens Boots Alliance Inc	USD	4.107	325.973	0,12
Wal-Mart Stores Inc	USD	36.614	2.635.842	0,96
Waste Management Inc	USD	7.122	451.606	0,16
Waters Corp	USD	2.189	343.126	0,13
WEC Energy Group Inc	USD	15.764	951.515	0,35
Wells Fargo & Co	USD	11.718	517.350	0,19
Whole Foods Market Inc	USD	44.530	1.246.395	0,46
WR Berkley Corp	USD	3.644	210.259	0,08
WW Grainger Inc	USD	1.835	409.407	0,15
Xcel Energy Inc	USD	24.744	1.032.815	0,38
Yum! Brands Inc	USD	8.451	762.280	0,28
Total Vereinigte Staaten			116.503.961	42,64
Total Stammaktien			264.796.897	96,92
Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Total Anlagen (Gesamtkosten: \$245.482.662)				
Sonstige Vermögenswerte/(Verbindlichkeiten)			8.411.278	3,08
Nettovermögen			273.208.175	100,00

ADR-American Depositary Receipt

Derivate

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Börsengehandelte Futures

Beschreibung Nominalbetrag	Gegenpartei	Währung	Anzahl Kontrakte	Fällig- keitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs (-/verlust) in USD	% des Netto- vermögens
mini MSCI EAFE Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(344.490)	4	16/12/2016	(5.589) (0,00)
mini MSCI EAFE Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(1.350.957)	16	16/12/2016	4.643 0,00
S&P 500 E Mini Index Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(1.721.480)	16	16/12/2016	120 0,00
S&P 500 E Mini Index Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(1.163.800)	11	16/12/2016	19.800 0,01
Total Futures					18.974	0,01

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien				
Australien				
Aristocrat Leisure Ltd	AUD	4.588	55.729	0,09
Australia & New Zealand Banking Group Ltd	AUD	2.510	53.338	0,08
BHP Billiton Ltd	AUD	2.074	35.964	0,06
BHP Billiton PLC	GBP	6.048	91.145	0,14
Caltex Australia Ltd	AUD	4.635	122.176	0,19
CIMIC Group Ltd	AUD	8.471	187.203	0,29
Dexus Property Group	AUD	7.159	50.290	0,08
Fortescue Metals Group Ltd	AUD	29.531	113.107	0,18
Goodman Group (β)	AUD	3.825	21.403	0,03
Macquarie Group Ltd	AUD	516	32.534	0,05
Mirvac Group	AUD	11.748	20.216	0,03
National Australia Bank Ltd	AUD	1.096	23.497	0,04
Newcrest Mining Ltd	AUD	3.394	57.844	0,09
Origin Energy Ltd	AUD	5.690	23.838	0,04
QBE Insurance Group Ltd	AUD	4.000	28.562	0,04
Scentre Group (β)	AUD	19.868	71.682	0,11
South32 Ltd	AUD	29.282	54.498	0,09
Stockland	AUD	13.064	47.784	0,08
Suncorp Group Ltd	AUD	18.763	174.581	0,27
Telstra Corp Ltd	AUD	16.395	65.207	0,10
The GPT Group	AUD	5.900	22.923	0,04
Westfield Corp (β)	AUD	10.164	76.013	0,12
Total Australien			1.429.534	2,24
Belgien				
Ageas	EUR	4.523	162.901	0,26
Anheuser-Busch InBev SA/NV	EUR	242	31.671	0,05
KBC Group NV	EUR	397	22.629	0,03
Proximus SADP	EUR	6.551	193.901	0,30
Total Belgien			411.102	0,64
Bermuda				
Marvell Technology Group Ltd	USD	9.429	127.197	0,20
Total Bermuda			127.197	0,20
Kanada				
Bank of Montreal	CAD	1.021	67.179	0,10
Barrick Gold Corp	CAD	7.685	139.397	0,22
Caneco Corp	CAD	5.700	49.174	0,08
Canadian Imperial Bank of Commerce	CAD	2.411	187.013	0,29
Canadian Tire Corp Ltd	CAD	603	60.029	0,09
Cenovus Energy Inc	CAD	15.924	225.195	0,35
CGI Group Inc	CAD	880	42.033	0,07
Dollarama Inc	CAD	241	19.063	0,03
Fairfax Financial Holdings Ltd	CAD	63	36.279	0,06
Fining International Inc	CAD	1.311	24.430	0,04
First Quantum Minerals Ltd	CAD	15.125	124.715	0,20
Husky Energy Inc	CAD	2.174	26.416	0,04
Imperial Oil Ltd	CAD	2.789	87.925	0,14
Industrial Alliance Insurance & Financial Services Inc	CAD	4.530	163.439	0,26
Intact Financial Corp	CAD	446	32.448	0,05
Kinross Gold Corp	CAD	26.893	114.977	0,18
Magna International Inc	CAD	457	19.340	0,03
Open Text Corp	CAD	295	19.165	0,03
Saputo Inc	CAD	1.074	37.381	0,06
SNC-Lavalin Group Inc	CAD	432	16.707	0,03
Sun Life Financial Inc	CAD	617	20.049	0,03
Suncor Energy Inc	CAD	4.964	137.901	0,22
Teck Resources Ltd	CAD	1.055	19.193	0,03
The Bank of Nova Scotia	CAD	344	18.370	0,03
TransCanada Corp	CAD	407	19.546	0,03
Turquoise Hill Resources Ltd	CAD	25.471	76.938	0,12
Yamana Gold Inc	CAD	20.616	92.151	0,14
Total Kanada			1.876.453	2,95
China				
Yangzijiang Shipbuilding Holdings Ltd	SGD	192.800	106.363	0,17
Total China			106.363	0,17
Dänemark				
Carlsberg A/S	DKK	1.047	99.203	0,16
Danske Bank A/S	DKK	638	18.457	0,03
ISS A/S	DKK	3.938	161.638	0,25
Novo Nordisk A/S	DKK	547	22.658	0,03
TDC A/S	DKK	39.234	229.778	0,36
Vestas Wind Systems A/S	DKK	2.172	178.499	0,28
Total Dänemark			710.233	1,11
Finnland				
Elisa OYJ	EUR	884	32.225	0,05
Fortum OYJ	EUR	6.961	111.816	0,18
Neste OYJ	EUR	2.545	108.264	0,17
Nokia OYJ	EUR	3.563	20.449	0,03
Orion OYJ	EUR	562	21.948	0,03
Stora Enso OYJ	EUR	5.135	45.214	0,07
UPM-Kymmene OYJ	EUR	4.012	84.144	0,13
Total Finnland			424.060	0,66
Frankreich				
Atos SE	EUR	3.973	426.916	0,67
BNP Paribas SA	EUR	7.137	358.930	0,56
Capgemini SA	EUR	748	73.006	0,12
Cie de Saint-Gobain	EUR	1.807	77.427	0,12
Cie Générale des Etablissements Michelin	EUR	1.912	209.782	0,33

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Frankreich (Fortsetzung)				
CNP Assurances	EUR	7.424	123.789	0,20
Eiffage SA	EUR	713	54.828	0,09
Lagardere SCA	EUR	4.935	124.744	0,20
Orange SA	EUR	10.353	160.500	0,25
Peugeot SA	EUR	8.184	122.930	0,19
Renault SA	EUR	568	45.963	0,07
Sanofi	EUR	626	47.274	0,08
Societe Generale SA	EUR	5.858	199.031	0,31
Sodexo SA	EUR	228	26.848	0,04
Thales SA	EUR	708	65.109	0,10
Unibail-Rodamco SE (p)	EUR	230	61.619	0,10
Veolia Environnement SA	EUR	3.127	71.962	0,11
Vinci SA	EUR	438	33.347	0,05
Total Frankreich			2.284.005	3,59
Deutschland				
Allianz SE	EUR	1.629	237.475	0,37
BASF SE	EUR	840	71.015	0,11
Bayer AG	EUR	1.958	192.749	0,30
Commerzbank AG	EUR	8.510	53.315	0,08
Continental AG	EUR	93	19.275	0,03
Covestro AG	EUR	1.028	59.737	0,09
Deutsche Post AG	EUR	3.214	99.313	0,16
Deutsche Telekom AG	EUR	4.801	79.676	0,13
E.ON Se	EUR	24.651	173.367	0,27
Evonik Industries Ag	EUR	9.842	329.041	0,52
HeidelbergCement AG	EUR	472	44.142	0,07
Henkel Ag & Co Kgaa Vorzug	EUR	376	50.704	0,08
HOCHTIEF AG	EUR	204	28.630	0,05
METRO AG	EUR	963	28.466	0,05
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	EUR	1.178	216.625	0,34
OSRAM Licht AG	EUR	3.316	192.507	0,30
Siemens Ag-Reg	EUR	1.562	181.133	0,28
Uniper SE	EUR	2.465	29.883	0,05
Total Deutschland			2.087.053	3,28
Hongkong				
Cheung Kong Property Holdings Ltd	HKD	5.500	40.350	0,06
Kerry Properties Ltd	HKD	27.000	88.692	0,14
Li & Fung Ltd	HKD	134.000	68.849	0,11
New World Development Co Ltd	HKD	151.000	197.059	0,31
Sino Land Co Ltd	HKD	32.000	56.845	0,09
Sun Hung Kai Properties Ltd	HKD	1.000	15.157	0,02
Swire Properties Ltd	HKD	10.200	29.928	0,05
Techtronic Industries Co Ltd	HKD	6.000	23.505	0,04
The Wharf Holdings Ltd	HKD	7.000	51.163	0,08
WH Group Ltd	HKD	103.000	83.059	0,13
Wheelock & Co Ltd	HKD	17.000	100.563	0,16
Yue Yuen Industrial Holdings Ltd	HKD	34.000	140.496	0,22
Total Hongkong			895.666	1,41
Italien				
Assicurazioni Generali SpA	EUR	2.792	33.425	0,05
Enei SpA	EUR	68.605	304.996	0,48
Mediobanca SpA	EUR	3.870	24.489	0,04
Prysmian SpA	EUR	809	21.148	0,03
Snam SpA	EUR	34.277	189.424	0,30
Total Italien			573.482	0,90
Japan				
Ajinomoto Co Inc	JPY	4.400	97.802	0,15
Amada Holdings Co Ltd	JPY	15.000	155.405	0,24
Asahi Group Holdings Ltd	JPY	1.300	47.238	0,07
Astellas Pharma Inc	JPY	11.000	171.476	0,27
Bandai Namco Holdings Inc	JPY	4.200	128.134	0,20
Chubu Electric Power Co Inc	JPY	3.100	45.104	0,07
Daiichi Sankyo Co Inc	JPY	2.000	47.904	0,08
Fuji Heavy Industries Ltd	JPY	4.200	156.685	0,25
FUJIFILM Holdings Corp	JPY	600	22.138	0,03
Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	JPY	600	32.324	0,05
Hitachi Chemical Co Ltd	JPY	9.100	208.246	0,33
Hitachi Construction Machinery Co Ltd	JPY	2.000	39.697	0,06
Hitachi High-Technologies Corp	JPY	4.900	195.329	0,31
Hoya Corp	JPY	1.700	68.097	0,11
Isetan Mitsukoshi Holdings Ltd	JPY	2.700	26.483	0,04
Japan Airlines Co Ltd	JPY	1.700	49.838	0,08
Japan Tobacco Inc	JPY	1.700	69.465	0,11
JTEKT Corp	JPY	7.500	111.983	0,18
Kaneka Corp	JPY	14.000	110.461	0,17
Kirin Holdings Co Ltd	JPY	2.000	33.144	0,05
Komatsu Ltd	JPY	1.700	38.719	0,06
Konami Holdings Corp	JPY	2.900	111.810	0,18
Kyocera Corp	JPY	1.900	90.920	0,14
Mazda Motor Corp	JPY	6.500	98.835	0,16
MEIJI Holdings Co Ltd	JPY	1.100	108.931	0,17
Mitsubishi Chemical Holdings Corp	JPY	3.200	19.970	0,03
Mitsubishi Electric Corp	JPY	5.000	63.721	0,10
Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	JPY	6.500	92.908	0,15
Mitsubishi Motors Corp	JPY	1.300	6.053	0,01
Mitsubishi Tanabe Pharma Corp	JPY	4.200	89.714	0,14
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	JPY	11.300	56.632	0,09
Mitsui Chemicals Inc	JPY	44.000	208.484	0,33
Mixi Inc	JPY	2.500	90.225	0,14
Mizuho Financial Group Inc	JPY	15.600	26.076	0,04
MS&AD Insurance Group Holdings Inc	JPY	6.800	188.534	0,30

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden Stammaktien (Fortsetzung)				
Japan (Fortsetzung)				
Nexon Co Ltd	JPY	6.100	95.301	0,15
NHK Spring Co Ltd	JPY	2.800	27.037	0,04
Nikon Corp	JPY	1.300	19.374	0,03
Nippon Building Fund Inc (..)	JPY	4	25.361	0,04
Nippon Express Co Ltd	JPY	8.000	37.275	0,06
Nippon Telegraph & Telephone Corp	JPY	5.100	232.529	0,36
Nisshin Seifun Group Inc	JPY	2.900	44.083	0,07
NSK Ltd	JPY	3.800	38.745	0,06
NTT DOCOMO Inc	JPY	900	22.778	0,04
Obayashi Corp	JPY	4.900	48.415	0,08
ORIX Corp	JPY	1.400	20.544	0,03
Panasonic Corp	JPY	11.800	117.503	0,18
Resona Holdings Inc	JPY	25.600	107.225	0,17
Secom Co Ltd	JPY	500	37.200	0,06
Seiko Epson Corp	JPY	6.500	124.646	0,20
Seven & i Holdings Co Ltd	JPY	1.400	66.016	0,10
Shimamura Co Ltd	JPY	800	97.176	0,15
Shionogi & Co Ltd	JPY	2.400	122.655	0,19
SoftBank Group Corp	JPY	1.700	109.879	0,17
Sompo Japan Nipponkoa Holdings Inc	JPY	1.600	47.114	0,07
Sony Corp	JPY	600	19.673	0,03
Sumitomo Chemical Co Ltd	JPY	10.000	44.239	0,07
Sumitomo Electric Industries Ltd	JPY	1.300	18.278	0,03
Sumitomo Heavy Industries Ltd	JPY	6.000	29.470	0,05
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	JPY	2.900	97.122	0,15
Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	JPY	500	16.246	0,03
Taisei Corp	JPY	5.000	37.433	0,06
TDK Corp	JPY	800	53.288	0,08
Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	JPY	15.200	65.594	0,10
Toppan Printing Co Ltd	JPY	3.000	26.986	0,04
Toyo Suisan Kaisha Ltd	JPY	1.000	42.313	0,07
Toyota Gosei Co Ltd	JPY	1.000	23.149	0,04
Toyota Motor Corp	JPY	1.800	103.825	0,16
Yamaha Corp	JPY	600	19.342	0,03
Yokogawa Electric Corp	JPY	2.800	37.111	0,06
Total Japan			5.183.410	8,14
Niederlande				
ASML Holding NV	EUR	221	24.102	0,04
ING Groep NV - ADR	EUR	2.551	30.683	0,05
Koninklijke Ahold Delhaize NV	EUR	4.652	105.388	0,17
Koninklijke Philips NV	EUR	3.347	98.279	0,15
NN Group NV	EUR	9.920	302.515	0,47
Randstad Holding NV	EUR	4.234	190.366	0,30
Royal Dutch Shell PLC	GBP	6.870	178.918	0,28
Wolters Kluwer NV	EUR	986	41.889	0,07
Total Niederlande			972.140	1,53
Singapur				
Genting Singapore PLC	SGD	55.000	30.335	0,05
Total Singapur			30.335	0,05
Südafrika				
Investec PLC	GBP	13.955	84.774	0,13
Mondi PLC	GBP	4.588	96.460	0,15
Total Südafrika			181.234	0,28
Spanien				
ACS Actividades de Construcción y Servicios SA	EUR	1.650	49.439	0,08
Banco Santander SA	EUR	42.490	183.753	0,29
Endesa SA	EUR	10.728	228.726	0,36
Iberdrola SA	EUR	19.492	132.168	0,21
Repsol SA	EUR	12.521	169.127	0,26
Total Spanien			763.213	1,20
Schweden				
Boliden AB	SEK	11.705	274.232	0,43
Electrolux AB	SEK	3.417	85.226	0,13
Skanska AB	SEK	2.686	62.398	0,10
SKF AB	SEK	1.739	29.853	0,05
Svenska Cellulosa AB SCA	SEK	1.992	58.726	0,09
Swedish Match AB	SEK	11.131	406.916	0,64
Total Schweden			917.351	1,44
Schweiz				
ABB Ltd	CHF	10.707	238.987	0,38
Adecco Group AG	CHF	5.909	327.754	0,51
Coca-Cola HBC AG	GBP	8.222	189.625	0,30
Galenic AG	CHF	86	91.771	0,14
Glencore PLC	GBP	59.240	163.474	0,26
Lonza Group AG	CHF	346	65.683	0,10
Nestle SA	CHF	8.847	697.572	1,10
Novartis AG	CHF	1.139	89.163	0,14
Roche Holding AG	CHF	1.823	450.093	0,71
SGS SA	CHF	10	22.259	0,03
Sika AG	CHF	8	38.630	0,06
Swiss Life Holding AG	CHF	307	78.264	0,12
Swiss Re AG	CHF	890	79.663	0,13
Syngenta AG	CHF	59	25.810	0,04
UBS Group AG	CHF	1.981	26.567	0,04
Total Schweiz			2.585.315	4,06
Vereinigtes Königreich				
Anglo American PLC	GBP	12.584	158.775	0,25

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigtes Königreich (Fortsetzung)				
Barclays PLC	GBP	50.860	108.350	0,17
BP PLC	GBP	51.431	300.547	0,47
Centrica PLC	GBP	26.212	77.745	0,12
Diageo PLC	GBP	1.164	33.398	0,05
Dixons Carphone PLC	GBP	10.178	48.216	0,08
Fiat Chrysler Automobiles NV	EUR	25.265	155.481	0,24
GlaxoSmithKline PLC	GBP	8.945	189.979	0,30
HSBC Holdings PLC	GBP	14.767	110.360	0,17
Imperial Brands PLC	GBP	2.959	151.954	0,24
International Consolidated Airlines Group SA	EUR	26.559	135.043	0,21
Johnson Matthey PLC	GBP	2.087	88.216	0,14
Kingfisher PLC	GBP	10.676	51.976	0,08
Persimmon PLC	GBP	12.193	283.584	0,45
Rio Tinto PLC	GBP	5.212	174.351	0,27
Royal Mail PLC	GBP	34.035	214.183	0,34
SABMiller PLC	GBP	1.802	105.163	0,17
Sky PLC	GBP	13.864	160.954	0,25
Tate & Lyle PLC	GBP	11.045	106.354	0,17
Taylor Wimpey PLC	GBP	33.462	66.093	0,10
The Sage Group PLC	GBP	26.007	248.398	0,39
Unilever NV - AQR	EUR	961	44.134	0,07
Unilever PLC	GBP	2.346	111.076	0,18
William Hill PLC	GBP	56.935	223.730	0,35
Wm Morrison Supermarkets PLC	GBP	33.371	93.562	0,15
WPP PLC	GBP	3.918	91.777	0,14
Total Vereinigtes Königreich			3.533.399	5,55
Vereinigte Staaten				
AES Corp/VA	USD	4.568	59.224	0,09
Aflac Inc	USD	1.192	85.598	0,13
Agilent Technologies Inc	USD	2.793	129.483	0,20
Akamai Technologies Inc	USD	544	28.435	0,04
Alphabet Inc	USD	576	446.630	0,70
Alphabet Inc	USD	558	448.280	0,70
Altria Group Inc	USD	4.441	279.517	0,44
Amazon.com Inc	USD	823	686.950	1,08
Ameren Corp	USD	3.975	196.922	0,31
American Electric Power Co Inc	USD	6.751	434.967	0,68
American Tower Corp (β)	USD	299	34.008	0,05
AmerisourceBergen Corp	USD	275	21.852	0,03
Amgen Inc	USD	593	98.213	0,15
Analog Devices Inc	USD	1.490	96.090	0,15
Annaly Capital Management Inc	USD	22.819	236.747	0,37
Anthem Inc	USD	1.390	172.888	0,27
AO Smith Corp	USD	194	19.072	0,03
Apple Inc	USD	10.946	1.235.256	1,94
Applied Materials Inc	USD	15.980	476.364	0,75
Archer-Daniels-Midland Co	USD	7.563	316.436	0,50
Arrow Electronics Inc	USD	2.782	177.742	0,28
AT&T Inc	USD	7.242	296.234	0,46
AvalonBay Communities Inc (β)	USD	162	28.865	0,05
Avery Dennison Corp	USD	834	64.452	0,10
Avnet Inc	USD	3.653	149.152	0,23
Axis Capital Holdings Ltd	USD	800	43.160	0,07
Baxter International Inc	USD	2.096	98.638	0,15
Berkshire Hathaway Inc	USD	2.184	315.850	0,50
Best Buy Co Inc	USD	4.259	160.820	0,25
Biogen Inc	USD	744	229.182	0,36
Boston Properties Inc (β)	USD	201	27.366	0,04
Bunge Ltd	USD	3.179	187.052	0,29
Campbell Soup Co	USD	1.902	103.811	0,16
Cardinal Health Inc	USD	433	33.306	0,05
Carnival Corp	USD	811	39.447	0,06
Celanese Corp	USD	2.488	163.835	0,26
Celgene Corp	USD	215	22.210	0,03
CenterPoint Energy Inc	USD	7.786	183.360	0,29
CenturyLink Inc	USD	2.720	75.126	0,12
Charter Communications Inc	USD	397	107.254	0,17
Chevron Corp	USD	2.182	222.324	0,35
Cigna Corp	USD	163	21.281	0,03
Cisco Systems Inc	USD	13.091	413.348	0,65
Citigroup Inc	USD	2.295	106.304	0,17
Citrix Systems Inc	USD	915	78.168	0,12
Cognizant Technology Solutions Corp	USD	2.588	123.111	0,19
Comcast Corp	USD	850	56.389	0,09
Comerica Inc	USD	1.132	53.057	0,08
ConAgra Foods Inc	USD	5.270	245.845	0,39
ConocoPhillips	USD	1.771	77.304	0,12
Crown Castle International Corp (β)	USD	354	33.180	0,05
Crown Holdings Inc	USD	1.960	111.465	0,17
CSX Corp	USD	978	29.536	0,05
Cummins Inc	USD	2.393	302.714	0,48
DaVita Inc	USD	398	25.846	0,04
Dell Technologies Inc - VMware Inc	USD	400	19.060	0,03
Delta Air Lines Inc	USD	6.131	239.048	0,38
DR Horton Inc	USD	4.625	138.981	0,22
DTE Energy Co	USD	596	56.018	0,09
Eastman Chemical Co	USD	1.186	79.415	0,12
Eaton Corp PLC	USD	1.677	108.519	0,17
eBay Inc	USD	8.702	285.861	0,45
Edison International	USD	1.225	89.474	0,14
El du Pont de Nemours & Co	USD	1.621	108.331	0,17
Emerson Electric Co	USD	1.380	73.913	0,12
Entergy Corp	USD	4.790	370.123	0,58
Equinix Inc (β)	USD	74	26.542	0,04
Equity Residential (β)	USD	2.155	138.480	0,22

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Everest Re Group Ltd	USD	655	124.516	0,20
Eversource Energy	USD	1.798	98.207	0,15
Exelon Corp	USD	7.527	251.025	0,39
Exxon Mobil Corp	USD	6.218	541.215	0,85
F5 Networks Inc	USD	638	78.946	0,12
Facebook Inc	USD	4.370	557.743	0,88
FirstEnergy Corp	USD	13.863	460.113	0,72
Flextronics International Ltd	USD	10.578	141.481	0,22
Ford Motor Co	USD	2.084	25.102	0,04
Freeport-McMoRan Inc	USD	6.568	72.051	0,11
General Electric Co	USD	6.167	182.636	0,29
General Mills Inc	USD	1.723	109.824	0,17
General Motors Co	USD	9.014	285.383	0,45
Gilead Sciences Inc	USD	5.563	437.975	0,69
H&R Block Inc	USD	7.299	165.322	0,26
Hasbro Inc	USD	479	37.879	0,06
HCP Inc (ß)	USD	2.486	95.288	0,15
Hilton Worldwide Holdings Inc	USD	1.376	31.483	0,05
Honeywell International Inc	USD	572	66.518	0,10
Host Hotels & Resorts Inc (ß)	USD	2.588	40.347	0,06
HP Inc	USD	40.292	625.735	0,98
Ingersoll-Rand PLC	USD	572	38.518	0,06
Ingredion Inc	USD	1.847	243.730	0,38
Intel Corp	USD	14.445	544.576	0,85
International Business Machines Corp	USD	1.505	239.536	0,38
International Paper Co	USD	2.543	120.742	0,19
Invesco Ltd	USD	1.334	40.874	0,06
Jacobs Engineering Group Inc	USD	2.094	108.679	0,17
Jazz Pharmaceuticals PLC	USD	390	47.732	0,07
Johnson & Johnson	USD	5.946	702.817	1,10
JPMorgan Chase & Co	USD	5.504	364.750	0,57
Juniper Networks Inc	USD	2.829	67.302	0,11
Kimberly-Clark Corp	USD	906	113.939	0,18
Kinder Morgan Inc/DE	USD	6.457	147.155	0,23
L-3 Communications Holdings Inc	USD	1.937	290.918	0,46
Las Vegas Sands Corp	USD	3.941	223.652	0,35
Lear Corp	USD	2.703	323.549	0,51
Level 3 Communications Inc	USD	690	32.120	0,05
Lincoln National Corp	USD	2.881	132.699	0,21
LinkedIn Corp	USD	246	47.018	0,07
Lowe's Cos Inc	USD	1.743	124.485	0,20
LyondellBasell Industries NV	USD	2.890	232.905	0,37
Macy's Inc	USD	2.997	109.840	0,17
Mallinckrodt PLC	USD	1.877	129.513	0,20
ManpowerGroup Inc	USD	1.880	133.160	0,21
Marathon Petroleum Corp	USD	2.642	105.759	0,17
Masco Corp	USD	2.381	80.954	0,13
Maxim Integrated Products Inc	USD	3.441	137.227	0,22
McKesson Corp	USD	814	133.154	0,21
Merck & Co Inc	USD	4.924	306.962	0,48
MetLife Inc	USD	1.338	58.778	0,09
MGM Resorts International	USD	859	22.214	0,03
Michael Kors Holdings Ltd	USD	4.297	200.756	0,32
Microsfutures Corp	USD	17.197	986.420	1,55
Mondelez International Inc	USD	4.385	190.791	0,30
Monsanto Co	USD	273	27.783	0,04
MSCI Inc	USD	224	18.809	0,03
Mylan NV	USD	702	26.781	0,04
Newmont Mining Corp	USD	2.439	96.389	0,15
News Corp	USD	6.383	89.107	0,14
Northrop Grumman Corp	USD	710	150.712	0,24
Nuance Communications Inc	USD	7.314	104.956	0,16
Nucor Corp	USD	2.063	100.984	0,16
OGE Energy Corp	USD	821	26.321	0,04
Oracle Corp	USD	4.153	162.881	0,26
Parker-Hannifin Corp	USD	708	88.719	0,14
PepsiCo Inc	USD	5.609	608.184	0,95
Pfizer Inc	USD	14.324	481.716	0,76
PG&E Corp	USD	810	50.107	0,08
Philip Morris International Inc	USD	1.271	124.393	0,20
Pinnacle West Capital Corp	USD	1.221	93.797	0,15
PPG Industries Inc	USD	470	48.462	0,08
PPL Corp	USD	5.582	194.477	0,31
Prologis Inc (ß)	USD	378	20.352	0,03
Public Service Enterprise Group Inc	USD	5.382	226.851	0,36
Public Storage (ß)	USD	104	23.236	0,04
PVH Corp	USD	1.459	158.068	0,25
QUALCOMM Inc	USD	7.103	494.227	0,78
Quest Diagnostics Inc	USD	1.057	87.837	0,14
Ralph Lauren Corp	USD	319	32.056	0,05
Raytheon Co	USD	1.824	246.495	0,39
Republic Services Inc	USD	3.508	176.347	0,28
Reynolds American Inc	USD	695	32.735	0,05
Robert Half International Inc	USD	4.908	182.823	0,29
SCANA Corp	USD	795	57.940	0,09
Sealed Air Corp	USD	1.244	56.913	0,09
Shire PLC	GBP	1.674	108.378	0,17
Simon Property Group Inc (ß)	USD	558	115.562	0,18
Southwest Airlines Co	USD	10.636	404.806	0,64
St Jude Medical Inc	USD	176	13.955	0,02
Staples Inc	USD	7.110	59.653	0,09
SunTrust Banks Inc	USD	5.269	228.464	0,36
Synchrony Financial	USD	2.457	67.789	0,11
Target Corp	USD	970	65.892	0,10
Tesco Corp	USD	2.579	199.924	0,31
Texas Instruments Inc	USD	1.830	128.429	0,20
The Allstate Corp	USD	1.845	127.287	0,20

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Währung	Anzahl	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
The Coca-Cola Co	USD	6.330	266.240	0,42
The Dow Chemical Co	USD	2.454	127.510	0,20
The Goodyear Tire & Rubber Co	USD	1.191	37.921	0,06
The Hartford Financial Services Group Inc	USD	1.006	42.835	0,07
The Home Depot Inc	USD	935	119.400	0,19
The Interpublic Group of Cos Inc	USD	1.061	23.566	0,04
The JM Smucker Co	USD	440	59.616	0,09
The Kraft Heinz Co	USD	1.120	99.758	0,16
The Macerich Co (β)	USD	305	24.498	0,04
The PNC Financial Services Group Inc	USD	8.687	776.792	1,22
The Priceline Group Inc	USD	13	19.134	0,03
The Procter & Gamble Co	USD	9.283	829.250	1,30
The Progressive Corp	USD	10.345	324.005	0,51
The Sherwin-Williams Co	USD	128	35.287	0,06
The TJX Cos Inc	USD	826	61.322	0,10
The Travelers Cos Inc	USD	1.667	190.671	0,30
The Williams Cos Inc	USD	1.105	33.725	0,05
Time Warner Inc	USD	387	30.767	0,05
Trimble Navigation Ltd	USD	1.149	32.574	0,05
Tyson Foods Inc	USD	7.499	562.500	0,88
UGI Corp	USD	4.515	207.103	0,32
United Continental Holdings Inc	USD	8.682	446.949	0,70
United Technologies Corp	USD	2.588	261.776	0,41
United Therapeutics Corp	USD	1.032	119.021	0,19
UnitedHealth Group Inc	USD	2.534	351.263	0,55
Universal Health Services Inc	USD	288	35.070	0,05
Valeant Pharmaceuticals International Inc	CAD	208	5.231	0,01
Valero Energy Corp	USD	3.779	197.377	0,31
Ventas Inc (β)	USD	406	29.049	0,05
Verizon Communications Inc	USD	9.205	482.526	0,76
Walgreens Boots Alliance Inc	USD	1.035	82.148	0,13
Wal-Mart Stores Inc	USD	6.503	468.151	0,73
Waste Management Inc	USD	5.389	341.716	0,54
Wells Fargo & Co	USD	10.333	456.202	0,72
Welltower Inc (β)	USD	250	18.850	0,03
Weyerhaeuser Co (β)	USD	1.345	42.879	0,07
Whirlpool Corp	USD	825	132.866	0,21
WR Grace & Co	USD	1.440	105.970	0,17
Wyndham Worldwide Corp	USD	423	28.316	0,04
Xerox Corp	USD	15.702	157.648	0,25
Xilinx Inc	USD	2.119	115.231	0,18
Yum! Brands Inc	USD	568	51.234	0,08
Total Vereinigte Staaten			36.500.008	57,30
Total Stammaktien			61.591.553	96,70
Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden auf another regulated market				
Total Anlagen (Gesamtkosten: \$58.895.136)				
Sonstige Vermögenswerte/(Verbindlichkeiten)				
NETTOVERMÖGEN			63.693.583	100,00

(β) Immobilienfonds
ADR-American Depository Receipt

Derivate
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Futures
börsengehandelt

Beschreibung Nominalbetrag	Gegenpartei	Währung	Anzahl Kontrakte	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs /(-verlust) in USD	% des Netto- vermögens	
S&P TSX 60 Index Futures	Goldman Sachs & Co	CAD	(170.724)	1	15/12/2016	683	0,00
S&P 500 E Mini Index Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(211.600)	2	16/12/2016	3.600	0,00
S&P 500 E Mini Index Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(217.090)	2	16/12/2016	(1.890)	(0,00)
S&P 500 E Mini Index Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(322.778)	3	16/12/2016	23	0,00
Total Futures					2.416	0,00	

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Risk Parity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Kupon	Fälligkeitsdatum	Währung	Anzahl/Nominalwert	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						
Staatsanleihen						
Frankreich						
France Government Bond OAT	0,250%	25/07/2024	EUR	9.300.000	11.779.306	1,60
France Government Bond OAT	1,100%	25/07/2022	EUR	4.100.000	5.698.374	0,77
France Government Bond OAT	2,250%	25/07/2020	EUR	9.400.000	14.718.332	2,00
France Government Bond OAT	0,100%	25/07/2021-03/01/2025	EUR	12.500.000	15.352.490	2,08
Total Frankreich					47.548.502	6,45
Deutschland						
Deutsche Bundesrepublik Inflation-Linked Bond	1,750%	15/04/2020	EUR	11.500.000	15.678.455	2,13
Deutsche Bundesrepublik Inflation-Linked Bond	0,100%	15/04/2023-15/04/2026	EUR	21.700.000	27.591.351	3,74
Total Deutschland					43.269.806	5,87
Vereinigtes Königreich						
United Kingdom Gilt Inflation-Linked Bond	0,125%	22/03/2024-22/03/2026	GBP	26.300.000	43.826.687	5,95
Total Vereinigtes Königreich					43.826.687	5,95
Vereinigte Staaten						
United States Treasury Inflation-Indexed Bonds	0,250%	15/01/2025	USD	25.400.000	26.321.967	3,57
United States Treasury Inflation-Indexed Bonds	0,375%	15/07/2025	USD	27.200.000	28.543.437	3,88
United States Treasury Inflation-Indexed Bonds	0,125%	15/04/2019-15/07/2024	USD	129.300.000	135.007.061	18,32
Total Vereinigte Staaten					189.872.465	25,77
Total Government Bonds					324.517.460	44,04
Kurzfristige Anlagen						
Australien						
Commonwealth Bank of Australia	0,000%	10/07/2016	USD	1.000.000	999.926	0,14
National Australia Bank Ltd	0,000%	11/01/2016-15/11/2016	USD	8.500.000	8.497.415	1,15
Wells Fargo Bank NA	1,020%	21/02/2017	USD	2.000.000	2.000.534	0,27
Westpac Banking Corp	0,000%	22/12/2016-01/04/2017	USD	5.000.000	4.988.892	0,68
Total Australien					16.486.767	2,24
Vereinigte Staaten						
Albion Capital LLC	0,000%	17/10/2016-25/10/2016	USD	9.000.000	8.997.807	1,22
American Honda Finance Corp	0,000%	28/11/2016	USD	5.500.000	5.495.347	0,75
Atlantic Asset Securitization LLC	0,000%	19/10/2016-10/11/2016	USD	8.000.000	7.998.316	1,08
Bank of Montreal	0,660%	10/03/2016	USD	3.000.000	3.000.066	0,41
Bank of Montreal	1,110%	02/03/2017	USD	3.000.000	3.001.794	0,41
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd	0,630%	10/03/2016	USD	4.500.000	4.500.085	0,61
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd	0,830%	12/01/2016	USD	3.500.000	3.500.640	0,47
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd	0,850%	01/03/2017	USD	3.000.000	2.999.856	0,41
Barton Capital LLC	0,000%	11/03/2016-10/06/2016	USD	9.000.000	8.998.747	1,22
BMW US Capital LLC	0,000%	21/10/2016-21/11/2016	USD	8.500.000	8.495.586	1,15
Caterpillar Financial Services Corp	0,000%	11/07/2016-16/11/2016	USD	8.500.000	8.495.789	1,16
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,750%	10/05/2016	USD	3.000.000	3.000.111	0,41
Fairway Finance Co LLC	0,000%	10/12/2016	USD	3.500.000	3.499.433	0,47
Fairway Finance LLC	0,000%	28/11/2016	USD	1.500.000	1.498.173	0,20
Gotham Funding Corp	0,000%	10/06/2016-15/12/2016	USD	8.500.000	8.493.369	1,15
Liberty Street Funding LLC	0,000%	12/07/2016-12/12/2016	USD	5.750.000	5.740.518	0,77
LMA Americas LLC	0,000%	10/06/2016-24/10/2016	USD	9.000.000	8.998.072	1,22
Manhattan Asset Funding Co LLC	0,000%	11/02/2016-13/10/2016	USD	8.500.000	8.496.515	1,16
Microsoft Corp	0,000%	26/10/2016-17/01/2017	USD	9.000.000	8.984.797	1,22
Mizuho Bank Ltd	0,900%	12/01/2016	USD	2.500.000	2.501.078	0,34
Mizuho Bank Ltd	0,000%	11/01/2016-18/11/2016	USD	5.000.000	4.997.126	0,68
Novartis Finance Corp	0,000%	11/01/2016-24/10/2016	USD	8.500.000	8.496.964	1,15
Old Line Funding LLC	0,000%	12/12/2016-01/04/2017	USD	8.500.000	8.479.596	1,16
Roche Holdings Inc	0,000%	17/10/2016	USD	500.000	499.904	0,07
Royal Bank of Canada	0,770%	12/01/2016	USD	3.000.000	3.000.684	0,41
Royal Bank of Canada	0,840%	01/03/2017	USD	3.000.000	2.999.733	0,41
Starbird Funding Corp	0,000%	11/01/2016-17/10/2016	USD	9.000.000	8.995.498	1,21
Sumitomo Mitsui Banking Corp	0,900%	30/11/2016	USD	3.000.000	3.001.257	0,41
Svenska Handelsbanken	0,000%	20/03/2017	USD	5.000.000	4.972.020	0,67
Thunder Bay Funding LLC	0,000%	12/05/2016-15/12/2016	USD	9.000.000	8.989.218	1,21
Toronto Dominion Holding USA	0,000%	11/01/2016	USD	8.000.000	7.996.592	1,08
Toyota Motor Credit Corp	0,000%	28/11/2016-01/05/2017	USD	6.000.000	5.990.895	0,82
Victory Receivables Corp	0,000%	12/08/2016-25/10/2016	USD	5.000.000	4.995.775	0,68
Working Capital Management Co	0,000%	12/01/2016-10/06/2016	USD	9.000.000	8.993.163	1,23
Total Vereinigte Staaten					199.104.524	27,02
Neuseeland						
BNZ International Funding Ltd	0,000%	11/03/2016	USD	1.000.000	999.580	0,14
Total Neuseeland					999.580	0,14
Norwegen						
DNB Bank ASA	0,750%	12/08/2016	USD	2.000.000	2.000.692	0,27
DNB Bank ASA	0,000%	10/03/2016-17/11/2016	USD	6.500.000	6.497.753	0,88
Total Norwegen					8.498.445	1,15
Japan						
Sumitomo Mitsui Banking Corp	0,000%	11/04/2016-10/06/2016	USD	6.000.000	5.999.176	0,81
Total Japan					5.999.176	0,81
Singapur						
DBS Bank Ltd	0,000%	10/06/2016-28/11/2016	USD	8.000.000	7.996.095	1,09
Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	0,000%	12/12/2016	USD	2.000.000	1.997.664	0,27
United Overseas Bank Ltd	0,000%	14/10/2016-17/10/2016	USD	8.500.000	8.498.653	1,15
Total Singapur					18.492.412	2,51
Schweden						
Nordea Bank AB	0,000%	12/02/2016-21/12/2016	USD	9.000.000	8.990.006	1,22
Skandinaviska Enskilda Banken AB	0,000%	11/03/2016-12/07/2016	USD	8.500.000	8.495.632	1,16
Swedbank New York	0,370%	10/06/2016	USD	6.000.000	6.000.000	0,81
Total Schweden					23.485.638	3,19

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Risk Parity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Kupon	Fälligkeitsdatum	Währung	Anzahl/Nominalwert	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Total Staatsanleihen					324.517.460	44,04
Vereinigtes Königreich						
ANZ New Zealand Int'l Ltd	0,000%	17/10/2016	USD	3.000.000	2.999.190	0,41
ASB Finance Ltd	0,000%	14/10/2016-16/12/2016	USD	7.500.000	7.495.497	1,01
Total Vereinigtes Königreich					10.494.687	1,42
Canada						
The Bank of Nova Scotia	0,000%	13/10/2016-20/10/2016	USD	8.000.000	7.998.522	1,09
Toronto-Dominion Bank/NY	0,000%	12/12/2016	USD	1.000.000	998.528	0,13
Total Kanada					8.997.050	1,22
Frankreich						
Sanofi	0,000%	14/10/2016	USD	3.000.000	2.999.574	0,41
Societe Generale SA	0,000%	10/06/2016	USD	8.500.000	8.499.473	1,15
Total Frankreich					11.499.047	1,56
Total kurzfristige Anlagen					304.057.326	41,26
Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden					628.574.786	85,30
Gesamtanlagen (Gesamtkosten: \$624.252.324)					628.574.786	85,30
Sonstige Vermögenswerte/(Verbindlichkeiten)					108.343.430	14,70
NETTOVERMÖGEN					736.918.216	100,00
Derivate						
Zum 30. September 2016 in USD angegeben						
Futures						
börsengehandelt						
Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust)% des in USD Nettovermögens
KOSPI 200 Index Futures	Barclays Capital Inc.	KRW	(2.604.979.840)	20	12/08/2016	(20.865) (0,00)
KOSPI 200 Index Futures	Barclays Capital Inc.	KRW	(2.613.385.840)	20	12/08/2016	(28.498) (0,00)
KOSPI 200 Index Futures	Barclays Capital Inc.	KRW	(2.495.456.457)	19	12/08/2016	(38.640) (0,01)
Amsterdam Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(621.390)	7	21/10/2016	8.867 0,00
Amsterdam Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(625.100)	7	21/10/2016	4.708 0,00
CAC 40 Euro Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(1.933.030)	44	21/10/2016	9.248 0,00
CAC 40 Euro Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(1.950.850)	44	21/10/2016	(10.728) (0,00)
Dax Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(1.832.284)	7	16/12/2016	(17.987) (0,00)
Dax Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(1.810.432)	7	16/12/2016	6.507 0,00
Euro Stoxx 50 Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(29.810)	1	16/12/2016	(202) (0,00)
Euro Stoxx 50 Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(59.680)	2	16/12/2016	(471) (0,00)
Euro Stoxx 50 Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(5.356.800)	180	16/12/2016	(26.230) (0,00)
Euro Stoxx 50 Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(5.394.600)	180	16/12/2016	(68.602) (0,01)
FTSE 100 Index Futures	Goldman Sachs & Co	GBP	(68.030)	1	16/12/2016	487 0,00
FTSE 100 Index Futures	Goldman Sachs & Co	GBP	(2.521.680)	38	16/12/2016	100.914 0,01
FTSE 100 Index Futures	Goldman Sachs & Co	GBP	(6.414.240)	96	16/12/2016	198.218 0,03
FTSE 100 Index Futures	Goldman Sachs & Co	GBP	(3.801.615)	57	16/12/2016	126.575 0,02
FTSE/MIB Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(166.100)	2	16/12/2016	(4.876) (0,00)
FTSE/MIB Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(418.069)	5	16/12/2016	(15.350) (0,00)
FTSE/MIB Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(164.100)	2	16/12/2016	(2.634) (0,00)
Hang Seng Index Futures	Goldman Sachs & Co	HKD	(1.170.639)	1	28/10/2016	(643) (0,00)
Hang Seng Index Futures	Goldman Sachs & Co	HKD	(1.174.009)	1	28/10/2016	(1.078) (0,00)
Hang Seng Index Futures	Goldman Sachs & Co	HKD	(1.174.348)	1	28/10/2016	(1.122) (0,00)
H-Shares Index Futures	Goldman Sachs & Co	HKD	(21.417.000)	44	28/10/2016	(38.302) (0,01)
H-Shares Index Futures	Goldman Sachs & Co	HKD	(21.354.300)	44	28/10/2016	(30.216) (0,00)
H-Shares Index Futures	Goldman Sachs & Co	HKD	(20.890.475)	43	28/10/2016	(32.302) (0,00)
IBEX 35 Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(263.610)	3	21/10/2016	(3.901) (0,00)
IBEX 35 Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(346.640)	4	21/10/2016	224 0,00
IBEX 35 Index Futures	Goldman Sachs & Co	EUR	(619.395)	7	21/10/2016	(13.928) (0,00)
MSCI Taiwan Index Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(1.976.475)	57	28/10/2016	(28.785) (0,00)
MSCI Taiwan Index Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(993.540)	29	28/10/2016	(2.610) (0,00)
Russell 2000 Mini Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(6.292.520)	52	16/12/2016	134.680 0,02
Russell 2000 Mini Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(6.507.800)	52	16/12/2016	(80.600) (0,01)
S&P 500 E Mini Index Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(2.366.852)	22	16/12/2016	348 0,00
S&P 500 E Mini Index Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(42.549.640)	392	16/12/2016	(370.440) (0,05)
S&P 500 E Mini Index Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(48.456.400)	458	16/12/2016	824.400 0,11
S&P 500 E Mini Index Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(322.008)	3	16/12/2016	792 0,00
S&P 500 E Mini Index Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(431.025)	4	16/12/2016	(625) (0,00)
S&P 500 E Mini Index Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(49.277.365)	458	16/12/2016	3.435 0,00
S&P MID 400 E Mini Index Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(3.769.680)	24	16/12/2016	(74.640) (0,01)
S&P MID 400 E Mini Index Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(308.867)	2	16/12/2016	(947) (0,00)
S&P MID 400 E Mini Index Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(5.553.180)	36	16/12/2016	(10.620) (0,00)
S&P MID 400 E Mini Index Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(5.485.500)	36	16/12/2016	57.060 0,01
S&P TSX 60 Index Futures	Goldman Sachs & Co	CAD	(7.341.132)	43	15/12/2016	29.388 0,00
S&P TSX 60 Index Futures	Goldman Sachs & Co	CAD	(168.980)	1	15/12/2016	2.014 0,00
SGX Nifty 50 Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(1.567.379)	89	27/10/2016	(27.501) (0,00)
SGX Nifty 50 Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(1.521.340)	86	27/10/2016	(33.368) (0,00)
SGX Nifty 50 Futures	Goldman Sachs & Co	USD	(1.559.982)	89	27/10/2016	(20.104) (0,00)
SPI 200 Futures	Goldman Sachs & Co	AUD	(2.713.200)	21	15/12/2016	99.694 0,01
SPI 200 Futures	Goldman Sachs & Co	AUD	(2.885.050)	22	15/12/2016	94.755 0,01
SPI 200 Futures	Goldman Sachs & Co	AUD	(2.722.650)	21	15/12/2016	92.458 0,01
TOPIX Index Futures	Goldman Sachs & Co	JPY	(711.790.000)	53	12/08/2016	(104.676) (0,01)
TOPIX Index Futures	Goldman Sachs & Co	JPY	(53.220.000)	4	12/08/2016	(2.963) (0,00)
TOPIX Index Futures	Goldman Sachs & Co	JPY	(706.781.500)	53	12/08/2016	(55.217) (0,01)
TOPIX Index Futures	Goldman Sachs & Co	JPY	(13.305.000)	1	12/08/2016	(741) (0,00)
TOPIX Index Futures	Goldman Sachs & Co	JPY	(702.780.000)	53	12/08/2016	(15.701) (0,00)
TOPIX Index Futures	Goldman Sachs & Co	JPY	(39.930.000)	3	12/08/2016	(2.370) (0,00)
10 Year Australian Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	(12.601.174)	93	15/12/2016	108.222 0,01
10 Year Australian Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	(815.381)	6	15/12/2016	5.143 0,00
10 Year Australian Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	(13.291.873)	98	15/12/2016	103.920 0,01
10 Year Australian Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	(681.637)	5	15/12/2016	2.637 0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(1.758.840)	12	19/12/2016	8.604 0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Risk Parity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Futures (Fortsetzung) börsengehandelt

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(1.026.547)	7	19/12/2016	4.595	0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(1.320.800)	9	19/12/2016	5.179	0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(1.327.020)	9	19/12/2016	434	0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(34.296.873)	234	19/12/2016	168.167	0,02
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(1.462.797)	10	19/12/2016	9.385	0,00
10 Year Japan Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	JPY	(10.163.701.144)	67	13/12/2016	425.407	0,06
10 Year Japan Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	JPY	(304.567.976)	2	13/12/2016	1.106	0,00
10 Year Japan Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	JPY	(303.500.889)	2	13/12/2016	11.644	0,00
10 Year Japan Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	JPY	(454.933.846)	3	13/12/2016	20.601	0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(16.892.954)	129	20/12/2016	68.531	0,01
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(21.006.443)	160	20/12/2016	31.058	0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(11.290.573)	86	20/12/2016	17.084	0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(65.623.035)	500	20/12/2016	119.155	0,02
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(277.216.199)	2.112	20/12/2016	478.811	0,06
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(15.903.639)	121	20/12/2016	5.971	0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(14.054.491)	107	20/12/2016	14.338	0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(11.526.307)	88	20/12/2016	44.319	0,01
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(7.282.030)	44	12/08/2016	20.189	0,00
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(5.303.229)	32	12/08/2016	6.603	0,00
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(5.944.392)	36	12/08/2016	31.799	0,00
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(106.230.860)	645	12/08/2016	875.563	0,12
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(79.268.259)	482	12/08/2016	785.070	0,11
FTSE/JSE TOP 40 Futures	J.P. Morgan Securities PLC	ZAR	(38.633.283)	83	15/12/2016	(22.433)	(0,00)
FTSE/JSE TOP 40 Futures	J.P. Morgan Securities PLC	ZAR	(38.872.021)	83	15/12/2016	(39.727)	(0,01)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(788.005)	6	28/12/2016	(3.305)	(0,00)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(14.829.696)	113	28/12/2016	(47.875)	(0,01)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(19.533.900)	149	28/12/2016	(36.763)	(0,00)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.050.330)	8	28/12/2016	(3.961)	(0,00)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.698.420)	13	28/12/2016	4.429	0,00
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.567.182)	12	28/12/2016	4.854	0,00
Total Futures						3.835.043	0,52

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Citibank, N.A.	EUR	271.792	USD	306.203	21/12/2016	(426)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	298.542	USD	394.477	21/12/2016	(6.158)	(0,00)
Citibank, N.A.	HKD	321.000	USD	41.423	21/12/2016	7	0,00
Citibank, N.A.	HKD	413.000	USD	53.309	21/12/2016	(5)	(0,00)
Citibank, N.A.	HKD	1.033.000	USD	133.345	21/12/2016	(20)	(0,00)
Citibank, N.A.	HKD	1.454.000	USD	187.660	21/12/2016	1	0,00
Citibank, N.A.	HKD	1.692.000	USD	218.347	21/12/2016	32	0,00
Citibank, N.A.	USD	7.317	BRL	24.929	21/12/2016*	(178)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	8.530	BRL	28.952	21/12/2016*	(175)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	9.841	BRL	32.983	21/12/2016*	(76)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	9.927	BRL	33.408	21/12/2016*	(117)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	12.259	BRL	40.951	21/12/2016*	(53)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	12.958	BRL	42.613	21/12/2016*	146	0,00
Citibank, N.A.	USD	17.885	BRL	60.164	21/12/2016*	(204)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	914.417	EUR	813.103	21/12/2016	(357)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	3.216.274	EUR	2.872.941	21/12/2016	(15.901)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	3.344.228	EUR	2.955.921	21/12/2016	18.697	0,00
Citibank, N.A.	USD	4.244.343	EUR	3.785.753	21/12/2016	(14.782)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	6.528.768	EUR	5.824.235	21/12/2016	(23.732)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	8.024.905	EUR	7.094.210	21/12/2016	43.631	0,00
Citibank, N.A.	USD	10.403.024	EUR	9.207.136	21/12/2016	44.623	0,01
Citibank, N.A.	USD	464.913	GBP	358.146	21/12/2016	(934)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	17.476.612	GBP	13.302.160	21/12/2016	174.249	0,02
Citibank, N.A.	USD	164.479	HKD	1.274.400	21/12/2016	(2)	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	407.687	USD	459.304	21/12/2016	(640)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	GBP	447.813	USD	591.717	21/12/2016	(9.238)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	10.976	BRL	37.393	21/12/2016*	(266)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	12.795	BRL	43.430	21/12/2016*	(262)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	14.761	BRL	49.472	21/12/2016*	(114)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	14.892	BRL	50.114	21/12/2016*	(175)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	18.388	BRL	61.427	21/12/2016*	(80)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	19.436	BRL	63.017	21/12/2016*	218	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	26.828	BRL	90.247	21/12/2016*	(306)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.371.625	EUR	1.219.656	21/12/2016	(537)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	4.824.405	EUR	4.309.411	21/12/2016	(23.857)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	5.016.335	EUR	4.433.881	21/12/2016	28.039	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	6.366.506	EUR	5.678.629	21/12/2016	(22.181)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	9.793.140	EUR	8.736.352	21/12/2016	(35.610)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	12.037.342	EUR	10.641.315	21/12/2016	65.432	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	15.604.518	EUR	13.810.705	21/12/2016	66.916	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	697.369	GBP	537.219	21/12/2016	(1.402)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	26.214.885	GBP	19.953.240	21/12/2016	261.340	0,03
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	246.719	HKD	1.911.600	21/12/2016	(3)	0,00
Total Devisenterminkontrakte						545.540	0,07

* Nicht lieferbare Terminkontrakte. (Siehe Anmerkung 3)

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte zu Sicherungszwecken

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Citibank, N.A.	EUR	520.000	USD	585.317	21/12/2016	(296)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Global Risk Parity UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte zu Sicherungszwecken (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Netto-vermögens
Citibank, N.A.	EUR	530.000	USD	597.516	21/12/201	(1.245)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	570.000	USD	642.033	21/12/201	(760)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	580.000	USD	660.281	21/12/201	(7.758)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	600.000	USD	673.984	21/12/201	1.041	0,00
Citibank, N.A.	EUR	600.000	USD	673.243	21/12/201	1.781	0,00
Citibank, N.A.	EUR	6.565.877	USD	7.400.650	21/12/201	(13.773)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	10.866.681	USD	12.165.404	21/12/201	60.053	0,01
Citibank, N.A.	EUR	11.180.546	USD	12.649.382	21/12/201	(70.815)	(0,01)
Citibank, N.A.	EUR	14.319.322	USD	16.054.025	21/12/201	55.792	0,01
Citibank, N.A.	EUR	22.029.726	USD	24.694.755	21/12/201	89.579	0,01
Citibank, N.A.	EUR	26.833.310	USD	30.353.820	21/12/201	(165.259)	(0,02)
Citibank, N.A.	EUR	34.825.294	USD	39.348.946	21/12/201	(169.080)	(0,02)
Citibank, N.A.	GBP	1.500.000	USD	1.953.664	21/12/201	(2.587)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	8.331.229	USD	10.813.251	21/12/201	23.331	0,00
Citibank, N.A.	GBP	118.222.681	USD	155.324.204	21/12/201	(1.549.795)	(0,21)
Citibank, N.A.	USD	6.821.912	EUR	6.047.897	21/12/201	17.782	0,00
Citibank, N.A.	USD	9.579.401	GBP	7.225.080	21/12/201	181.607	0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	16.300.022	USD	18.248.129	21/12/201	90.056	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	16.770.819	USD	18.974.096	21/12/201	(106.246)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	21.478.982	USD	24.081.066	21/12/201	83.658	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	33.044.589	USD	37.042.178	21/12/201	134.323	0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	40.249.965	USD	45.530.787	21/12/201	(247.946)	(0,03)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	52.237.941	USD	59.023.493	21/12/201	(253.693)	(0,04)
JPMorgan Chase Bank N.A.	GBP	177.334.020	USD	232.986.595	21/12/201	(2.324.984)	(0,32)
Total Devisenterminkontrakte zu Sicherungszwecken						(4.175.234)	(0,57)

Außerbörslich gehandelte Total-Return-Swaps

Referenzwert	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Netto-vermögens
HANG SENG Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	HKD	4.679.426	28/10/2016	(2.170)	(0,00)
HANG SENG Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	HKD	7.051.430	28/10/2016	(7.419)	(0,00)
H-SHARES Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	HKD	13.977.035	28/10/2016	(7.356)	(0,00)
H-SHARES Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	HKD	23.841.471	28/10/2016	(41.458)	(0,01)
KOSPI2 Index Futures Dec16	Bank of America, N.A.	KRW	1.302.758.000	08/12/2016	(10.676)	(0,00)
SGX Nifty 50 Futures Oct16	Bank of America, N.A.	USD	673.145	27/10/2016	(15.669)	(0,00)
Bloomberg Commodity Index 1 Month Forward Dec16	Barclays Bank PLC	USD	2.766.533	10/12/2016	2.766.533	0,37
BOVESPA Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	BRL	16.070.340	13/10/2016	(84.702)	(0,01)
BOVESPA Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	BRL	301.627	13/10/2016	(2.808)	(0,00)
BOVESPA Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	BRL	300.422	13/10/2016	(2.437)	(0,00)
BOVESPA Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	BRL	295.898	13/10/2016	(1.045)	(0,00)
BOVESPA Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	BRL	296.795	13/10/2016	(1.321)	(0,00)
BOVESPA Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	BRL	300.452	13/10/2016	(2.446)	(0,00)
HANG SENG Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	1.169.593	28/10/2016	(508)	(0,00)
HANG SENG Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	1.174.487	28/10/2016	(1.140)	(0,00)
HANG SENG Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	1.174.021	28/10/2016	(1.080)	(0,00)
H-SHARES Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	12.593.347	28/10/2016	(15.391)	(0,00)
H-SHARES Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	12.590.240	28/10/2016	(14.217)	(0,00)
H-SHARES Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	11.672.106	28/10/2016	(19.616)	(0,00)
MSCI Taiwan Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	USD	4.712.056	28/10/2016	(64.936)	(0,01)
MSCI Taiwan Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	USD	993.773	28/10/2016	(2.843)	(0,00)
SGX Nifty 50 Futures Oct16	Goldman Sachs International	USD	229.008	27/10/2016	(4.082)	(0,00)
SGX Nifty 50 Futures Oct16	Goldman Sachs International	USD	230.054	27/10/2016	(5.129)	(0,00)
SGX Nifty 50 Futures Oct16	Goldman Sachs International	USD	228.000	27/10/2016	(3.074)	(0,00)
TAIEX Futures Oct16	Goldman Sachs International	TWD	5.465.856	19/10/2016	387	0,00
TAIEX Futures Oct16	Goldman Sachs International	TWD	3.633.061	19/10/2016	604	0,00
H-Shares Index Futures Oct16	JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	10.237.122	28/10/2016	(20.263)	(0,00)
KOSPI 200 Index Futures Dec16	JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.829.939.300	08/12/2016	(20.465)	(0,01)
SGX Nifty 50 Futures Oct16	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	279.999	27/10/2016	(3.167)	(0,00)
Total Total-Return-Swaps						2.412
						0,33

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Kupon	Fälligkeitsdatum	Währung	Anzahl/Nominalwert	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						
Forderungsbesicherte Wertpapiere						
Vereinigte Staaten						
John Deere Owner Trust 2015	0,870%	15/02/2018	USD	298.107	298.009	0,08
Total Deviseinterminkontrakte zu Sicherungszwecken						298.009 0,08
Total durch Vermögenswerte besicherte Wertpapiere						298.009 0,08
Kurzfristige Anlage						
Australien						
Commonwealth Bank of Australia	0,000%	10/07/2016	USD	1.000.000	999.926	0,28
National Australia Bank Ltd	0,000%	11/01/2016-12/12/2016	USD	8.000.000	7.995.882	2,21
Wells Fargo Bank NA	1,020%	21/02/2017	USD	1.500.000	1.500.400	0,41
Westpac Banking Corp	0,000%	22/12/2016-01/04/2017	USD	5.050.000	5.037.714	1,39
Total Australien						15.533.922 4,29
Kanada						
The Bank of Nova Scotia	0,000%	11/02/2016-20/10/2016	USD	7.650.000	7.647.840	2,11
Toronto-Dominion Bank/NY	0,000%	12/12/2016	USD	2.000.000	1.997.056	0,55
Total Kanada						9.644.896 2,66
Frankreich						
Sanofi	0,000%	14/10/2016	USD	2.000.000	1.999.716	0,55
Societe Generale SA	0,000%	10/03/2016-10/06/2016	USD	10.500.000	10.499.429	2,90
Total Frankreich						12.499.145 3,45
Japan						
Sumitomo Mitsui Banking Corp	0,950%	16/12/2016	USD	2.000.000	2.000.520	0,55
Sumitomo Mitsui Banking Corp	0,000%	11/04/2016-18/10/2016	USD	4.000.000	3.999.070	1,11
Total Japan						5.999.590 1,66
Luxemburg						
Nestle Finance International Ltd	0,000%	28/10/2016	USD	4.000.000	3.998.904	1,10
Total Luxemburg						3.998.904 1,10
Neuseeland						
BNZ International Funding Ltd	0,000%	11/03/2016	USD	500.000	499.790	0,14
Total Neuseeland						499.790 0,14
Norwegen						
DNB Bank ASA	0,750%	12/08/2016	USD	3.000.000	3.001.038	0,83
DNB Bank ASA	0,000%	10/03/2016-17/11/2016	USD	4.000.000	3.998.708	1,10
Total Norwegen						6.999.746 1,93
Singapur						
DBS Bank Ltd	0,000%	10/06/2016-28/11/2016	USD	6.000.000	5.998.669	1,65
United Overseas Bank Ltd	0,000%	10/04/2016-17/10/2016	USD	8.500.000	8.498.943	2,35
Total Singapur						14.497.612 4,00
Schweden						
Nordea Bank AB	0,000%	12/02/2016-21/12/2016	USD	8.500.000	8.490.968	2,34
Skandinaviska Enskilda Banken AB	0,000%	11/03/2016-12/07/2016	USD	5.500.000	5.496.062	1,52
Swedbank New York	0,370%	10/06/2016	USD	7.500.000	7.500.000	2,07
Total Schweden						21.487.030 5,93
Vereinigtes Königreich						
ANZ New Zealand Int'l Ltd	0,000%	17/10/2016	USD	1.000.000	999.730	0,28
ASB Finance Ltd	0,000%	14/10/2016-16/12/2016	USD	5.000.000	4.996.998	1,38
Total Vereinigtes Königreich						5.996.728 1,66
Vereinigte Staaten						
Albion Capital LLC	0,000%	17/10/2016-25/10/2016	USD	9.004.000	9.002.032	2,49
American Honda Finance Corp	0,000%	28/11/2016	USD	5.500.000	5.495.347	1,52
Atlantic Asset Securitization LLC	0,000%	17/12/2016	USD	8.000.000	7.998.072	2,21
Bank of Montreal	0,660%	10/03/2016	USD	2.000.000	2.000.044	0,55
Bank of Montreal	1,110%	02/03/2017	USD	2.000.000	2.001.196	0,55
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd	0,630%	10/03/2016	USD	3.000.000	3.000.057	0,83
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd	0,830%	12/01/2016	USD	2.500.000	2.500.458	0,69
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd	0,850%	01/03/2017	USD	4.500.000	4.499.784	1,24
Barton Capital LLC	0,000%	10/06/2016-17/10/2016	USD	9.000.000	8.998.405	2,49
BMW US Capital LLC	0,000%	21/10/2016-21/11/2016	USD	7.500.000	7.495.848	2,07
Caterpillar Financial Services Corp	0,000%	11/07/2016-16/11/2016	USD	8.500.000	8.495.749	2,35
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,750%	10/05/2016	USD	2.000.000	2.000.074	0,55
Fairway Finance Co LLC	0,000%	10/12/2016	USD	2.000.000	1.999.676	0,55
Fairway Finance LLC	0,000%	12/06/2016-28/11/2016	USD	3.000.000	2.995.834	0,83
Gotham Funding Corp	0,000%	10/06/2016-15/12/2016	USD	7.500.000	7.496.784	2,06
Liberty Street Funding LLC	0,000%	10/07/2016-12/12/2016	USD	8.500.000	8.489.772	2,34
LMA Americas LLC	0,000%	14/10/2016-24/10/2016	USD	9.000.000	8.997.932	2,48
Manhattan Asset Funding Co LLC	0,000%	11/02/2016-12/12/2016	USD	8.000.000	7.993.270	2,21
Microsoft Corp	0,000%	17/01/2017	USD	9.000.000	8.981.253	2,48
Mizuho Bank Ltd	0,900%	12/01/2016	USD	3.500.000	3.501.508	0,97
Mizuho Bank Ltd	0,000%	11/01/2016-18/11/2016	USD	4.000.000	3.997.562	1,10
Nestle Finance International Ltd	0,000%	12/05/2016	USD	4.000.000	3.996.912	1,10
Novartis Finance Corp	0,000%	11/01/2016-24/10/2016	USD	7.500.000	7.497.208	2,07
Old Line Funding LLC	0,000%	12/12/2016-01/04/2017	USD	8.500.000	8.481.813	2,34
Roche Holdings Inc	0,000%	17/10/2016	USD	1.000.000	999.808	0,28
Royal Bank of Canada	0,770%	12/01/2016	USD	2.500.000	2.500.570	0,69
Royal Bank of Canada	0,840%	01/03/2017	USD	2.000.000	1.999.822	0,55
Starbird Funding Corp	0,000%	11/01/2016-17/10/2016	USD	8.500.000	8.494.239	2,35
Sumitomo Mitsui Banking Corp	0,900%	30/11/2016	USD	2.500.000	2.501.048	0,69
Svenska Handelsbanken	0,000%	20/03/2017	USD	3.000.000	2.983.212	0,82
Thunder Bay Funding LLC	0,000%	12/05/2016-15/12/2016	USD	8.500.000	8.489.379	2,34
Toronto Dominion Holding USA	0,000%	11/01/2016	USD	5.500.000	5.497.657	1,52
Toyota Motor Credit Corp	0,000%	28/11/2016-01/05/2017	USD	5.000.000	4.991.847	1,38
Victory Receivables Corp	0,000%	11/03/2016-12/08/2016	USD	6.500.000	6.496.878	1,79

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Kupon	Fälligkeitsdatum	Währung	Anzahl/Nominalwert	Markt wert in USD	% des Netto- vermögens
Working Capital Management Co	0,000%	10/03/2016-24/10/2016	USD	8.500.000	8.498.562	2,36
Total Vereinigte Staaten					191.369.612	52,84
Total kurzfristige Anlagen					288.526.975	79,66
Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden					288.824.984	79,74
Gesamtanlagen (Gesamtkosten: \$288.783.875)					288.824.984	79,74
Sonstige Vermögenswerte/(Verbindlichkeiten)					73.378.210	20,26
NETTOVERMÖGEN					362.203.194	100,00

Derivate

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Futures börsengehandelt

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fällig- keit	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Amsterdam Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(530.743)	6	21/10/2016	9.704	0,00
Amsterdam Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(1.335.690)	15	21/10/2016	14.360	0,00
Amsterdam Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(363.466)	4	21/10/2016	(4.334)	(0,00)
Amsterdam Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(538.024)	6	21/10/2016	1.543	0,00
CAC 40 Euro Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(1.369.938)	31	21/10/2016	(2.486)	(0,00)
CAC 40 Euro Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(761.875)	17	21/10/2016	(13.267)	(0,00)
CAC 40 Euro Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(438.961)	10	21/10/2016	2.510	0,00
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(1.299.707)	5	16/12/2016	(2.684)	(0,00)
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(258.645)	1	16/12/2016	916	0,00
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(259.946)	1	16/12/2016	(542)	(0,00)
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(785.691)	3	16/12/2016	(8.187)	(0,00)
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(265.158)	1	16/12/2016	(6.385)	(0,00)
Euro Stoxx 50 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(89.560)	3	16/12/2016	(751)	(0,00)
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(199.424)	3	16/12/2016	7.521	0,00
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(946.354)	14	16/12/2016	14.695	0,01
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(67.915)	1	16/12/2016	637	0,00
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(475.360)	7	16/12/2016	4.513	0,00
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(681.084)	10	16/12/2016	3.851	0,00
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(2.665.331)	40	16/12/2016	92.030	0,03
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(665.546)	10	16/12/2016	24.029	0,01
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(2.264.181)	34	16/12/2016	79.980	0,02
FTSE/MIB Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	81.138	(1)	16/12/2016	295	0,00
FTSE/MIB Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	328.933	(4)	16/12/2016	6.090	0,00
FTSE/MIB Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	332.850	(4)	16/12/2016	10.481	0,00
FTSE/MIB Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	166.100	(2)	16/12/2016	4.876	0,00
Hang Seng Index Futures	Barclays Capital Inc.	HKD	(7.039.918)	6	28/10/2016	(5.935)	(0,00)
Hang Seng Index Futures	Barclays Capital Inc.	HKD	(3.524.409)	3	28/10/2016	(3.541)	(0,00)
Hang Seng Index Futures	Barclays Capital Inc.	HKD	(4.696.021)	4	28/10/2016	(4.310)	(0,00)
H-Shares Index Futures	Barclays Capital Inc.	HKD	(485.050)	1	28/10/2016	(651)	(0,00)
H-Shares Index Futures	Barclays Capital Inc.	HKD	(1.459.503)	3	28/10/2016	(2.515)	(0,00)
IBEX 35 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	618.255	(7)	21/10/2016	12.650	0,00
KOSPI 200 Index Futures	Barclays Capital Inc.	KRW	(127.833.523)	1	12/08/2016	1.150	0,00
TOPIX Index Futures	Barclays Capital Inc.	JPY	26.100.095	(2)	12/08/2016	(3.554)	(0,00)
10 Year Australian Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	(682.964)	5	15/12/2016	1.621	0,00
10 Year Australian Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	(7.459.725)	55	15/12/2016	58.322	0,02
10 Year Australian Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	(272.655)	2	15/12/2016	1.055	0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(1.465.678)	10	19/12/2016	7.187	0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(3.687.224)	25	19/12/2016	401	0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(731.639)	5	19/12/2016	4.509	0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(3.528.965)	24	19/12/2016	8.601	0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(2.064.254)	14	19/12/2016	676	0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(4.129.070)	28	19/12/2016	923	0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(596.414)	4	19/12/2016	2.766	0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(146.623)	1	19/12/2016	677	0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(1.316.340)	9	19/12/2016	8.582	0,00
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(1.609.076)	11	19/12/2016	10.323	0,00
10 Year Japanese Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	JPY	1.213.600.000	(8)	13/12/2016	(50.560)	(0,01)
10 Year Japan Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	JPY	455.222.069	(3)	13/12/2016	(17.755)	(0,00)
10 Year Japan Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	JPY	303.070.579	(2)	13/12/2016	(15.893)	(0,00)
10 Year Japan Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	JPY	454.413.614	(3)	13/12/2016	(25.738)	(0,01)
10 Year Japan Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	JPY	151.594.750	(1)	13/12/2016	(7.359)	(0,00)
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(262.080)	2	20/12/2016	889	0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(521.649)	4	20/12/2016	4.288	0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.937.730)	30	20/12/2016	6.801	0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(2.227.596)	17	20/12/2016	7.639	0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.025.056)	23	20/12/2016	(915)	(0,00)
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.970.256)	15	20/12/2016	2.010	0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.444.569)	11	20/12/2016	1.760	0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.419.271)	26	20/12/2016	(677)	(0,00)
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(785.715)	6	20/12/2016	3.192	0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.274.519)	25	20/12/2016	12.591	0,00
2 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(5.899.049)	27	30/12/2016	2.138	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.003.750)	4	18/06/2018	56	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.900)	1	18/06/2018	56	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.759.487)	11	19/06/2017	(308)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.700)	3	18/12/2017	42	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.254.567)	5	18/06/2018	205	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.254.603)	5	18/06/2018	165	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.254.324)	5	19/06/2017	(153)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.003.645)	4	18/12/2017	5	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.254.611)	5	19/03/2018	86	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.806)	3	18/06/2018	49	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.902)	1	18/06/2018	54	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.254.437)	5	19/03/2018	280	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Futures (Fortsetzung) börsengehandelt

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.925)	1	18/09/2017	(42)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.756.562)	7	18/12/2017	(196)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.847)	3	19/03/2018	(39)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(501.893)	2	18/06/2018	7	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(501.770)	2	13/03/2017	(218)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.513.127)	14	18/09/2017	(787)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.262.512)	13	18/12/2017	(729)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.509.868)	10	18/06/2018	(413)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(501.798)	2	13/03/2017	(250)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.509.730)	10	18/09/2017	(958)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.825)	1	13/03/2017	(42)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.550)	3	18/09/2017	126	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.505.175)	6	18/12/2017	336	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.508.694)	10	19/03/2018	763	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(6.021.341)	24	19/03/2018	1.299	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.766.874)	19	18/06/2018	1.318	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.975)	1	18/09/2017	(98)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.015.948)	16	18/12/2017	(1.511)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.517.401)	18	18/06/2018	(337)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.266.345)	17	17/09/2018	(218)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.003.600)	4	13/03/2017	(504)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.508.389)	10	13/03/2017	(576)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.764.729)	15	17/09/2018	(537)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.264.876)	17	17/09/2018	1.428	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.700)	3	13/03/2017	(378)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.937)	1	19/06/2017	(112)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(251.000)	1	19/03/2018	(70)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.517.943)	18	18/06/2018	(945)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.015.742)	16	17/09/2018	(608)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.013.587)	16	17/09/2018	1.808	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.512.075)	14	18/06/2018	1.373	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.265.400)	17	17/09/2018	841	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.014.629)	16	17/09/2018	640	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.003.492)	4	18/06/2018	346	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.262.510)	13	17/09/2018	(179)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.264.978)	17	17/09/2018	1.314	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(501.200)	2	19/03/2018	757	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.600)	1	19/03/2018	378	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.639)	1	19/03/2018	334	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.504.073)	6	19/03/2018	1.739	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.754.836)	7	19/03/2018	1.936	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.756.770)	7	17/09/2018	(134)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(501.675)	2	13/03/2017	(112)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.505.025)	6	18/09/2017	336	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.261.050)	13	18/12/2017	911	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.762.750)	15	19/03/2018	1.471	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.257.537)	9	18/06/2018	1.135	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.265.887)	17	17/09/2018	295	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(501.356)	2	19/03/2018	582	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.002.300)	4	19/03/2018	1.626	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.002.436)	4	19/03/2018	1.473	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.002.396)	4	19/03/2018	1.518	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.606)	1	19/03/2018	371	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.575)	1	19/03/2018	406	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.594)	1	19/03/2018	385	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.516.398)	18	17/09/2018	786	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.900)	1	18/09/2017	(14)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.516.242)	18	18/06/2018	962	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.550)	3	13/03/2017	(210)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.838)	1	13/03/2017	(56)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.258.939)	9	18/12/2017	(815)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.254.988)	5	18/06/2018	(267)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.625)	3	13/03/2017	(294)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.003.785)	4	18/09/2017	(263)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(501.929)	2	18/06/2018	(32)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.254.375)	5	13/03/2017	(490)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.759.487)	11	13/03/2017	(925)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.265.492)	17	17/09/2018	737	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.912)	1	18/09/2017	(28)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.007.544)	8	17/09/2018	62	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.897)	3	17/09/2018	(52)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.006.800)	8	18/09/2017	336	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.006.880)	8	18/12/2017	471	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.006.882)	8	19/03/2018	693	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.826)	1	18/06/2018	139	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.756.605)	7	19/06/2017	(832)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.007.747)	8	18/09/2017	(725)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(501.971)	2	18/12/2017	(163)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.505.927)	6	19/03/2018	(339)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.007.200)	8	19/06/2017	(560)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.258.388)	9	18/09/2017	(449)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.756.663)	7	18/12/2017	(309)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.007.555)	8	19/03/2018	(62)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.007.591)	8	19/06/2017	(999)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(501.933)	2	18/09/2017	(177)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.007.496)	8	19/06/2017	(892)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.262.434)	13	18/09/2017	(1.005)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.756.757)	7	18/12/2017	(415)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.007.657)	8	19/03/2018	(176)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.824)	3	18/06/2018	30	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.515.600)	18	18/06/2018	1.682	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.264.619)	17	17/09/2018	1.716	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.515.541)	18	18/06/2018	1.747	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.005.500)	8	19/03/2018	2.242	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Futures (Fortsetzung) börsengehandelt

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.504.133)	6	19/03/2018	1.672	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.688)	1	19/03/2018	280	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.091)	3	19/03/2018	808	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(501.350)	2	19/03/2018	589	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.002.594)	4	19/03/2018	1.295	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.675)	1	19/03/2018	294	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.662)	1	19/03/2018	308	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.757.558)	11	18/12/2017	2.779	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.007.799)	12	19/03/2018	3.668	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.507.170)	10	19/06/2017	1.351	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.760.514)	15	18/12/2017	3.558	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.509.195)	14	19/03/2018	4.405	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.002.927)	4	19/06/2017	474	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.504.385)	6	18/09/2017	1.053	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.259.181)	13	18/12/2017	3.006	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.005.362)	8	19/03/2018	2.396	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.700)	1	18/12/2017	238	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.755.162)	7	19/06/2017	785	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.504.425)	6	18/09/2017	1.009	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.011.607)	16	18/12/2017	3.355	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.256.357)	9	19/03/2018	2.332	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.761.331)	15	18/12/2017	2.641	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.011.597)	16	19/03/2018	3.815	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.760.418)	15	19/03/2018	4.085	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.256.549)	9	18/12/2017	1.865	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.761.192)	15	19/03/2018	3.218	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.318)	3	19/03/2018	554	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.758.000)	11	18/06/2018	2.746	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.761.085)	15	18/06/2018	3.548	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.760.687)	15	18/06/2018	3.994	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.507.122)	10	18/06/2018	2.666	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.808)	1	19/06/2017	33	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.006.691)	8	18/09/2017	458	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.755.835)	7	19/03/2018	815	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.003.214)	4	18/06/2018	657	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(501.601)	2	19/06/2017	83	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.511.729)	14	18/09/2017	780	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.512.076)	14	18/12/2017	783	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.010.221)	12	19/03/2018	1.154	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.759.099)	11	18/06/2018	1.515	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.825)	1	19/06/2017	14	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.756.033)	7	18/09/2017	201	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.505.241)	6	18/12/2017	262	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.505.174)	6	19/03/2018	505	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.254.145)	5	18/06/2018	678	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(501.650)	2	19/06/2017	29	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.006.799)	8	18/09/2017	338	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.756.031)	7	18/12/2017	400	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.755.939)	7	19/03/2018	699	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.755.715)	7	18/06/2018	1.048	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.475)	3	19/06/2017	42	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(753.089)	3	18/06/2018	(267)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.509.624)	10	13/03/2017	(1.961)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.760.971)	11	19/06/2017	(1.971)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.008.195)	8	18/09/2017	(1.227)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.004.128)	4	18/12/2017	(536)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.258.744)	9	13/03/2017	(1.856)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.757.100)	7	19/06/2017	(1.388)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.259.534)	9	18/09/2017	(1.734)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.259.601)	9	18/12/2017	(1.557)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(753.203)	3	18/06/2018	(396)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.254.812)	5	13/03/2017	(981)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.506.145)	6	18/09/2017	(919)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.756.562)	7	13/03/2017	(1.177)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.259.086)	9	18/09/2017	(1.232)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.008.200)	8	18/12/2017	(1.009)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.004.050)	4	18/06/2018	(280)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.003.750)	4	13/03/2017	(673)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.254.995)	5	18/09/2017	(625)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.255.012)	5	18/12/2017	(504)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.756.936)	7	18/06/2018	(321)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.850)	3	19/03/2018	(42)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(501.825)	2	18/06/2018	84	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.007.404)	8	19/06/2017	(789)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.950)	1	18/09/2017	(70)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.764.398)	15	13/03/2017	(2.898)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.509.923)	10	19/06/2017	(1.735)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.267.212)	17	18/09/2017	(2.382)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.263.483)	13	18/12/2017	(1.816)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.004.192)	4	19/03/2018	(496)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.008.375)	8	18/06/2018	(868)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.517.145)	18	13/03/2017	(3.329)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.509.871)	10	19/06/2017	(1.677)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.514.169)	14	18/09/2017	(1.954)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.757.178)	7	18/12/2017	(886)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(502.047)	2	18/06/2018	(164)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(3.512.421)	14	18/09/2017	5	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(752.475)	3	19/06/2017	42	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.837)	1	19/03/2018	112	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(250.838)	1	18/06/2018	126	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.013.960)	16	17/09/2018	1.390	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.504.950)	6	13/03/2017	(252)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.013.600)	16	18/09/2017	673	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.766.387)	19	18/12/2017	1.065	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Futures (Fortsetzung)
börsengehandelt

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(6.773.287)	27	19/03/2018	2.270	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.759.657)	11	18/12/2017	426	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.258.046)	9	19/03/2018	439	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.508.770)	10	18/06/2018	818	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.492.462)	20	21/12/2016	(1.249)	(0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.505.109)	6	18/06/2018	662	0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.264.798)	17	17/09/2018	1.516	0,00
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.153	(1)	13/03/2017	81	0,00
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.101	(1)	13/03/2017	27	0,00
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.095	(1)	13/03/2017	20	0,00
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.125	(1)	13/03/2017	52	0,00
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.133	(1)	19/06/2017	34	0,00
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.111	(1)	13/03/2017	37	0,00
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.126	(1)	19/06/2017	27	0,00
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	755.901	(3)	13/03/2017	(334)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	503.955	(2)	19/06/2017	(252)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	504.050	(2)	19/06/2017	(155)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.017	(1)	18/09/2017	(85)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	755.927	(3)	13/03/2017	(307)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	504.000	(2)	19/06/2017	(206)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	251.998	(1)	18/09/2017	(106)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.078	(1)	18/09/2017	(23)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	756.015	(3)	13/03/2017	(216)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	755.815	(3)	13/03/2017	(423)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	755.822	(3)	13/03/2017	(415)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	503.852	(2)	19/06/2017	(358)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	251.919	(1)	18/09/2017	(187)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	755.981	(3)	13/03/2017	(251)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	503.852	(2)	19/06/2017	(358)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	251.936	(1)	18/09/2017	(169)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	504.087	(2)	18/09/2017	(116)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	251.961	(1)	18/09/2017	(143)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	755.885	(3)	13/03/2017	(350)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	503.953	(2)	19/06/2017	(254)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	251.982	(1)	18/09/2017	(121)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	755.932	(3)	13/03/2017	(302)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.059	(1)	19/06/2017	(42)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.051	(1)	18/09/2017	(51)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.025	(1)	13/03/2017	(52)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.022	(1)	19/06/2017	(80)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	504.000	(2)	13/03/2017	(155)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	251.997	(1)	19/06/2017	(106)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	504.000	(2)	18/09/2017	(206)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	503.995	(2)	13/03/2017	(160)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	504.000	(2)	19/06/2017	(206)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	251.981	(1)	18/09/2017	(123)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.043	(1)	13/03/2017	(33)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.113	(1)	19/06/2017	13	0,00
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.043	(1)	13/03/2017	(33)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.050	(1)	19/06/2017	(52)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.049	(1)	13/03/2017	(27)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.060	(1)	13/03/2017	(15)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.091	(1)	19/06/2017	(10)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.025	(1)	18/09/2017	(77)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.091	(1)	18/09/2017	(9)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	755.831	(3)	13/03/2017	(406)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	503.906	(2)	19/06/2017	(303)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	251.943	(1)	18/09/2017	(162)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	756.057	(3)	13/03/2017	(173)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	504.032	(2)	19/06/2017	(173)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.004	(1)	18/09/2017	(98)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	503.997	(2)	19/06/2017	(209)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	251.940	(1)	18/09/2017	(165)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	504.016	(2)	13/03/2017	(138)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	252.003	(1)	19/06/2017	(100)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	251.962	(1)	18/09/2017	(142)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	755.850	(3)	13/03/2017	(386)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	503.933	(2)	19/06/2017	(275)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	503.958	(2)	19/06/2017	(250)	(0,00)
3 Month Euro Swiss Franc ICE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CHF	503.929	(2)	18/09/2017	(279)	(0,00)
5 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(971.249)	8	30/12/2016	2.376	0,00
5 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.210.660)	10	30/12/2016	6.371	0,00
5 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(18.952.771)	156	30/12/2016	32.918	0,01
5 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(4.003.015)	33	30/12/2016	13.188	0,00
5 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.894.913)	32	30/12/2016	(413)	(0,00)
5 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.459.532)	12	30/12/2016	906	0,00
5 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.283.547)	27	30/12/2016	2.438	0,00
5 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(5.963.594)	49	30/12/2016	(141)	(0,00)
5 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.699.594)	14	30/12/2016	4.250	0,00
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	17.925.328	(18)	03/09/2017	(992)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	1.991.799	(2)	06/08/2017	(186)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	2.987.771	(3)	06/08/2017	(225)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	4.979.006	(5)	03/09/2017	(468)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	5.975.096	(6)	06/08/2017	(790)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	1.991.694	(2)	03/09/2017	(117)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	2.987.697	(3)	06/08/2017	(281)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	10.954.261	(11)	03/09/2017	(687)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	1.991.700	(2)	03/09/2017	(112)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	10.954.816	(11)	06/08/2017	(1.087)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	7.966.801	(8)	03/09/2017	(449)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	6.971.294	(7)	06/08/2017	(655)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	6.970.780	(7)	03/09/2017	(787)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	6.971.122	(7)	06/08/2017	(524)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	2.987.551	(3)	03/09/2017	(169)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortssetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Futures (Fortssetzung)
börsengehandelt

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	2.987.714	(3)	06/08/2017	(268)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	1.991.696	(2)	03/09/2017	(116)	(0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	1.991.836	(2)	06/08/2017	(158)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	1.237.469	(5)	13/03/2017	(718)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	8.415.676	(34)	13/03/2017	(3.999)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	23.525.969	(95)	13/03/2017	406	0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	22.776.207	(92)	19/06/2017	457	0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(741.695)	3	18/06/2018	55	0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.954.261)	16	17/09/2018	539	0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(2.966.331)	12	18/06/2018	669	0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	5.939.887	(24)	19/06/2017	(1.613)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	6.679.970	(27)	18/09/2017	(1.855)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	247.563	(1)	13/03/2017	(75)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	2.227.235	(9)	19/06/2017	(828)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	2.473.820	(10)	18/09/2017	(930)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(5.191.114)	21	17/09/2018	(439)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(2.224.350)	9	18/06/2018	900	0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	12.872.938	(52)	13/03/2017	(4.212)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	11.135.934	(45)	19/06/2017	(4.379)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	9.400.095	(38)	18/09/2017	(3.955)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(5.933.599)	24	17/09/2018	(1.399)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	6.929.530	(28)	13/03/2017	(4.320)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	4.453.131	(18)	19/06/2017	(2.994)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	1.483.803	(6)	18/09/2017	(1.047)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.709.501)	15	19/03/2018	374	0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.213.866)	13	18/06/2018	384	0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.212.876)	13	17/09/2018	399	0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	8.663.805	(35)	13/03/2017	(3.508)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	7.422.600	(30)	19/06/2017	(4.275)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	6.183.072	(25)	18/09/2017	(3.803)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	4.944.219	(20)	18/12/2017	(3.281)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	5.941.769	(24)	13/03/2017	(1.531)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	9.898.921	(40)	19/06/2017	(3.579)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	9.894.946	(40)	18/09/2017	(4.054)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	8.654.367	(35)	18/12/2017	(3.758)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	495.175	(2)	13/03/2017	(100)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	989.900	(4)	19/06/2017	(350)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	2.226.552	(9)	18/09/2017	(723)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	1.483.714	(6)	18/12/2017	(536)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(494.675)	2	19/03/2018	(25)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.461.679)	14	18/06/2018	(179)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.707.839)	15	17/09/2018	(214)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	15.099.269	(61)	13/03/2017	(6.619)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	12.618.701	(51)	19/06/2017	(6.986)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	9.893.287	(40)	18/09/2017	(5.713)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	6.188.238	(25)	13/03/2017	(2.700)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(4.946.855)	20	19/03/2018	(355)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(5.687.128)	23	18/06/2018	(378)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	6.189.606	(25)	13/03/2017	(1.332)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	12.130.265	(49)	13/03/2017	(3.972)	(0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	989.803	(4)	19/06/2017	(447)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.588)	1	21/06/2017	97	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.767)	3	20/09/2017	335	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.158)	2	20/12/2017	282	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.561)	1	21/03/2018	165	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.538)	1	20/06/2018	195	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(498.350)	4	15/03/2017	260	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(622.778)	5	20/06/2018	857	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.121.459)	9	15/03/2017	362	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(996.735)	8	21/06/2017	734	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(996.738)	8	20/09/2017	860	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(996.628)	8	20/12/2017	1.133	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(996.582)	8	21/03/2018	1.193	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.243.247)	18	15/03/2017	296	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.994.030)	16	21/06/2017	740	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.495.445)	12	20/09/2017	850	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.370.781)	11	20/12/2017	1.015	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.246.086)	10	21/03/2018	1.025	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.619.706)	13	20/06/2018	1.599	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.262)	2	15/03/2017	17	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.249)	2	21/06/2017	98	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.370.836)	11	20/09/2017	764	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.246.110)	10	20/12/2017	993	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.245.984)	10	21/03/2018	1.157	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.121.244)	9	20/06/2018	1.225	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(997.027)	8	15/03/2017	95	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(872.387)	7	21/06/2017	326	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(498.507)	4	20/09/2017	250	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(498.461)	4	20/12/2017	375	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.834)	3	21/03/2018	296	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.778)	3	20/06/2018	369	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.637)	1	15/03/2017	1	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.725)	1	21/06/2017	(81)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.870.687)	15	15/03/2017	(1.461)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.870.687)	15	21/06/2017	(974)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.122.412)	9	20/09/2017	(438)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(872.935)	7	20/12/2017	(159)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(997.600)	8	21/03/2018	(130)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(872.800)	7	20/06/2018	16	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.122.386)	9	20/12/2017	(257)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(997.662)	8	21/03/2018	(211)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.122.269)	9	20/06/2018	(106)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.496.550)	12	15/03/2017	(1.169)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.371.845)	11	21/06/2017	(724)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Futures (Fortsetzung)
börsengehandelt

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.247.128)	10	20/09/2017	(491)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.496.747)	12	15/03/2017	(1.425)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.122.525)	9	21/06/2017	(730)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.247.250)	10	20/09/2017	(649)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.371.865)	11	20/12/2017	(393)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.371.904)	11	21/03/2018	(444)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.247.164)	10	20/06/2018	(375)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(872.942)	7	15/03/2017	(623)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(498.899)	4	21/06/2017	(323)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(623.611)	5	20/09/2017	(306)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(498.875)	4	20/12/2017	(162)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(623.590)	5	21/03/2018	(198)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(748.256)	6	20/06/2018	(171)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.365.550)	27	21/06/2017	438	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.240.971)	26	20/09/2017	752	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.867.048)	23	20/12/2017	993	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.991.843)	24	21/03/2018	854	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.866.570)	23	20/06/2018	1.613	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(6.730.311)	54	15/03/2017	148	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(5.858.550)	47	21/06/2017	763	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.745.218)	14	20/09/2017	301	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(6.232.822)	50	20/12/2017	2.016	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.321)	2	21/06/2017	5	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(872.637)	7	20/09/2017	114	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.613.932)	29	19/09/2018	1.663	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(498.799)	4	20/09/2017	(129)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.418)	2	20/12/2017	(55)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.413)	2	21/03/2018	(49)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.371.760)	11	20/06/2018	(257)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.614.593)	29	19/09/2018	804	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.121.937)	9	20/09/2017	180	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.300)	2	15/03/2017	(32)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.613)	1	21/12/2016	(49)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.240.737)	26	15/03/2017	(211)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.742.300)	22	21/06/2017	357	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.119.050)	17	20/09/2017	552	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.745.100)	14	20/12/2017	682	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.495.800)	12	21/03/2018	584	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.246.350)	10	20/06/2018	682	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(747.823)	6	15/03/2017	3	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(997.100)	8	21/06/2017	260	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.495.650)	12	20/09/2017	584	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(872.415)	7	20/12/2017	516	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(623.062)	5	21/03/2018	488	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(498.350)	4	20/06/2018	520	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.487.611)	28	19/09/2018	3.817	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(623.275)	5	15/03/2017	(114)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.350)	2	21/06/2017	(32)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.246.875)	10	20/09/2017	(162)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(374.033)	3	20/12/2017	39	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(374.025)	3	21/03/2018	49	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.988.341)	32	21/06/2017	1.115	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.370.920)	11	20/09/2017	655	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.741.820)	22	20/12/2017	1.694	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(498.444)	4	21/03/2018	397	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.371.287)	11	20/09/2017	179	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.994.584)	16	20/12/2017	541	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.119.038)	17	21/03/2018	843	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.994.000)	16	20/06/2018	1.299	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.738.046)	30	19/09/2018	2.375	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.960)	3	20/06/2018	133	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.113)	1	21/06/2017	714	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(372.347)	3	21/06/2017	2.131	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(744.898)	6	21/06/2017	3.996	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.241.499)	10	21/06/2017	6.656	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(496.676)	4	21/06/2017	2.564	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(372.577)	3	21/06/2017	1.831	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.118.016)	9	21/06/2017	5.125	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.214)	1	21/06/2017	583	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(496.819)	4	21/06/2017	2.378	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(748.050)	6	15/03/2017	(292)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.870.648)	15	20/09/2017	(679)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(997.716)	8	20/12/2017	(281)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.494.281)	20	21/03/2018	(689)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.369.300)	19	20/06/2018	(308)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.621.338)	13	21/03/2018	(520)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.368.112)	19	21/06/2017	617	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.243.700)	18	20/09/2017	584	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.994.200)	16	20/12/2017	1.039	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.744.925)	14	21/03/2018	909	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.744.750)	14	20/06/2018	1.136	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.246.820)	10	19/09/2018	(253)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.130)	1	21/06/2017	692	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.994.199)	16	21/06/2017	520	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(997.099)	8	20/09/2017	391	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(498.520)	4	20/12/2017	298	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.736.994)	30	19/09/2018	3.741	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(623.312)	5	15/03/2017	(162)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(623.375)	5	21/06/2017	(81)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.371.457)	11	20/09/2017	(41)	(0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.867.525)	23	20/12/2017	373	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.617.918)	21	21/03/2018	675	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.368.348)	19	20/06/2018	928	0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.987.789)	32	19/09/2018	1.832	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Futures (Fortsetzung) börsengehandelt

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) des Nettovermögens
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.741.200)	22	21/12/2016	(714) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.991.262)	24	15/03/2017	49 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.590)	1	20/06/2018	126 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.612.390)	29	19/09/2018	3.666 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.371.329)	11	19/09/2018	(54) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.705)	1	20/09/2017	(39) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.706)	1	20/12/2017	(24) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.696)	1	21/03/2018	(11) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.678)	1	20/06/2018	12 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.700)	1	15/03/2017	(81) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.700)	1	21/06/2017	(49) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.744.895)	14	19/09/2018	494 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(623.312)	5	15/03/2017	(162) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.995.117)	16	20/09/2017	(412) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(623.465)	5	20/12/2017	(36) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.663)	1	15/03/2017	(32) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.621.100)	13	20/09/2017	(422) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(748.200)	6	20/12/2017	(97) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.371.700)	11	21/03/2018	(179) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.745.711)	14	20/06/2018	(112) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.620.814)	13	19/09/2018	(262) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.369.062)	19	19/09/2018	(617) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.120.125)	17	20/06/2018	(568) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.369.310)	19	19/09/2018	(938) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(872.637)	7	15/03/2017	(227) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.870.680)	15	20/09/2017	(720) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.621.313)	13	20/12/2017	(488) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(622.554)	5	15/03/2017	823 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.510)	1	20/09/2017	214 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.864.053)	23	15/03/2017	3.389 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(871.540)	7	20/09/2017	1.538 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.501)	1	20/12/2017	243 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.368.350)	19	21/06/2017	308 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.620.376)	13	20/09/2017	518 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.495.686)	12	20/12/2017	732 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(248.303)	2	21/06/2017	1.328 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(248.411)	2	21/06/2017	1.187 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(248.550)	2	15/03/2017	942 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.726.681)	30	21/06/2017	17.134 0,01
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.365.869)	11	20/09/2017	7.215 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.482.338)	20	20/12/2017	14.820 0,01
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.985.011)	16	21/03/2018	12.971 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.739.622)	14	15/03/2017	6.887 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.117.898)	9	21/06/2017	5.278 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(869.110)	7	20/09/2017	4.694 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(620.480)	5	20/12/2017	3.841 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(372.127)	3	21/03/2018	2.514 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.242.500)	10	15/03/2017	5.032 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.236.725)	18	15/03/2017	8.766 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(621.224)	5	15/03/2017	2.549 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(372.078)	3	21/03/2018	2.577 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.490.848)	12	15/03/2017	6.236 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(620.922)	5	21/06/2017	3.104 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.138)	1	20/09/2017	698 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.087)	1	20/12/2017	780 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.862.917)	15	15/03/2017	8.630 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(993.069)	8	21/06/2017	5.494 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(992.485)	8	20/09/2017	6.383 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(991.902)	8	20/12/2017	7.270 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(619.672)	5	21/03/2018	4.890 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.862.978)	15	15/03/2017	8.551 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.241.350)	10	21/06/2017	6.850 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(868.460)	7	20/09/2017	5.539 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(247.999)	2	20/12/2017	1.787 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(371.822)	3	21/03/2018	2.909 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(248.405)	2	15/03/2017	1.130 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.137)	1	21/06/2017	682 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.476.186)	28	21/06/2017	18.652 0,01
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.349.810)	27	20/09/2017	21.316 0,01
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.603.605)	21	20/12/2017	19.261 0,01
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.363.080)	11	21/03/2018	11.015 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.490.099)	12	21/06/2017	7.598 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.606.086)	21	20/09/2017	15.699 0,01
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.364.123)	11	20/12/2017	9.661 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.115.510)	9	21/03/2018	8.672 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(372.600)	3	21/06/2017	1.802 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(869.057)	7	20/09/2017	4.763 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.861.047)	15	20/12/2017	12.032 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.356.469)	19	21/03/2018	16.353 0,01
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.611.645)	13	20/06/2018	12.067 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.102.302)	25	20/06/2018	19.330 0,01
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(744.781)	6	21/03/2018	4.343 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.729.705)	22	20/06/2018	17.427 0,01
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(248.270)	2	21/03/2018	1.435 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.736.890)	14	20/06/2018	11.343 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.313)	1	20/09/2017	471 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(248.526)	2	20/12/2017	1.102 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(496.924)	4	21/03/2018	2.372 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(248.425)	2	20/06/2018	1.234 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(621.079)	5	20/12/2017	3.062 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(745.091)	6	21/03/2018	3.940 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(620.715)	5	20/06/2018	3.535 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.338)	1	15/03/2017	390 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(497.059)	4	20/09/2017	2.131 0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 i. n USD angegeben

Futures (Fortsetzung) börsengehandelt

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust in USD des Nettovermögens
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.621)	1	20/09/2017	71 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.217)	2	20/12/2017	205 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.248)	2	15/03/2017	35 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.200)	2	20/09/2017	195 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.592)	1	20/12/2017	124 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.174)	2	21/03/2018	262 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.144)	2	20/06/2018	300 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.952)	3	15/03/2017	(51) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.210)	2	21/03/2018	214 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.193)	2	20/06/2018	237 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.271)	2	20/09/2017	103 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.855)	3	20/12/2017	270 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.625)	1	15/03/2017	16 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.588)	1	20/09/2017	114 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.563)	1	20/12/2017	162 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.550)	1	21/03/2018	179 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.525)	1	20/06/2018	211 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(498.500)	4	15/03/2017	65 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.800)	3	20/09/2017	292 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.150)	2	20/12/2017	292 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.073)	2	20/06/2018	392 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(996.655)	8	20/12/2017	1.097 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(871.942)	7	21/03/2018	1.130 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(747.201)	6	20/06/2018	1.200 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.495.568)	12	15/03/2017	107 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(747.767)	6	21/06/2017	271 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(996.818)	8	20/09/2017	756 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.658)	3	20/09/2017	476 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.601)	3	20/12/2017	599 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.564)	3	21/03/2018	647 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.490)	3	20/06/2018	743 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.150)	2	15/03/2017	162 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.122)	2	21/06/2017	263 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(622.665)	5	20/06/2018	1.003 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(872.227)	7	15/03/2017	305 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(872.245)	7	21/06/2017	509 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(872.121)	7	20/09/2017	784 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(747.437)	6	20/12/2017	894 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(622.783)	5	21/03/2018	850 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.118.200)	17	15/03/2017	828 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.619.770)	13	21/06/2017	1.094 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.495.041)	12	20/09/2017	1.375 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.370.215)	11	20/12/2017	1.749 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.369.929)	11	21/03/2018	2.122 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.245.356)	10	20/06/2018	1.972 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.693)	3	21/06/2017	382 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.664)	3	20/09/2017	469 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.589)	3	20/12/2017	615 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.037)	2	21/03/2018	438 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.495)	1	20/06/2018	250 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.658)	3	15/03/2017	330 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.910)	3	15/03/2017	3 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.637)	1	20/09/2017	49 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(124.630)	1	20/12/2017	75 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.370.998)	11	20/12/2017	733 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(872.417)	7	21/03/2018	513 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(747.620)	6	20/06/2018	656 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.368.263)	19	15/03/2017	(195) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.371.115)	11	20/09/2017	402 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.202)	2	21/03/2018	225 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(249.156)	2	20/06/2018	285 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(498.549)	4	15/03/2017	2 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(373.980)	3	15/03/2017	(88) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.371.416)	11	20/09/2017	12 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.371.277)	11	20/12/2017	370 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.371.141)	11	21/03/2018	548 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.495.500)	12	20/06/2018	974 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.488.799)	28	19/09/2018	2.274 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(5.983.336)	48	21/03/2018	2.161 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(5.733.000)	46	20/06/2018	3.409 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.744.791)	14	20/12/2017	1.083 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.246.293)	10	21/03/2018	755 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.370.652)	11	20/06/2018	1.182 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.612.183)	29	19/09/2018	3.934 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.991.527)	24	15/03/2017	(294) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.618.078)	21	21/06/2017	(215) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.994.777)	16	20/09/2017	30 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.994.665)	16	20/12/2017	435 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.745.273)	14	21/03/2018	457 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.620.601)	13	20/06/2018	437 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.744.732)	14	21/03/2018	1.160 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(623.004)	5	20/06/2018	563 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.737.387)	30	19/09/2018	3.231 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(748.093)	6	21/03/2018	42 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(748.024)	6	20/06/2018	132 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(997.249)	8	19/09/2018	66 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.993.731)	16	21/12/2016	(689) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.490.002)	28	15/03/2017	(197) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.738.174)	30	19/09/2018	2.209 0,00
Australian 10 Year Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	7.332.135	(65)	15/12/2016	(25.290) (0,01)
Australian 10 Year Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	6.097.744	(54)	15/12/2016	(31.725) (0,01)
Australian 10 Year Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	8.012.549	(71)	15/12/2016	(24.868) (0,01)
Australian 10 Year Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	1.355.471	(12)	15/12/2016	(3.256) (0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Futures (Fortsetzung) börsengehandelt

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust in USD des Nettovermögens
Australian 10 Year Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	8.910.074	(79)	15/12/2016	(16.086) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	247.612	(1)	19/12/2016	(144) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.229.050	(9)	19/12/2016	(877) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	1.981.182	(8)	13/03/2017	(1.234) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.476.969	(10)	13/03/2017	(1.168) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	1.486.698	(6)	13/03/2017	(306) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	247.823	(1)	13/03/2017	(21) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	1.981.481	(8)	19/12/2016	(701) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	3.715.265	(15)	13/03/2017	(1.896) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	247.685	(1)	19/12/2016	(88) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.724.446	(11)	13/03/2017	(1.452) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.972.768	(12)	13/03/2017	(1.092) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	3.467.203	(14)	13/03/2017	(2.057) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	743.138	(3)	19/12/2016	(200) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	1.734.316	(7)	13/03/2017	(484) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.972.507	(12)	13/03/2017	(1.292) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.724.681	(11)	19/06/2017	(1.378) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	1.734.181	(7)	13/03/2017	(587) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	1.981.913	(8)	19/06/2017	(753) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	1.238.813	(5)	13/03/2017	(333) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	1.982.045	(8)	19/06/2017	(652) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	247.700	(1)	13/03/2017	(114) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.724.456	(11)	19/06/2017	(1.550) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	3.963.044	(16)	19/12/2016	(1.339) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.229.749	(9)	19/06/2017	(773) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	1.734.997	(7)	19/06/2017	(31) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.972.272	(12)	13/03/2017	(1.471) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.724.521	(11)	19/06/2017	(1.500) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	3.219.914	(13)	13/03/2017	(1.629) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.972.725	(12)	13/03/2017	(1.125) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.477.266	(10)	19/06/2017	(1.037) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	1.734.116	(7)	19/06/2017	(703) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	1.733.818	(7)	13/03/2017	(864) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.477.583	(10)	19/06/2017	(795) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.972.355	(12)	13/03/2017	(1.407) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.476.839	(10)	19/06/2017	(1.362) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	1.486.349	(6)	13/03/2017	(572) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.229.369	(9)	19/06/2017	(1.063) (0,00)
DJIA MINI e-CBOT Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(6.568.854)	72	16/12/2016	(35.934) (0,01)
DJIA MINI e-CBOT Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(5.120.662)	57	16/12/2016	51.233 0,02
Euro-Bobl Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.978.872)	15	12/08/2016	4.123 0,00
Euro-Bobl Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(396.655)	3	12/08/2016	(163) (0,00)
Euro-Bobl Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.850.034)	14	12/08/2016	388 0,00
Euro-Bobl Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(20.136.511)	153	12/08/2016	95.841 0,03
Euro-Bobl Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.052.948)	8	12/08/2016	4.946 0,00
Euro-Bobl Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(5.924.147)	45	12/08/2016	26.346 0,01
Euro-Bobl Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.740.680)	36	12/08/2016	19.550 0,01
Euro-Bobl Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.582.164)	12	12/08/2016	4.344 0,00
Euro-Bobl Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(29.356.590)	223	12/08/2016	131.510 0,04
Euro-Bobl Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(14.745.665)	112	12/08/2016	64.315 0,02
Euro-BTP Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(21.465.004)	150	12/08/2016	(5) (0,00)
Euro-BTP Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(990.226)	7	12/08/2016	12.862 0,00
Euro-BTP Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(141.360)	1	12/08/2016	1.950 0,00
Euro-BTP Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.571.737)	11	12/08/2016	2.648 0,00
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(992.083)	6	12/08/2016	3.785 0,00
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(2.821.610)	17	12/08/2016	(1.278) (0,00)
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(827.503)	5	12/08/2016	2.294 0,00
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(662.904)	4	12/08/2016	825 0,00
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(328.098)	2	12/08/2016	4.172 0,00
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(993.108)	6	12/08/2016	2.637 0,00
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(9.223.144)	56	12/08/2016	76.018 0,02
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(165.808)	1	12/08/2016	114 0,00
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.474.480)	9	12/08/2016	20.973 0,01
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.968.565)	12	12/08/2016	25.059 0,01
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.153.008)	7	12/08/2016	9.373 0,00
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(11.840.902)	72	12/08/2016	117.272 0,03
Euro-Buxl 30 Year Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(192.193)	1	12/08/2016	434 0,00
Euro-Buxl 30 Year Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(578.944)	3	12/08/2016	(1.350) (0,00)
Euro-Buxl 30 Year Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(192.660)	1	12/08/2016	(90) (0,00)
Euro-Buxl 30 Year Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(960.189)	5	12/08/2016	3.039 0,00
Euro-Buxl 30 Year Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(570.960)	3	12/08/2016	7.600 0,00
Euro-Buxl 30 Year Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(192.627)	1	12/08/2016	(53) (0,00)
Euro-Oat Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(801.322)	5	12/08/2016	(25) (0,00)
Euro-Oat Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(801.603)	5	12/08/2016	(339) (0,00)
Euro-Oat Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(633.935)	4	12/08/2016	7.964 0,00
Euro-Oat Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.583.926)	10	12/08/2016	20.933 0,01
Euro-Oat Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(160.272)	1	12/08/2016	(13) (0,00)
Euro-Oat Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(158.689)	1	12/08/2016	1.761 0,00
Euro-Oat Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(14.326.200)	90	12/08/2016	108.956 0,03
Euro-Oat Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.422.612)	9	12/08/2016	22.115 0,01
Euro-Oat Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(1.269.178)	8	12/08/2016	14.462 0,00
Euro-Oat Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(473.957)	3	12/08/2016	7.648 0,00
Euro-Schatz Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(637.818)	4	12/08/2016	3.612 0,00
Euro-Schatz Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(17.806.372)	159	12/08/2016	29.451 0,01
Euro-Schatz Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(26.878.800)	240	12/08/2016	43.044 0,01
Euro-Schatz Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(4.368.695)	39	12/08/2016	5.998 0,00
Euro-Schatz Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(560.509)	5	12/08/2016	298 0,00
Euro-Schatz Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(20.610.440)	184	12/08/2016	29.235 0,01
Euro-Schatz Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(12.099.992)	108	12/08/2016	14.290 0,00
FTSE CHINA A50 Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(324.190)	34	28/10/2016	1.105 0,00
KOSPI 200 Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	KRW	(130.668.142)	1	12/08/2016	(1.424) (0,00)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(920.021)	7	28/12/2016	(4.741) (0,00)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(787.900)	6	28/12/2016	(3.169) (0,00)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(3.801.900)	29	28/12/2016	(7.155) (0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Futures (Fortsetzung) börsengehandelt

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust in USD	% des Nettovermögens
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.805.484)	14	28/12/2016	35.395	0,01
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(655.969)	5	28/12/2016	(1.843)	(0,00)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.670.654)	13	28/12/2016	40.485	0,01
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(387.395)	3	28/12/2016	6.928	0,00
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(786.060)	6	28/12/2016	(779)	(0,00)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.961.489)	15	28/12/2016	2.806	0,00
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.290.732)	10	28/12/2016	23.853	0,01
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(2.494.533)	19	28/12/2016	(9.406)	(0,00)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.294.503)	10	28/12/2016	18.955	0,01
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(526.417)	4	28/12/2016	(3.606)	(0,00)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.671.109)	13	28/12/2016	39.894	0,01
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(1.173.975)	9	28/12/2016	5.474	0,00
mini MSCI EAFE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(503.578)	6	16/12/2016	4.772	0,00
mini MSCI EAFE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(593.667)	7	16/12/2016	(592)	(0,00)
mini MSCI EAFE Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(259.218)	3	16/12/2016	(5.043)	(0,00)
mini MSCI Emerging Market Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(2.592.753)	56	16/12/2016	(48.673)	(0,01)
mini MSCI Emerging Market Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(6.379.740)	138	16/12/2016	(110.400)	(0,03)
MSCI Singapore Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	SGD	(4.990.638)	160	28/10/2016	37.967	0,01
NASDAQ 100 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(8.193.532)	86	16/12/2016	146.748	0,04
NASDAQ 100 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(7.935.322)	85	16/12/2016	307.978	0,09
NASDAQ 100 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(764.910)	8	16/12/2016	10.930	0,00
NASDAQ 100 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(192.282)	2	16/12/2016	1.678	0,00
NASDAQ 100 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.347.881)	14	16/12/2016	9.839	0,00
NASDAQ 100 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(287.552)	3	16/12/2016	3.388	0,00
NIKKEI 225 (OSE) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	JPY	186.863.319	(11)	12/08/2016	58.394	0,02
OMXS30 Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	SEK	(141.608)	1	21/10/2016	136	0,00
OMXS30 Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	SEK	(1.857.266)	13	21/10/2016	(139)	(0,00)
OMXS30 Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	SEK	(19.237.570)	136	21/10/2016	20.930	0,01
Russell 2000 Mini Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.330.281)	11	16/12/2016	29.319	0,01
Russell 2000 Mini Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(246.202)	2	16/12/2016	998	0,00
Russell 2000 Mini Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(368.656)	3	16/12/2016	2.144	0,00
Russell 2000 Mini Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(4.356.180)	36	16/12/2016	93.420	0,03
Russell 2000 Mini Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(994.000)	8	16/12/2016	(5.200)	(0,00)
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(743.669)	7	16/12/2016	9.531	0,00
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(4.303.700)	40	16/12/2016	300	0,00
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.058.000)	10	16/12/2016	18.000	0,01
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(642.175)	6	16/12/2016	3.425	0,00
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.069.062)	10	16/12/2016	6.938	0,00
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(965.169)	9	16/12/2016	3.231	0,00
S&P MID 400 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(2.776.791)	18	16/12/2016	(5.511)	(0,00)
S&P MID 400 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.727.770)	11	16/12/2016	(34.210)	(0,01)
S&P MID 400 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(2.743.494)	18	16/12/2016	27.786	0,01
S&P TSX 60 Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(11.267.585)	66	15/12/2016	45.259	0,01
S&P TSX 60 Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(2.573.028)	15	15/12/2016	970	0,00
S&P TSX 60 Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(1.847.873)	11	15/12/2016	30.471	0,01
S&P TSX 60 Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(678.189)	4	15/12/2016	6.324	0,00
SGX Nifty 50 Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.248.484)	71	27/10/2016	(20.042)	(0,00)
SPI 200 Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	(943.199)	7	15/12/2016	3.523	0,00
SPI 200 Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	(10.242.350)	79	15/12/2016	347.819	0,10
SPI 200 Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	(946.050)	7	15/12/2016	1.340	0,00
SPI 200 Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	(269.481)	2	15/12/2016	1.010	0,00
SPI 200 Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	(134.107)	1	15/12/2016	990	0,00
US LONG Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(678.042)	4	20/12/2016	(542)	(0,00)
US LONG Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.186.824)	7	20/12/2016	(1.199)	(0,00)
US LONG Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(513.089)	3	20/12/2016	(4.964)	(0,00)
US LONG Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.182.207)	7	20/12/2016	3.418	0,00
US LONG Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(505.103)	3	20/12/2016	3.022	0,00
US LONG Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.184.746)	7	20/12/2016	879	0,00
US LONG Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(335.722)	2	20/12/2016	3.028	0,00
US ULTRA Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(186.531)	1	20/12/2016	(1.094)	(0,00)
US ULTRA Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(562.057)	3	20/12/2016	(5.744)	(0,00)
US ULTRA Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.683.156)	9	20/12/2016	(14.219)	(0,00)
US ULTRA Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(554.734)	3	20/12/2016	1.579	0,00
US ULTRA Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(371.725)	2	20/12/2016	(850)	(0,00)
US ULTRA Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(561.000)	3	20/12/2016	(4.688)	(0,00)
US ULTRA Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(742.835)	4	20/12/2016	(1.085)	(0,00)
US ULTRA Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(751.576)	4	20/12/2016	(9.826)	(0,00)
US ULTRA Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(185.248)	1	20/12/2016	190	0,00
US ULTRA Bond (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(744.929)	4	20/12/2016	(3.179)	(0,00)
Total Futures						2.751.364	0,76

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust in USD	% des Nettovermögens
Citibank, N.A.	AUD	126.800	USD	95.431	21/12/2016	1.490	0,00
Citibank, N.A.	AUD	155.600	USD	117.443	21/12/2016	1.491	0,00
Citibank, N.A.	AUD	518.400	USD	396.601	21/12/2016	(357)	(0,00)
Citibank, N.A.	AUD	680.000	USD	512.449	21/12/2016	7.316	0,00
Citibank, N.A.	AUD	1.144.000	USD	861.926	21/12/2016	12.502	0,00
Citibank, N.A.	AUD	1.683.200	USD	1.284.872	21/12/2016	1.699	0,00
Citibank, N.A.	AUD	2.519.200	USD	1.924.676	21/12/2016	900	0,00
Citibank, N.A.	AUD	2.519.200	USD	1.927.067	21/12/2016	(1.491)	(0,00)
Citibank, N.A.	AUD	2.632.400	USD	2.016.660	21/12/2016	(4.559)	(0,00)
Citibank, N.A.	AUD	2.828.400	USD	2.151.753	21/12/2016	10.163	0,00
Citibank, N.A.	AUD	3.196.400	USD	2.438.552	21/12/2016	4.648	0,00
Citibank, N.A.	BRl	6.000	USD	1.789	21/12/2016*	15	0,00
Citibank, N.A.	BRl	18.800	USD	5.498	21/12/2016*	154	0,00
Citibank, N.A.	BRl	19.600	USD	5.972	21/12/2016*	(79)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter% des Netto-Wertzuwachs/ vermögens (-verlust) in USD
Citibank, N.A.	BRL	23.600	USD	7.023	21/12/2016*	72 0,00
Citibank, N.A.	BRL	23.600	USD	7.141	21/12/2016*	(45) (0,00)
Citibank, N.A.	BRL	24.400	USD	7.394	21/12/2016*	(58) (0,00)
Citibank, N.A.	BRL	38.000	USD	11.233	21/12/2016*	192 0,00
Citibank, N.A.	BRL	38.400	USD	11.190	21/12/2016*	355 0,00
Citibank, N.A.	BRL	40.000	USD	12.077	21/12/2016*	(51) (0,00)
Citibank, N.A.	BRL	40.400	USD	12.182	21/12/2016*	(35) (0,00)
Citibank, N.A.	BRL	40.400	USD	12.166	21/12/2016*	(20) (0,00)
Citibank, N.A.	BRL	40.400	USD	12.196	21/12/2016*	(50) (0,00)
Citibank, N.A.	BRL	40.800	USD	12.222	21/12/2016*	45 0,00
Citibank, N.A.	BRL	354.000	USD	105.792	21/12/2016*	642 0,00
Citibank, N.A.	BRL	392.400	USD	116.797	21/12/2016*	1.182 0,00
Citibank, N.A.	BRL	466.400	USD	138.637	21/12/2016*	1.590 0,00
Citibank, N.A.	BRL	540.000	USD	162.797	21/12/2016*	(441) (0,00)
Citibank, N.A.	BRL	703.290	USD	206.441	21/12/2016*	5.010 0,00
Citibank, N.A.	BRL	816.820	USD	240.653	21/12/2016*	4.932 0,00
Citibank, N.A.	BRL	930.492	USD	277.628	21/12/2016*	2.133 0,00
Citibank, N.A.	BRL	942.536	USD	280.085	21/12/2016*	3.297 0,00
Citibank, N.A.	BRL	1.155.116	USD	345.853	21/12/2016*	1.504 0,00
Citibank, N.A.	BRL	1.202.176	USD	365.554	21/12/2016*	(4.109) (0,00)
Citibank, N.A.	BRL	1.697.370	USD	504.578	21/12/2016*	5.752 0,00
Citibank, N.A.	CAD	82.400	USD	63.307	21/12/2016	(416) (0,00)
Citibank, N.A.	CAD	348.697	USD	266.405	21/12/2016	(266) (0,00)
Citibank, N.A.	CAD	417.566	USD	319.522	21/12/2016	(820) (0,00)
Citibank, N.A.	CAD	670.589	USD	519.758	21/12/2016	(7.938) (0,00)
Citibank, N.A.	CAD	689.438	USD	534.643	21/12/2016	(8.437) (0,00)
Citibank, N.A.	CAD	696.166	USD	534.670	21/12/2016	(3.329) (0,00)
Citibank, N.A.	CAD	910.000	USD	699.599	21/12/2016	(5.052) (0,00)
Citibank, N.A.	CAD	913.600	USD	701.288	21/12/2016	(3.993) (0,00)
Citibank, N.A.	CAD	1.014.000	USD	786.437	21/12/2016	(12.512) (0,00)
Citibank, N.A.	CAD	1.202.400	USD	930.298	21/12/2016	(12.580) (0,00)
Citibank, N.A.	CAD	1.256.246	USD	958.794	21/12/2016	21 0,00
Citibank, N.A.	CAD	1.376.498	USD	1.069.295	21/12/2016	(18.698) (0,00)
Citibank, N.A.	CAD	1.934.400	USD	1.473.711	21/12/2016	2.699 0,00
Citibank, N.A.	CAD	2.370.800	USD	1.839.726	21/12/2016	(30.239) (0,01)
Citibank, N.A.	CAD	2.642.800	USD	2.018.676	21/12/2016	(1.588) (0,00)
Citibank, N.A.	CLP	3.372.000	USD	5.044	21/12/2016*	53 0,00
Citibank, N.A.	CLP	3.714.800	USD	5.577	21/12/2016*	37 0,00
Citibank, N.A.	CLP	10.500.800	USD	15.535	21/12/2016*	336 0,00
Citibank, N.A.	CLP	11.935.600	USD	17.906	21/12/2016*	134 0,00
Citibank, N.A.	CLP	29.999.600	USD	44.989	21/12/2016*	353 0,00
Citibank, N.A.	CLP	36.844.000	USD	54.376	21/12/2016*	1.310 0,00
Citibank, N.A.	CLP	43.588.800	USD	65.894	21/12/2016*	(14) (0,00)
Citibank, N.A.	CLP	47.218.000	USD	71.050	21/12/2016*	316 0,00
Citibank, N.A.	CLP	53.167.000	USD	79.295	21/12/2016*	1.062 0,00
Citibank, N.A.	CLP	54.817.000	USD	80.614	21/12/2016*	2.238 0,00
Citibank, N.A.	CLP	814.061.200	USD	1.196.713	21/12/2016*	33.668 0,01
Citibank, N.A.	COP	25.942.000	USD	9.010	21/12/2016*	(99) (0,00)
Citibank, N.A.	COP	45.310.000	USD	15.370	21/12/2016*	193 0,00
Citibank, N.A.	COP	69.435.000	USD	23.091	21/12/2016*	758 0,00
Citibank, N.A.	COP	74.554.800	USD	24.746	21/12/2016*	861 0,00
Citibank, N.A.	COP	90.249.200	USD	31.216	21/12/2016*	(218) (0,00)
Citibank, N.A.	COP	91.029.200	USD	30.837	21/12/2016*	429 0,00
Citibank, N.A.	COP	132.653.000	USD	44.100	21/12/2016*	1.462 0,00
Citibank, N.A.	COP	159.159.000	USD	53.861	21/12/2016*	806 0,00
Citibank, N.A.	COP	195.294.800	USD	66.450	21/12/2016*	629 0,00
Citibank, N.A.	COP	225.077.000	USD	75.848	21/12/2016*	1.460 0,00
Citibank, N.A.	COP	227.222.000	USD	77.603	21/12/2016*	441 0,00
Citibank, N.A.	COP	399.489.214	USD	137.277	21/12/2016*	(64) (0,00)
Citibank, N.A.	COP	407.800.502	USD	140.901	21/12/2016*	(833) (0,00)
Citibank, N.A.	COP	517.329.200	USD	172.987	21/12/2016*	4.702 0,00
Citibank, N.A.	COP	639.686.468	USD	213.281	21/12/2016*	6.433 0,00
Citibank, N.A.	COP	694.258.616	USD	235.171	21/12/2016*	3.287 0,00
Citibank, N.A.	EUR	278.400	USD	313.608	21/12/2016	(396) (0,00)
Citibank, N.A.	EUR	824.800	USD	923.169	21/12/2016	4.764 0,00
Citibank, N.A.	EUR	981.200	USD	1.106.886	21/12/2016	(2.996) (0,00)
Citibank, N.A.	EUR	998.000	USD	1.126.394	21/12/2016	(3.604) (0,00)
Citibank, N.A.	EUR	1.051.200	USD	1.186.000	21/12/2016	(3.357) (0,00)
Citibank, N.A.	EUR	1.121.600	USD	1.261.770	21/12/2016	75 0,00
Citibank, N.A.	EUR	1.169.200	USD	1.314.583	21/12/2016	814 0,00
Citibank, N.A.	EUR	1.882.400	USD	2.126.393	21/12/2016	(8.617) (0,00)
Citibank, N.A.	EUR	1.918.000	USD	2.149.165	21/12/2016	8.662 0,00
Citibank, N.A.	EUR	2.483.600	USD	2.794.532	21/12/2016	(382) (0,00)
Citibank, N.A.	EUR	2.715.600	USD	3.063.914	21/12/2016	(8.754) (0,00)
Citibank, N.A.	EUR	3.794.000	USD	4.278.358	21/12/2016	(9.954) (0,00)
Citibank, N.A.	GBP	9.200	USD	12.145	21/12/2016	(178) (0,00)
Citibank, N.A.	HKD	117.000	USD	15.103	21/12/2016	(2) (0,00)
Citibank, N.A.	HKD	144.000	USD	18.590	21/12/2016	(4) (0,00)
Citibank, N.A.	HKD	432.000	USD	55.761	21/12/2016	(5) (0,00)
Citibank, N.A.	HKD	562.000	USD	72.522	21/12/2016	13 0,00
Citibank, N.A.	HKD	1.603.000	USD	206.862	21/12/2016	30 0,00
Citibank, N.A.	HUF	1.372.000	USD	4.950	21/12/2016	17 0,00
Citibank, N.A.	HUF	5.976.400	USD	21.789	21/12/2016	(151) (0,00)
Citibank, N.A.	HUF	8.754.400	USD	31.796	21/12/2016	(99) (0,00)
Citibank, N.A.	HUF	9.546.800	USD	34.617	21/12/2016	(51) (0,00)
Citibank, N.A.	HUF	21.964.000	USD	79.753	21/12/2016	(228) (0,00)
Citibank, N.A.	HUF	22.611.600	USD	82.033	21/12/2016	(163) (0,00)
Citibank, N.A.	HUF	32.526.400	USD	117.172	21/12/2016	596 0,00
Citibank, N.A.	HUF	32.809.200	USD	120.512	21/12/2016	(1.720) (0,00)
Citibank, N.A.	HUF	32.914.000	USD	120.952	21/12/2016	(1.781) (0,00)
Citibank, N.A.	HUF	47.652.000	USD	175.155	21/12/2016	(2.622) (0,00)
Citibank, N.A.	HUF	50.093.600	USD	181.062	21/12/2016	312 0,00
Citibank, N.A.	HUF	50.124.400	USD	181.951	21/12/2016	(466) (0,00)
Citibank, N.A.	HUF	50.226.800	USD	181.484	21/12/2016	372 0,00
Citibank, N.A.	HUF	77.202.822	USD	283.039	21/12/2016	(3.511) (0,00)
Citibank, N.A.	HUF	131.283.898	USD	474.645	21/12/2016	694 0,00
Citibank, N.A.	HUF	132.411.000	USD	484.756	21/12/2016	(5.336) (0,00)
Citibank, N.A.	HUF	157.022.000	USD	573.989	21/12/2016	(5.460) (0,00)
Citibank, N.A.	HUF	165.592.857	USD	597.293	21/12/2016	2.269 0,00
Citibank, N.A.	HUF	182.007.223	USD	658.286	21/12/2016	707 0,00
Citibank, N.A.	IDR	659.669.600	USD	49.488	21/12/2016*	608 0,00
Citibank, N.A.	IDR	847.492.400	USD	62.806	21/12/2016*	1.553 0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust des Nettovermögens
Citibank, N.A.	IDR	1.307.350.800	USD	96.913	21/12/2016*	2.368 0,00
Citibank, N.A.	IDR	1.464.918.800	USD	108.835	21/12/2016*	2.411 0,00
Citibank, N.A.	IDR	1.766.969.600	USD	131.178	21/12/2016*	3.006 0,00
Citibank, N.A.	IDR	4.716.527.394	USD	349.918	21/12/2016*	8.256 0,00
Citibank, N.A.	IDR	5.099.884.915	USD	384.579	21/12/2016*	2.708 0,00
Citibank, N.A.	IDR	7.093.003.691	USD	525.604	21/12/2016*	13.040 0,00
Citibank, N.A.	ILS	44.000	USD	11.749	21/12/2016	(20) (0,00)
Citibank, N.A.	ILS	59.600	USD	15.926	21/12/2016	(39) (0,00)
Citibank, N.A.	ILS	103.000	USD	27.449	21/12/2016	8 0,00
Citibank, N.A.	ILS	117.600	USD	31.418	21/12/2016	(70) (0,00)
Citibank, N.A.	ILS	163.200	USD	43.259	21/12/2016	245 0,00
Citibank, N.A.	ILS	164.000	USD	43.752	21/12/2016	(35) (0,00)
Citibank, N.A.	ILS	180.400	USD	47.857	21/12/2016	232 0,00
Citibank, N.A.	ILS	239.600	USD	63.577	21/12/2016	292 0,00
Citibank, N.A.	ILS	252.000	USD	66.945	21/12/2016	230 0,00
Citibank, N.A.	ILS	262.800	USD	70.274	21/12/2016	(220) (0,00)
Citibank, N.A.	ILS	315.000	USD	83.390	21/12/2016	578 0,00
Citibank, N.A.	ILS	336.400	USD	89.660	21/12/2016	13 0,00
Citibank, N.A.	ILS	618.000	USD	163.475	21/12/2016	1.264 0,00
Citibank, N.A.	ILS	624.800	USD	166.616	21/12/2016	(65) (0,00)
Citibank, N.A.	ILS	688.512	USD	183.164	21/12/2016	370 0,00
Citibank, N.A.	ILS	936.800	USD	248.535	21/12/2016	1.185 0,00
Citibank, N.A.	ILS	952.400	USD	254.223	21/12/2016	(345) (0,00)
Citibank, N.A.	ILS	1.203.092	USD	321.552	21/12/2016	(848) (0,00)
Citibank, N.A.	ILS	2.125.996	USD	567.818	21/12/2016	(1.097) (0,00)
Citibank, N.A.	INR	353.200	USD	5.183	21/12/2016*	60 0,00
Citibank, N.A.	INR	2.835.600	USD	42.165	21/12/2016*	(72) (0,00)
Citibank, N.A.	INR	3.582.400	USD	53.326	21/12/2016*	(147) (0,00)
Citibank, N.A.	INR	3.772.400	USD	56.112	21/12/2016*	(113) (0,00)
Citibank, N.A.	INR	4.913.200	USD	71.994	21/12/2016*	940 0,00
Citibank, N.A.	INR	6.446.400	USD	95.079	21/12/2016*	615 0,00
Citibank, N.A.	INR	6.450.000	USD	95.217	21/12/2016*	530 0,00
Citibank, N.A.	INR	6.473.600	USD	95.327	21/12/2016*	771 0,00
Citibank, N.A.	INR	7.798.400	USD	115.549	21/12/2016*	214 0,00
Citibank, N.A.	INR	7.804.800	USD	115.524	21/12/2016*	334 0,00
Citibank, N.A.	INR	7.818.400	USD	115.359	21/12/2016*	702 0,00
Citibank, N.A.	INR	7.825.600	USD	115.601	21/12/2016*	566 0,00
Citibank, N.A.	INR	7.912.000	USD	117.683	21/12/2016*	(233) (0,00)
Citibank, N.A.	INR	7.957.200	USD	118.073	21/12/2016*	48 0,00
Citibank, N.A.	INR	8.884.800	USD	130.219	21/12/2016*	1.672 0,00
Citibank, N.A.	INR	9.562.000	USD	140.697	21/12/2016*	1.247 0,00
Citibank, N.A.	INR	9.910.400	USD	145.897	21/12/2016*	1.219 0,00
Citibank, N.A.	INR	11.508.000	USD	169.062	21/12/2016*	1.769 0,00
Citibank, N.A.	INR	15.388.820	USD	228.652	21/12/2016*	(212) (0,00)
Citibank, N.A.	INR	19.416.710	USD	284.474	21/12/2016*	3.758 0,00
Citibank, N.A.	INR	21.391.419	USD	314.921	21/12/2016*	2.625 0,00
Citibank, N.A.	INR	23.191.034	USD	342.216	21/12/2016*	2.044 0,00
Citibank, N.A.	INR	31.121.217	USD	456.291	21/12/2016*	5.689 0,00
Citibank, N.A.	JPY	3.330.800	USD	32.873	21/12/2016	134 0,00
Citibank, N.A.	JPY	15.964.000	USD	159.224	21/12/2016	(1.027) (0,00)
Citibank, N.A.	JPY	32.299.600	USD	317.603	21/12/2016	2.473 0,00
Citibank, N.A.	JPY	63.517.600	USD	635.121	21/12/2016	(5.687) (0,00)
Citibank, N.A.	JPY	71.771.200	USD	706.590	21/12/2016	4.634 0,00
Citibank, N.A.	JPY	86.583.600	USD	851.467	21/12/2016	6.543 0,00
Citibank, N.A.	JPY	104.814.800	USD	1.025.920	21/12/2016	12.753 0,00
Citibank, N.A.	JPY	110.328.800	USD	1.077.618	21/12/2016	15.697 0,00
Citibank, N.A.	JPY	143.552.192	USD	1.401.704	21/12/2016	20.841 0,01
Citibank, N.A.	JPY	145.119.707	USD	1.433.286	21/12/2016	4.792 0,00
Citibank, N.A.	JPY	147.220.602	USD	1.473.243	21/12/2016	(14.345) (0,00)
Citibank, N.A.	JPY	277.294.889	USD	2.718.809	21/12/2016	29.074 0,01
Citibank, N.A.	JPY	290.263.232	USD	2.861.819	21/12/2016	14.574 0,00
Citibank, N.A.	JPY	290.814.103	USD	2.860.623	21/12/2016	21.230 0,01
Citibank, N.A.	JPY	293.520.059	USD	2.859.966	21/12/2016	48.701 0,01
Citibank, N.A.	JPY	295.708.734	USD	2.864.709	21/12/2016	65.648 0,02
Citibank, N.A.	JPY	368.193.200	USD	3.699.990	21/12/2016	(41.341) (0,01)
Citibank, N.A.	JPY	438.180.382	USD	4.256.591	21/12/2016	85.603 0,02
Citibank, N.A.	JPY	453.308.713	USD	4.473.576	21/12/2016	18.534 0,01
Citibank, N.A.	JPY	533.302.000	USD	5.240.982	21/12/2016	43.829 0,01
Citibank, N.A.	JPY	545.132.988	USD	5.385.528	21/12/2016	16.524 0,00
Citibank, N.A.	KRW	554.739.200	USD	5.543.920	21/12/2016	(46.675) (0,01)
Citibank, N.A.	KRW	39.570.400	USD	35.611	21/12/2016*	301 0,00
Citibank, N.A.	KRW	59.419.600	USD	53.032	21/12/2016*	894 0,00
Citibank, N.A.	KRW	121.708.400	USD	110.941	21/12/2016*	(486) (0,00)
Citibank, N.A.	KRW	129.783.200	USD	115.449	21/12/2016	2.335 0,00
Citibank, N.A.	KRW	139.725.200	USD	127.267	21/12/2016*	(461) (0,00)
Citibank, N.A.	KRW	188.871.200	USD	171.276	21/12/2016*	132 0,00
Citibank, N.A.	KRW	306.364.000	USD	274.903	21/12/2016*	3.134 0,00
Citibank, N.A.	KRW	317.283.200	USD	283.379	21/12/2016*	4.568 0,00
Citibank, N.A.	KRW	391.061.200	USD	353.197	21/12/2016*	1.706 0,00
Citibank, N.A.	KRW	391.141.200	USD	353.913	21/12/2016*	1.063 0,00
Citibank, N.A.	KRW	391.718.000	USD	354.899	21/12/2016*	600 0,00
Citibank, N.A.	KRW	395.424.800	USD	354.165	21/12/2016*	4.698 0,00
Citibank, N.A.	KRW	396.168.000	USD	353.866	21/12/2016*	5.672 0,00
Citibank, N.A.	KRW	596.974.000	USD	542.265	21/12/2016*	(487) (0,00)
Citibank, N.A.	KRW	747.735.457	USD	682.760	21/12/2016*	(4.161) (0,00)
Citibank, N.A.	KRW	790.566.400	USD	723.168	21/12/2016*	(5.698) (0,00)
Citibank, N.A.	KRW	814.644.118	USD	724.885	21/12/2016*	14.437 0,00
Citibank, N.A.	KRW	1.048.597.432	USD	944.039	21/12/2016*	7.595 0,00
Citibank, N.A.	KRW	1.077.949.228	USD	984.657	21/12/2016*	(6.376) (0,00)
Citibank, N.A.	KRW	1.402.002.565	USD	1.252.240	21/12/2016*	20.132 0,01
Citibank, N.A.	MXN	769.592	USD	40.508	21/12/2016	(1.214) (0,00)
Citibank, N.A.	MXN	779.208	USD	40.868	21/12/2016	(1.083) (0,00)
Citibank, N.A.	MXN	6.989.200	USD	377.184	21/12/2016	(20.330) (0,01)
Citibank, N.A.	MYR	124.000	USD	30.024	21/12/2016*	(156) (0,00)
Citibank, N.A.	MYR	234.400	USD	57.827	21/12/2016*	(1.365) (0,00)
Citibank, N.A.	MYR	1.232.000	USD	307.386	21/12/2016*	(10.625) (0,00)
Citibank, N.A.	MYR	1.968.000	USD	488.339	21/12/2016*	(14.293) (0,00)
Citibank, N.A.	MYR	4.804.400	USD	1.184.638	21/12/2016*	(27.367) (0,01)
Citibank, N.A.	NOK	456.000	USD	55.322	21/12/2016	1.713 0,00
Citibank, N.A.	NOK	1.812.400	USD	218.069	21/12/2016	8.620 0,00
Citibank, N.A.	NOK	2.082.927	USD	254.019	21/12/2016	6.508 0,00
Citibank, N.A.	NOK	2.194.806	USD	269.374	21/12/2016	5.146 0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust des Nettovermögens
Citibank, N.A.	NOK	2.709.200	USD	326.866	21/12/2016	11.993 0,00
Citibank, N.A.	NOK	2.837.851	USD	339.831	21/12/2016	15.119 0,00
Citibank, N.A.	NOK	2.846.800	USD	342.809	21/12/2016	13.260 0,00
Citibank, N.A.	NOK	3.896.416	USD	473.933	21/12/2016	13.420 0,00
Citibank, N.A.	NOK	3.956.400	USD	489.198	21/12/2016	5.657 0,00
Citibank, N.A.	NOK	3.965.600	USD	477.345	21/12/2016	18.661 0,01
Citibank, N.A.	NOK	3.989.200	USD	490.173	21/12/2016	8.784 0,00
Citibank, N.A.	NOK	4.142.400	USD	504.631	21/12/2016	13.488 0,00
Citibank, N.A.	NOK	4.578.400	USD	565.434	21/12/2016	7.219 0,00
Citibank, N.A.	NOK	4.656.400	USD	579.845	21/12/2016	2.564 0,00
Citibank, N.A.	NOK	4.748.800	USD	586.205	21/12/2016	7.761 0,00
Citibank, N.A.	NOK	4.760.000	USD	585.182	21/12/2016	10.185 0,00
Citibank, N.A.	NOK	5.101.600	USD	620.763	21/12/2016	17.331 0,00
Citibank, N.A.	NOK	6.348.400	USD	776.993	21/12/2016	17.046 0,00
Citibank, N.A.	NOK	6.367.200	USD	770.685	21/12/2016	25.706 0,01
Citibank, N.A.	NZD	104.800	USD	77.693	21/12/2016	(1.627) (0,00)
Citibank, N.A.	NZD	230.800	USD	166.458	21/12/2016	1.060 0,00
Citibank, N.A.	NZD	420.800	USD	308.284	21/12/2016	(2.861) (0,00)
Citibank, N.A.	NZD	702.400	USD	508.132	21/12/2016	1.681 0,00
Citibank, N.A.	NZD	786.400	USD	573.105	21/12/2016	(2.324) (0,00)
Citibank, N.A.	NZD	966.800	USD	700.962	21/12/2016	757 0,00
Citibank, N.A.	NZD	1.061.200	USD	768.272	21/12/2016	1.963 0,00
Citibank, N.A.	NZD	1.316.000	USD	953.321	21/12/2016	1.853 0,00
Citibank, N.A.	NZD	1.425.600	USD	1.040.100	21/12/2016	(5.377) (0,00)
Citibank, N.A.	NZD	1.425.600	USD	1.039.425	21/12/2016	(4.701) (0,00)
Citibank, N.A.	NZD	1.425.600	USD	1.032.623	21/12/2016	2.100 0,00
Citibank, N.A.	NZD	2.213.614	USD	1.591.849	21/12/2016	14.827 0,00
Citibank, N.A.	NZD	2.213.722	USD	1.609.935	21/12/2016	(3.181) (0,00)
Citibank, N.A.	NZD	2.648.221	USD	1.955.407	21/12/2016	(33.286) (0,01)
Citibank, N.A.	NZD	3.135.600	USD	2.294.045	21/12/2016	(18.177) (0,00)
Citibank, N.A.	NZD	4.258.150	USD	3.073.672	21/12/2016	16.961 0,00
Citibank, N.A.	NZD	5.450.000	USD	3.958.301	21/12/2016	(2.604) (0,00)
Citibank, N.A.	NZD	5.596.089	USD	4.040.184	21/12/2016	21.547 0,01
Citibank, N.A.	NZD	5.692.928	USD	4.231.780	21/12/2016	(99.762) (0,03)
Citibank, N.A.	NZD	6.480.876	USD	4.767.793	21/12/2016	(63.870) (0,02)
Citibank, N.A.	PHP	6.088.800	USD	131.027	21/12/2016*	(6.226) (0,00)
Citibank, N.A.	PHP	7.911.600	USD	169.233	21/12/2016*	(7.070) (0,00)
Citibank, N.A.	PHP	30.645.883	USD	655.389	21/12/2016*	(27.245) (0,01)
Citibank, N.A.	PLN	31.604.517	USD	678.502	21/12/2016*	(30.710) (0,01)
Citibank, N.A.	PLN	192.000	USD	49.568	21/12/2016	367 0,00
Citibank, N.A.	PLN	434.000	USD	112.633	21/12/2016	241 0,00
Citibank, N.A.	PLN	745.455	USD	189.797	21/12/2016	4.078 0,00
Citibank, N.A.	PLN	928.800	USD	242.270	21/12/2016	(711) (0,00)
Citibank, N.A.	PLN	930.800	USD	243.774	21/12/2016	(1.695) (0,00)
Citibank, N.A.	PLN	934.400	USD	243.790	21/12/2016	(774) (0,00)
Citibank, N.A.	PLN	972.800	USD	253.117	21/12/2016	(114) (0,00)
Citibank, N.A.	PLN	976.000	USD	254.078	21/12/2016	(243) (0,00)
Citibank, N.A.	PLN	1.020.400	USD	265.987	21/12/2016	(605) (0,00)
Citibank, N.A.	PLN	1.054.400	USD	276.890	21/12/2016	(2.665) (0,00)
Citibank, N.A.	PLN	1.056.400	USD	273.068	21/12/2016	1.677 0,00
Citibank, N.A.	PLN	1.057.200	USD	273.837	21/12/2016	1.116 0,00
Citibank, N.A.	PLN	1.058.000	USD	273.704	21/12/2016	1.457 0,00
Citibank, N.A.	PLN	1.062.000	USD	275.856	21/12/2016	346 0,00
Citibank, N.A.	PLN	1.286.057	USD	330.056	21/12/2016	4.418 0,00
Citibank, N.A.	PLN	1.337.488	USD	347.807	21/12/2016	42 0,00
Citibank, N.A.	PLN	1.544.150	USD	397.420	21/12/2016	4.178 0,00
Citibank, N.A.	PLN	1.819.375	USD	467.203	21/12/2016	5.974 0,00
Citibank, N.A.	PLN	2.574.664	USD	667.541	21/12/2016	2.069 0,00
Citibank, N.A.	PLN	5.367.000	USD	1.395.379	21/12/2016	453 0,00
Citibank, N.A.	PLN	5.508.011	USD	1.437.043	21/12/2016	(4.537) (0,00)
Citibank, N.A.	SGD	84.089	USD	61.491	21/12/2016	208 0,00
Citibank, N.A.	SGD	85.054	USD	62.899	21/12/2016	(492) (0,00)
Citibank, N.A.	SGD	94.000	USD	69.217	21/12/2016	(245) (0,00)
Citibank, N.A.	SGD	94.000	USD	69.455	21/12/2016	(484) (0,00)
Citibank, N.A.	SGD	116.661	USD	85.923	21/12/2016	(324) (0,00)
Citibank, N.A.	SGD	167.240	USD	124.245	21/12/2016	(1.535) (0,00)
Citibank, N.A.	SGD	168.377	USD	123.641	21/12/2016	(96) (0,00)
Citibank, N.A.	SGD	197.000	USD	144.644	21/12/2016	(97) (0,00)
Citibank, N.A.	SGD	301.000	USD	223.748	21/12/2016	(2.892) (0,00)
Citibank, N.A.	SGD	309.289	USD	226.722	21/12/2016	215 0,00
Citibank, N.A.	SGD	309.290	USD	227.094	21/12/2016	(156) (0,00)
Citibank, N.A.	TRY	34.800	USD	11.484	21/12/2016	(70) (0,00)
Citibank, N.A.	TRY	209.200	USD	69.817	21/12/2016	(1.202) (0,00)
Citibank, N.A.	TRY	312.000	USD	103.966	21/12/2016	(1.634) (0,00)
Citibank, N.A.	TRY	404.000	USD	133.363	21/12/2016	(857) (0,00)
Citibank, N.A.	TRY	800.904	USD	264.404	21/12/2016	(1.719) (0,00)
Citibank, N.A.	TRY	1.668.548	USD	551.297	21/12/2016	(4.036) (0,00)
Citibank, N.A.	TRY	1.895.200	USD	631.259	21/12/2016	(9.660) (0,00)
Citibank, N.A.	TRY	4.713.290	USD	1.568.180	21/12/2016	(22.286) (0,01)
Citibank, N.A.	TRY	5.366.299	USD	1.791.743	21/12/2016	(31.671) (0,01)
Citibank, N.A.	TRY	6.824.254	USD	2.271.712	21/12/2016	(33.450) (0,01)
Citibank, N.A.	TRY	7.719.600	USD	2.560.641	21/12/2016	(28.719) (0,01)
Citibank, N.A.	TRY	8.925.505	USD	2.952.146	21/12/2016	(24.704) (0,01)
Citibank, N.A.	TWD	550.400	USD	17.635	21/12/2016*	12 0,00
Citibank, N.A.	TWD	1.481.600	USD	47.536	21/12/2016*	(31) (0,00)
Citibank, N.A.	TWD	2.900.800	USD	93.611	21/12/2016*	(602) (0,00)
Citibank, N.A.	TWD	2.952.000	USD	94.657	21/12/2016*	(6) (0,00)
Citibank, N.A.	TWD	2.953.200	USD	94.341	21/12/2016*	348 0,00
Citibank, N.A.	TWD	3.045.200	USD	97.454	21/12/2016*	185 0,00
Citibank, N.A.	TWD	3.830.000	USD	122.969	21/12/2016*	(167) (0,00)
Citibank, N.A.	TWD	3.833.600	USD	123.235	21/12/2016*	(318) (0,00)
Citibank, N.A.	TWD	4.172.000	USD	132.235	21/12/2016*	1.532 0,00
Citibank, N.A.	TWD	4.315.600	USD	138.734	21/12/2016*	(362) (0,00)
Citibank, N.A.	TWD	9.015.000	USD	285.738	21/12/2016*	3.311 0,00
Citibank, N.A.	TWD	21.755.200	USD	690.951	21/12/2016*	6.589 0,00
Citibank, N.A.	USD	121.571	AUD	161.600	21/12/2016	(1.950) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	213.670	AUD	285.200	21/12/2016	(4.326) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	219.863	AUD	288.000	21/12/2016	(273) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	303.505	AUD	402.400	21/12/2016	(4.074) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	549.216	AUD	729.223	21/12/2016	(8.173) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	550.307	AUD	729.222	21/12/2016	(7.081) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	611.449	AUD	812.160	21/12/2016	(9.334) (0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust des Nettovermögens
Citibank, N.A.	USD	711.549	AUD	938.000	21/12/2016	(5.421) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	786.543	AUD	1.046.595	21/12/2016	(13.432) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	786.865	AUD	1.051.200	21/12/2016	(16.630) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	787.161	AUD	1.054.000	21/12/2016	(18.474) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.481.949	AUD	1.988.800	21/12/2016	(38.210) (0,01)
Citibank, N.A.	USD	1.481.998	AUD	1.988.800	21/12/2016	(38.161) (0,01)
Citibank, N.A.	USD	13.172	BRL	44.000	21/12/2016*	(57) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.051.672	CAD	1.390.000	21/12/2016	(9.230) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.053.872	CAD	1.390.400	21/12/2016	(7.335) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.391.312	CAD	1.838.800	21/12/2016	(12.131) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.394.871	CAD	1.840.400	21/12/2016	(9.794) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.423.018	CAD	1.866.800	21/12/2016	(1.796) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.522.051	CAD	2.007.600	21/12/2016	(10.228) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.524.670	CAD	2.011.200	21/12/2016	(10.356) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.536.156	CAD	2.031.600	21/12/2016	(14.440) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.561.771	CAD	2.068.000	21/12/2016	(8.975) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.570.653	CAD	2.061.600	21/12/2016	(2.840) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.581.967	CAD	2.058.400	21/12/2016	10.916 (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.624.326	CAD	2.150.400	21/12/2016	(16.943) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	3.905.550	CAD	5.144.800	21/12/2016	(21.161) (0,01)
Citibank, N.A.	USD	4.653.781	CAD	6.088.400	21/12/2016	6.878 0,00
Citibank, N.A.	USD	3.029	CLP	2.050.800	21/12/2016*	(71) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	5.469	CLP	3.678.800	21/12/2016*	(91) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	6.036	CLP	4.085.200	21/12/2016*	(138) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	7.124	CLP	4.718.000	21/12/2016*	(7) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	7.516	CLP	5.031.000	21/12/2016*	(88) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	14.164	CLP	9.643.600	21/12/2016*	(411) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	37.431	CLP	25.616.000	21/12/2016*	(1.285) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	3.334	COP	9.882.400	21/12/2016*	(60) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	5.328	COP	15.908.800	21/12/2016*	(136) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	10.187	COP	30.215.000	21/12/2016*	(191) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	81.639	COP	248.712.000	21/12/2016*	(3.787) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	81.301	EUR	72.000	21/12/2016	298 0,00
Citibank, N.A.	USD	486.538	EUR	434.400	21/12/2016	(2.180) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	741.856	EUR	662.800	21/12/2016	(3.821) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.063.011	EUR	947.200	21/12/2016	(2.627) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	2.056.740	EUR	1.837.186	21/12/2016	(10.168) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	2.218.564	EUR	1.890.250	21/12/2016	11.956 0,00
Citibank, N.A.	USD	2.267.659	EUR	2.004.800	21/12/2016	2.178 0,00
Citibank, N.A.	USD	2.312.124	EUR	2.067.200	21/12/2016	(13.560) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	2.316.808	EUR	2.067.200	21/12/2016	(8.876) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	2.333.922	EUR	2.067.000	21/12/2016	6.238 0,00
Citibank, N.A.	USD	2.408.583	EUR	2.144.400	21/12/2016	(3.954) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	2.714.170	EUR	2.420.911	21/12/2016	(9.453) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	3.291.109	EUR	2.904.400	21/12/2016	23.541 0,01
Citibank, N.A.	USD	4.175.012	EUR	3.724.478	21/12/2016	(15.176) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	4.435.888	EUR	3.915.600	21/12/2016	30.680 0,01
Citibank, N.A.	USD	5.131.761	EUR	4.536.601	21/12/2016	27.901 0,01
Citibank, N.A.	USD	6.652.520	EUR	5.887.774	21/12/2016	28.536 0,01
Citibank, N.A.	USD	248.401	GBP	189.200	21/12/2016	2.305 0,00
Citibank, N.A.	USD	262.287	GBP	198.400	21/12/2016	4.224 0,00
Citibank, N.A.	USD	321.634	GBP	245.600	21/12/2016	2.178 0,00
Citibank, N.A.	USD	383.741	GBP	288.000	21/12/2016	9.134 0,00
Citibank, N.A.	USD	452.479	GBP	342.400	21/12/2016	7.113 0,00
Citibank, N.A.	USD	564.260	GBP	428.800	21/12/2016	6.512 0,00
Citibank, N.A.	USD	579.388	GBP	446.000	21/12/2016	(733) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	581.811	GBP	447.600	21/12/2016	(391) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	667.349	GBP	514.400	21/12/2016	(1.740) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	668.365	GBP	514.800	21/12/2016	(1.245) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	674.216	GBP	507.200	21/12/2016	14.492 0,00
Citibank, N.A.	USD	675.117	GBP	518.800	21/12/2016	304 0,00
Citibank, N.A.	USD	675.428	GBP	518.800	21/12/2016	616 0,00
Citibank, N.A.	USD	701.650	GBP	526.000	21/12/2016	17.472 0,01
Citibank, N.A.	USD	782.435	GBP	583.600	21/12/2016	23.336 0,01
Citibank, N.A.	USD	790.035	GBP	607.600	21/12/2016	(281) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	797.815	GBP	607.200	21/12/2016	7.819 0,00
Citibank, N.A.	USD	1.121.116	GBP	854.400	21/12/2016	9.783 0,00
Citibank, N.A.	USD	1.502.810	GBP	1.136.000	21/12/2016	25.194 0,01
Citibank, N.A.	USD	1.637.752	GBP	1.226.000	21/12/2016	43.071 0,01
Citibank, N.A.	USD	1.719.250	GBP	1.300.000	21/12/2016	28.316 0,01
Citibank, N.A.	USD	7.242.288	GBP	5.512.400	21/12/2016	72.208 0,02
Citibank, N.A.	USD	330.756	HKD	2.564.000	21/12/2016	(168) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	28.375	HUF	7.810.400	21/12/2016	96 0,00
Citibank, N.A.	USD	40.101	HUF	11.135.600	21/12/2016	(218) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	40.244	HUF	11.194.800	21/12/2016	(289) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	40.400	HUF	11.181.600	21/12/2016	(85) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	57.982	HUF	15.908.000	21/12/2016	384 0,00
Citibank, N.A.	USD	81.143	HUF	22.271.000	21/12/2016	506 0,00
Citibank, N.A.	USD	8.498	IDR	112.406.800	21/12/2016*	(38) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	12.145	IDR	160.802.800	21/12/2016*	(66) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	18.641	IDR	248.026.000	21/12/2016*	(194) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	22.098	IDR	294.341.000	21/12/2016*	(255) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	27.431	IDR	370.467.600	21/12/2016*	(702) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	30.872	IDR	412.291.200	21/12/2016*	(438) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	59.436	IDR	798.223.200	21/12/2016*	(1.182) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	8.991	ILS	34.000	21/12/2016	(72) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	11.375	ILS	42.800	21/12/2016	(34) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	22.371	ILS	84.000	21/12/2016	(21) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	34.904	ILS	131.000	21/12/2016	(16) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	62.036	ILS	234.000	21/12/2016	(341) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	65.881	ILS	248.000	21/12/2016	(227) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	251.968	JPY	25.273.000	21/12/2016	1.523 0,00
Citibank, N.A.	USD	724.714	JPY	72.942.400	21/12/2016	1.884 0,00
Citibank, N.A.	USD	730.726	JPY	73.065.600	21/12/2016	6.675 0,00
Citibank, N.A.	USD	916.594	JPY	94.356.400	21/12/2016	(18.440) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.144.743	JPY	117.151.200	21/12/2016	(16.178) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.214.197	JPY	123.048.400	21/12/2016	(5.164) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.408.209	JPY	146.062.800	21/12/2016	(39.215) (0,01)
Citibank, N.A.	USD	1.507.668	JPY	155.414.000	21/12/2016	(32.423) (0,01)
Citibank, N.A.	USD	1.658.941	JPY	168.159.200	21/12/2016	(7.450) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	41.027	KRW	45.898.000	21/12/2016*	(627) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	21.545	MXN	422.800	21/12/2016	(42) (0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust des Nettovermögens
Citibank, N.A.	USD	52.645	MXN	1.028.800	21/12/2016	116 0,00
Citibank, N.A.	USD	65.830	MXN	1.310.000	21/12/2016	(1.056) 0,00
Citibank, N.A.	USD	65.926	MXN	1.321.600	21/12/2016	(1.552) 0,00
Citibank, N.A.	USD	90.252	MXN	1.664.000	21/12/2016	5.292 0,00
Citibank, N.A.	USD	100.393	MXN	1.977.200	21/12/2016	(559) 0,00
Citibank, N.A.	USD	112.657	MXN	2.100.400	21/12/2016	5.415 0,00
Citibank, N.A.	USD	178.654	MXN	3.532.000	21/12/2016	(1.683) 0,00
Citibank, N.A.	USD	213.937	MXN	4.064.800	21/12/2016	6.396 0,00
Citibank, N.A.	USD	276.126	MXN	5.180.000	21/12/2016	11.645 0,00
Citibank, N.A.	USD	345.290	MXN	6.907.200	21/12/2016	(7.378) 0,00
Citibank, N.A.	USD	363.932	MXN	7.222.000	21/12/2016	(4.809) 0,00
Citibank, N.A.	USD	365.346	MXN	7.236.800	21/12/2016	(4.151) 0,00
Citibank, N.A.	USD	401.147	MXN	7.755.200	21/12/2016	5.182 0,00
Citibank, N.A.	USD	418.049	MXN	8.098.400	21/12/2016	4.561 0,00
Citibank, N.A.	USD	442.767	MXN	8.429.200	21/12/2016	12.388 0,00
Citibank, N.A.	USD	444.762	MXN	8.481.200	21/12/2016	11.729 0,00
Citibank, N.A.	USD	457.906	MXN	8.891.200	21/12/2016	3.939 0,00
Citibank, N.A.	USD	1.190.497	MXN	22.942.400	21/12/2016	19.104 0,01
Citibank, N.A.	USD	15.592	MYR	63.600	21/12/2016*	272 0,00
Citibank, N.A.	USD	27.130	MYR	112.400	21/12/2016*	55 0,00
Citibank, N.A.	USD	32.651	MYR	135.600	21/12/2016*	(12) 0,00
Citibank, N.A.	USD	39.471	MYR	162.800	21/12/2016*	256 0,00
Citibank, N.A.	USD	40.535	MYR	168.000	21/12/2016*	68 0,00
Citibank, N.A.	USD	41.374	MYR	171.600	21/12/2016*	40 0,00
Citibank, N.A.	USD	41.605	MYR	171.600	21/12/2016*	270 0,00
Citibank, N.A.	USD	41.735	MYR	173.200	21/12/2016*	15 0,00
Citibank, N.A.	USD	52.132	MYR	216.400	21/12/2016*	6 0,00
Citibank, N.A.	USD	55.861	MYR	231.600	21/12/2016*	74 0,00
Citibank, N.A.	USD	56.596	MYR	234.400	21/12/2016*	135 0,00
Citibank, N.A.	USD	109.474	MYR	446.000	21/12/2016*	2.043 0,00
Citibank, N.A.	USD	575.897	MYR	2.373.600	21/12/2016*	4.150 0,00
Citibank, N.A.	USD	8.893	NOK	73.600	21/12/2016	(313) 0,00
Citibank, N.A.	USD	306.037	NOK	2.549.200	21/12/2016	(12.809) 0,00
Citibank, N.A.	USD	366.966	NOK	3.052.800	21/12/2016	(14.870) 0,00
Citibank, N.A.	USD	378.538	NOK	3.149.200	21/12/2016	(15.355) 0,00
Citibank, N.A.	USD	463.251	NOK	3.822.000	21/12/2016	(14.793) 0,00
Citibank, N.A.	USD	748.466	NZD	1.026.000	21/12/2016	3.779 0,00
Citibank, N.A.	USD	1.587.649	NZD	2.197.200	21/12/2016	(7.114) 0,00
Citibank, N.A.	USD	1.889.127	NZD	2.608.400	21/12/2016	(4.092) 0,00
Citibank, N.A.	USD	2.513.743	NZD	3.455.600	21/12/2016	5.613 0,00
Citibank, N.A.	USD	2.515.614	NZD	3.482.000	21/12/2016	(11.677) 0,00
Citibank, N.A.	USD	3.248.797	NZD	4.488.000	21/12/2016	(8.665) 0,00
Citibank, N.A.	USD	37.160	PHP	1.805.600	21/12/2016*	151 0,00
Citibank, N.A.	USD	37.276	PHP	1.812.000	21/12/2016*	136 0,00
Citibank, N.A.	USD	45.774	PHP	2.232.400	21/12/2016*	17 0,00
Citibank, N.A.	USD	46.002	PHP	2.212.000	21/12/2016*	663 0,00
Citibank, N.A.	USD	46.051	PHP	2.217.600	21/12/2016*	598 0,00
Citibank, N.A.	USD	46.075	PHP	2.244.800	21/12/2016*	64 0,00
Citibank, N.A.	USD	53.606	PHP	2.516.000	21/12/2016*	2.036 0,00
Citibank, N.A.	USD	79.537	PHP	3.716.800	21/12/2016*	3.355 0,00
Citibank, N.A.	USD	105.049	PHP	5.054.800	21/12/2016*	1.441 0,00
Citibank, N.A.	USD	170.193	PHP	8.238.800	21/12/2016*	1.324 0,00
Citibank, N.A.	USD	170.572	PHP	8.239.600	21/12/2016*	1.686 0,00
Citibank, N.A.	USD	223.161	PHP	10.740.400	21/12/2016*	3.016 0,00
Citibank, N.A.	USD	223.486	PHP	10.765.600	21/12/2016*	2.825 0,00
Citibank, N.A.	USD	224.350	PHP	10.818.800	21/12/2016*	2.599 0,00
Citibank, N.A.	USD	226.766	PHP	10.869.200	21/12/2016*	3.982 0,00
Citibank, N.A.	USD	234.387	PHP	11.096.000	21/12/2016*	6.954 0,00
Citibank, N.A.	USD	83.616	PLN	321.600	21/12/2016	(25) 0,00
Citibank, N.A.	USD	242.774	PLN	940.400	21/12/2016	(1.802) 0,00
Citibank, N.A.	USD	470.150	PLN	1.825.200	21/12/2016	(4.542) 0,00
Citibank, N.A.	USD	612.090	PLN	2.397.200	21/12/2016	(11.366) 0,00
Citibank, N.A.	USD	640.780	PLN	2.516.800	21/12/2016	(13.782) 0,00
Citibank, N.A.	USD	642.093	PLN	2.515.600	21/12/2016	(12.157) 0,00
Citibank, N.A.	USD	975.153	PLN	3.820.400	21/12/2016	(18.445) 0,00
Citibank, N.A.	USD	38.730	SEK	330.000	21/12/2016	171 0,00
Citibank, N.A.	USD	83.587	SEK	699.200	21/12/2016	1.888 0,00
Citibank, N.A.	USD	173.105	SEK	1.465.200	21/12/2016	1.902 0,00
Citibank, N.A.	USD	229.731	SEK	1.969.600	21/12/2016	(408) 0,00
Citibank, N.A.	USD	231.995	SEK	1.975.200	21/12/2016	1.202 0,00
Citibank, N.A.	USD	232.196	SEK	1.970.400	21/12/2016	1.963 0,00
Citibank, N.A.	USD	278.561	SEK	2.388.000	21/12/2016	(467) 0,00
Citibank, N.A.	USD	339.386	SEK	2.848.400	21/12/2016	6.562 0,00
Citibank, N.A.	USD	417.602	SEK	3.579.600	21/12/2016	(660) 0,00
Citibank, N.A.	USD	420.798	SEK	3.571.600	21/12/2016	3.472 0,00
Citibank, N.A.	USD	430.374	SEK	3.641.189	21/12/2016	4.916 0,00
Citibank, N.A.	USD	457.808	SEK	3.895.600	21/12/2016	2.623 0,00
Citibank, N.A.	USD	460.236	SEK	3.930.800	21/12/2016	939 0,00
Citibank, N.A.	USD	460.730	SEK	3.898.800	21/12/2016	5.171 0,00
Citibank, N.A.	USD	462.183	SEK	3.936.800	21/12/2016	2.185 0,00
Citibank, N.A.	USD	463.605	SEK	3.921.600	21/12/2016	5.382 0,00
Citibank, N.A.	USD	507.098	SEK	4.261.285	21/12/2016	9.185 0,00
Citibank, N.A.	USD	519.076	SEK	4.420.000	21/12/2016	2.618 0,00
Citibank, N.A.	USD	733.088	SEK	6.204.000	21/12/2016	8.177 0,00
Citibank, N.A.	USD	743.311	SEK	6.362.800	21/12/2016	(156) 0,00
Citibank, N.A.	USD	905.429	SEK	7.722.433	21/12/2016	3.095 0,00
Citibank, N.A.	USD	925.673	SEK	7.872.000	21/12/2016	5.863 0,00
Citibank, N.A.	USD	1.174.334	SEK	9.926.800	21/12/2016	14.430 0,00
Citibank, N.A.	USD	1.858.667	SEK	15.563.413	21/12/2016	40.148 0,01
Citibank, N.A.	USD	2.141.555	SEK	17.988.880	21/12/2016	39.630 0,01
Citibank, N.A.	USD	10.884	SGD	14.800	21/12/2016	25 0,00
Citibank, N.A.	USD	18.361	SGD	25.000	21/12/2016	17 0,00
Citibank, N.A.	USD	20.604	SGD	28.000	21/12/2016	59 0,00
Citibank, N.A.	USD	23.270	SGD	31.600	21/12/2016	84 0,00
Citibank, N.A.	USD	29.002	SGD	39.200	21/12/2016	239 0,00
Citibank, N.A.	USD	30.319	SGD	41.200	21/12/2016	89 0,00
Citibank, N.A.	USD	69.793	SGD	95.200	21/12/2016	(59) 0,00
Citibank, N.A.	USD	112.348	SGD	153.200	21/12/2016	(61) 0,00
Citibank, N.A.	USD	125.683	SGD	171.200	21/12/2016	67 0,00
Citibank, N.A.	USD	126.423	SGD	172.400	21/12/2016	(74) 0,00
Citibank, N.A.	USD	131.437	SGD	179.600	21/12/2016	(343) 0,00
Citibank, N.A.	USD	182.642	SGD	249.600	21/12/2016	(499) 0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust des Nettovermögens
Citibank, N.A.	USD	296.652	SGD	404.000	21/12/2016	221 0,00
Citibank, N.A.	USD	600.670	SGD	814.800	21/12/2016	2.818 0,00
Citibank, N.A.	USD	68.448	TRY	207.600	21/12/2016	358 0,00
Citibank, N.A.	USD	96.217	TRY	291.200	21/12/2016	708 0,00
Citibank, N.A.	USD	125.370	TRY	380.800	21/12/2016	473 0,00
Citibank, N.A.	USD	149.168	TRY	446.400	21/12/2016	2.755 0,00
Citibank, N.A.	USD	239.741	TRY	727.000	21/12/2016	1.295 0,00
Citibank, N.A.	USD	240.736	TRY	729.000	21/12/2016	1.634 0,00
Citibank, N.A.	USD	274.365	TRY	832.400	21/12/2016	1.350 0,00
Citibank, N.A.	USD	573.228	TRY	1.745.200	21/12/2016	827 0,00
Citibank, N.A.	USD	575.297	TRY	1.741.200	21/12/2016	4.207 0,00
Citibank, N.A.	USD	753.044	TRY	2.280.000	21/12/2016	5.236 0,00
Citibank, N.A.	USD	34.892	TWD	1.104.000	21/12/2016*	(505) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	70.837	TWD	2.242.000	21/12/2016*	(1.048) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	155.991	ZAR	2.308.400	21/12/2016	(8.716) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	175.932	ZAR	2.647.200	21/12/2016	(12.948) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	184.975	ZAR	2.772.000	21/12/2016	(12.810) (0,00)
Citibank, N.A.	USD	570.195	ZAR	8.438.800	21/12/2016	(31.921) (0,01)
Citibank, N.A.	ZAR	200.000	USD	13.599	21/12/2016	672 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	893.600	USD	62.669	21/12/2016	1.090 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	917.200	USD	62.488	21/12/2016	2.955 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	1.684.400	USD	115.138	21/12/2016	5.046 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	1.709.173	USD	119.934	21/12/2016	2.017 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	1.719.200	USD	119.020	21/12/2016	3.647 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	1.914.800	USD	137.717	21/12/2016	(1.094) (0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	1.937.600	USD	137.781	21/12/2016	469 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	2.213.200	USD	152.103	21/12/2016	5.811 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	2.222.800	USD	155.808	21/12/2016	2.791 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	2.324.020	USD	163.563	21/12/2016	2.258 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	2.481.836	USD	171.120	21/12/2016	5.961 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	2.530.800	USD	179.476	21/12/2016	1.099 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	3.386.400	USD	246.712	21/12/2016	(5.089) (0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	3.396.000	USD	244.391	21/12/2016	(2.084) (0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	3.404.000	USD	245.555	21/12/2016	(2.677) (0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	3.414.000	USD	247.991	21/12/2016	(4.399) (0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	3.454.800	USD	247.434	21/12/2016	(931) (0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	3.926.993	USD	265.816	21/12/2016	14.378 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	5.697.988	USD	392.092	21/12/2016	14.464 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	7.882.000	USD	547.542	21/12/2016	14.846 0,00
Citibank, N.A.	ZAR	11.339.200	USD	784.044	21/12/2016	25.018 0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	190.200	USD	143.143	21/12/2016	2.239 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	233.400	USD	176.200	21/12/2016	2.202 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	777.600	USD	594.902	21/12/2016	(536) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	1.020.000	USD	768.675	21/12/2016	10.972 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	1.716.000	USD	1.292.891	21/12/2016	18.751 0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	2.524.800	USD	1.927.311	21/12/2016	2.545 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	3.778.800	USD	2.890.604	21/12/2016	(2.240) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	3.778.800	USD	2.887.018	21/12/2016	1.346 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	3.948.600	USD	3.024.994	21/12/2016	(6.842) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	4.242.600	USD	3.227.633	21/12/2016	15.240 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	4.794.600	USD	3.657.833	21/12/2016	6.967 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	9.000	USD	2.684	21/12/2016*	22 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	28.200	USD	8.247	21/12/2016*	231 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	29.400	USD	8.958	21/12/2016*	(119) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	35.400	USD	10.535	21/12/2016*	109 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	35.400	USD	10.711	21/12/2016*	(68) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	36.600	USD	11.091	21/12/2016*	(87) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	57.000	USD	16.849	21/12/2016*	289 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	57.600	USD	16.786	21/12/2016*	532 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	60.000	USD	18.116	21/12/2016*	(76) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	60.600	USD	18.272	21/12/2016*	(52) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	60.600	USD	18.249	21/12/2016*	(29) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	60.600	USD	18.294	21/12/2016*	(74) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	61.200	USD	18.333	21/12/2016*	67 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	531.000	USD	158.688	21/12/2016*	982 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	588.600	USD	175.196	21/12/2016*	1.772 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	699.600	USD	207.956	21/12/2016*	2.385 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	810.000	USD	244.196	21/12/2016*	(662) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	1.054.936	USD	309.662	21/12/2016*	7.514 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	1.225.232	USD	360.980	21/12/2016*	7.397 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	1.395.738	USD	416.443	21/12/2016*	3.198 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	1.413.802	USD	420.127	21/12/2016*	4.946 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	1.732.973	USD	518.779	21/12/2016*	2.255 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	1.803.264	USD	548.332	21/12/2016*	(6.164) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	2.546.055	USD	756.868	21/12/2016*	8.627 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	123.600	USD	94.939	21/12/2016	(602) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	523.044	USD	399.606	21/12/2016	(399) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	626.347	USD	479.282	21/12/2016	(1.230) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	1.005.883	USD	779.637	21/12/2016	(11.908) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	1.034.157	USD	801.965	21/12/2016	(12.656) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	1.044.249	USD	802.006	21/12/2016	(4.994) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	1.365.000	USD	1.049.400	21/12/2016	(7.579) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	1.370.400	USD	1.051.934	21/12/2016	(5.991) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	1.521.000	USD	1.179.656	21/12/2016	(18.770) (0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	1.803.600	USD	1.395.903	21/12/2016	(19.326) (0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	1.884.372	USD	1.438.196	21/12/2016	30 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	2.064.748	USD	1.603.945	21/12/2016	(28.049) (0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	2.901.600	USD	2.210.569	21/12/2016	4.045 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	3.556.200	USD	2.759.592	21/12/2016	(45.362) (0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	3.964.200	USD	3.028.017	21/12/2016	(2.386) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	5.058.000	USD	7.566	21/12/2016*	79 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	5.572.200	USD	8.366	21/12/2016*	56 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	15.751.200	USD	23.302	21/12/2016*	504 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	17.903.400	USD	26.859	21/12/2016*	201 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	44.999.400	USD	67.483	21/12/2016*	529 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	55.266.000	USD	81.564	21/12/2016*	1.965 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	65.383.200	USD	98.841	21/12/2016*	(20) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	70.827.000	USD	106.575	21/12/2016*	474 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CLP	1.221.091.800	USD	1.795.072	21/12/2016*	50.500 0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	38.913.000	USD	13.514	21/12/2016*	(149) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	111.832.200	USD	37.120	21/12/2016*	1.292 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	135.373.800	USD	46.824	21/12/2016*	(327) (0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust des Nettovermögens
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	136.543.800	USD	46.255	21/12/2016*	644 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	292.942.200	USD	99.675	21/12/2016*	943 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	599.233.819	USD	205.916	21/12/2016*	(96) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	611.700.754	USD	211.351	21/12/2016*	(1.249) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	775.993.800	USD	259.480	21/12/2016*	7.052 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	959.529.703	USD	319.922	21/12/2016*	9.649 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	COP	1.041.387.924	USD	352.758	21/12/2016*	4.930 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	417.600	USD	470.412	21/12/2016	(595) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	1.237.200	USD	1.384.755	21/12/2016	7.145 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	1.471.800	USD	1.660.331	21/12/2016	(4.497) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	1.497.000	USD	1.689.593	21/12/2016	(5.407) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	1.576.800	USD	1.779.002	21/12/2016	(5.038) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	1.682.400	USD	1.892.657	21/12/2016	111 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	1.753.800	USD	1.971.877	21/12/2016	1.219 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	2.823.600	USD	3.189.594	21/12/2016	(12.930) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	2.877.000	USD	3.223.752	21/12/2016	12.989 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	3.725.400	USD	4.191.804	21/12/2016	(578) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	4.073.400	USD	4.595.877	21/12/2016	(13.137) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	5.691.000	USD	6.417.545	21/12/2016	(14.940) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	GBP	13.800	USD	18.224	21/12/2016	(274) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	2.058.000	USD	7.425	21/12/2016	26 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	8.964.600	USD	32.684	21/12/2016	(226) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	13.131.600	USD	47.671	21/12/2016	(125) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	14.320.200	USD	51.927	21/12/2016	(77) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	33.917.400	USD	122.996	21/12/2016	(191) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	48.789.600	USD	175.707	21/12/2016	945 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	49.213.800	USD	180.768	21/12/2016	(2.580) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	49.371.000	USD	181.429	21/12/2016	(2.671) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	71.478.000	USD	262.695	21/12/2016	(3.894) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	75.140.400	USD	271.558	21/12/2016	502 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	75.186.600	USD	272.947	21/12/2016	(719) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	75.340.200	USD	272.174	21/12/2016	610 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	115.804.232	USD	424.559	21/12/2016	(5.267) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	196.925.848	USD	711.968	21/12/2016	1.040 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	248.388.285	USD	895.940	21/12/2016	3.402 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	273.010.835	USD	987.430	21/12/2016	1.059 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	IDR	989.504.400	USD	74.232	21/12/2016*	911 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	IDR	1.271.238.600	USD	94.209	21/12/2016*	2.329 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	IDR	1.961.026.200	USD	145.370	21/12/2016*	3.551 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	IDR	2.197.378.200	USD	163.253	21/12/2016*	3.616 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	IDR	2.650.454.400	USD	196.768	21/12/2016*	4.508 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	IDR	7.074.791.092	USD	524.878	21/12/2016*	12.384 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	IDR	7.649.827.373	USD	576.869	21/12/2016*	4.061 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	IDR	10.639.505.535	USD	788.407	21/12/2016*	19.559 0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	89.400	USD	23.873	21/12/2016	(42) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	176.400	USD	47.131	21/12/2016	(109) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	244.800	USD	64.867	21/12/2016	389 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	246.000	USD	65.623	21/12/2016	(47) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	270.600	USD	71.797	21/12/2016	336 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	359.400	USD	95.363	21/12/2016	441 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	394.200	USD	105.423	21/12/2016	(343) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	504.600	USD	134.469	21/12/2016	41 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	937.200	USD	249.924	21/12/2016	(97) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	1.032.768	USD	274.747	21/12/2016	555 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	1.405.200	USD	372.693	21/12/2016	1.888 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	1.428.600	USD	381.447	21/12/2016	(629) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	1.804.638	USD	482.329	21/12/2016	(1.272) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ILS	3.188.994	USD	851.728	21/12/2016	(1.647) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	529.800	USD	7.774	21/12/2016*	91 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	4.253.400	USD	63.248	21/12/2016*	(108) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	5.373.600	USD	79.989	21/12/2016*	(220) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	5.658.600	USD	84.168	21/12/2016*	(169) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	7.369.800	USD	107.991	21/12/2016*	1.410 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	9.669.600	USD	142.618	21/12/2016*	923 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	9.675.000	USD	142.826	21/12/2016*	795 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	9.710.400	USD	142.990	21/12/2016*	1.156 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	11.697.600	USD	173.324	21/12/2016*	321 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	11.707.200	USD	173.287	21/12/2016*	501 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	11.727.600	USD	173.038	21/12/2016*	1.053 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	11.738.400	USD	173.402	21/12/2016*	849 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	11.868.000	USD	176.524	21/12/2016*	(349) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	11.935.800	USD	177.110	21/12/2016*	72 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	13.327.200	USD	195.329	21/12/2016*	2.508 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	14.343.000	USD	211.046	21/12/2016*	1.870 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	14.865.600	USD	218.845	21/12/2016*	1.828 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	17.262.000	USD	253.593	21/12/2016*	2.653 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	23.083.231	USD	342.979	21/12/2016*	(319) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	29.125.065	USD	426.712	21/12/2016*	5.636 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	32.087.127	USD	472.382	21/12/2016*	3.937 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	34.786.551	USD	513.325	21/12/2016*	3.066 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	46.681.826	USD	684.438	21/12/2016*	8.533 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	4.996.200	USD	49.310	21/12/2016	200 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	23.946.000	USD	238.837	21/12/2016	(1.542) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	48.449.400	USD	476.405	21/12/2016	3.710 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	95.276.400	USD	952.683	21/12/2016	(8.532) (0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	107.656.800	USD	1.059.961	21/12/2016	6.876 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	129.875.400	USD	1.277.201	21/12/2016	9.812 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	157.222.200	USD	1.538.882	21/12/2016	19.127 0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	165.493.200	USD	1.616.429	21/12/2016	23.543 0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	215.328.288	USD	2.102.559	21/12/2016	31.259 0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	217.679.562	USD	2.149.932	21/12/2016	7.186 0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	220.830.904	USD	2.209.867	21/12/2016	(21.520) (0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	415.942.333	USD	4.078.218	21/12/2016	43.605 0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	435.394.850	USD	4.292.734	21/12/2016	21.856 0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	436.221.155	USD	4.290.939	21/12/2016	31.839 0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	440.280.089	USD	4.289.954	21/12/2016	73.047 0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	443.563.100	USD	4.297.068	21/12/2016	98.466 0,03
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	552.289.800	USD	5.534.992	21/12/2016	(62.019) (0,02)
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	657.270.572	USD	6.384.894	21/12/2016	128.397 0,04
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	679.963.066	USD	6.710.372	21/12/2016	27.793 0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	799.953.000	USD	7.861.483	21/12/2016	65.734 0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	817.699.480	USD	8.078.301	21/12/2016	24.776 0,01

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	832.108.800	USD	8.315.791	21/12/2016	(69.923)	(0,02)
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	59.355.600	USD	53.416	21/12/2016	451	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	89.129.400	USD	79.548	21/12/2016	1.340	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	182.562.600	USD	166.411	21/12/2016	(729)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	194.674.800	USD	173.173	21/12/2016	3.502	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	209.587.800	USD	190.901	21/12/2016	(692)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	283.306.800	USD	256.914	21/12/2016	198	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	459.546.000	USD	412.355	21/12/2016	4.701	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	475.924.800	USD	425.069	21/12/2016	6.852	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	586.591.800	USD	529.796	21/12/2016	2.559	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	586.711.800	USD	530.870	21/12/2016	1.594	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	587.577.000	USD	532.349	21/12/2016	900	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	593.137.200	USD	531.248	21/12/2016	7.047	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	594.252.000	USD	530.800	21/12/2016	8.507	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	895.461.000	USD	813.398	21/12/2016	(732)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.121.603.186	USD	1.024.141	21/12/2016	(6.243)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.185.849.600	USD	1.084.753	21/12/2016	(8.548)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.221.966.177	USD	1.087.328	21/12/2016	21.654	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.572.881.149	USD	1.416.060	21/12/2016	11.391	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.616.923.841	USD	1.476.987	21/12/2016	(9.566)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	2.103.003.847	USD	1.878.362	21/12/2016	30.196	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	MXN	1.154.388	USD	60.762	21/12/2016	(1.822)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MXN	1.168.812	USD	61.302	21/12/2016	(1.625)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MXN	10.483.800	USD	565.777	21/12/2016	(30.495)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MYR	351.600	USD	86.740	21/12/2016	(2.048)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MYR	7.206.600	USD	1.776.959	21/12/2016	(41.052)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	684.000	USD	83.024	21/12/2016	2.529	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	2.718.600	USD	327.104	21/12/2016	12.930	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	3.124.390	USD	381.029	21/12/2016	9.761	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	3.292.208	USD	404.061	21/12/2016	7.719	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	4.063.800	USD	490.299	21/12/2016	17.989	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	4.256.776	USD	509.747	21/12/2016	22.678	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	4.270.200	USD	514.252	21/12/2016	19.853	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	5.844.626	USD	710.901	21/12/2016	20.129	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	5.934.600	USD	733.798	21/12/2016	8.485	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	5.948.400	USD	716.018	21/12/2016	27.991	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	5.983.800	USD	735.261	21/12/2016	13.176	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	6.213.600	USD	756.948	21/12/2016	20.232	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	6.867.600	USD	848.152	21/12/2016	10.828	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	6.984.600	USD	869.769	21/12/2016	3.845	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	7.123.200	USD	879.309	21/12/2016	11.641	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	7.140.000	USD	877.774	21/12/2016	15.276	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	7.652.400	USD	931.089	21/12/2016	26.051	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	9.522.600	USD	1.165.491	21/12/2016	25.568	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	9.550.800	USD	1.156.029	21/12/2016	38.558	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	157.200	USD	116.539	21/12/2016	(2.441)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	346.200	USD	249.688	21/12/2016	1.590	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	631.200	USD	462.187	21/12/2016	(4.052)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	1.053.600	USD	762.199	21/12/2016	2.521	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	1.179.600	USD	859.659	21/12/2016	(3.487)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	1.450.200	USD	1.051.444	21/12/2016	1.134	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	1.591.800	USD	1.152.410	21/12/2016	2.944	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	1.974.000	USD	1.429.983	21/12/2016	2.778	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	2.138.400	USD	1.560.152	21/12/2016	(8.068)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	2.138.400	USD	1.558.262	21/12/2016	(6.177)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	2.138.400	USD	1.548.936	21/12/2016	3.148	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	3.320.421	USD	2.387.777	21/12/2016	22.238	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	3.320.584	USD	2.414.907	21/12/2016	(4.774)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	3.972.332	USD	2.933.115	21/12/2016	(49.933)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	4.703.400	USD	3.441.072	21/12/2016	(27.269)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	6.387.225	USD	4.610.514	21/12/2016	25.436	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	8.175.000	USD	5.936.649	21/12/2016	(3.104)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	8.394.132	USD	6.060.282	21/12/2016	32.313	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	8.539.394	USD	6.347.679	21/12/2016	(149.651)	(0,04)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	9.721.312	USD	7.151.697	21/12/2016	(95.814)	(0,03)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PHP	9.133.200	USD	196.541	21/12/2016	(9.339)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PHP	11.867.400	USD	253.849	21/12/2016	(10.605)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PHP	45.968.626	USD	983.085	21/12/2016	(40.869)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PHP	47.406.774	USD	1.017.755	21/12/2016	(46.066)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	288.000	USD	74.280	21/12/2016	622	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	651.000	USD	168.949	21/12/2016	361	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.118.183	USD	284.697	21/12/2016	6.117	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.393.200	USD	363.406	21/12/2016	(1.067)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.396.200	USD	365.662	21/12/2016	(2.543)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.401.600	USD	365.685	21/12/2016	(1.161)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.459.200	USD	379.597	21/12/2016	(93)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.464.000	USD	381.118	21/12/2016	(365)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.530.600	USD	398.940	21/12/2016	(866)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.581.600	USD	415.335	21/12/2016	(3.998)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.584.600	USD	409.602	21/12/2016	2.515	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.585.800	USD	410.757	21/12/2016	1.673	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.587.000	USD	410.557	21/12/2016	2.185	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.593.000	USD	413.784	21/12/2016	518	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.929.085	USD	495.084	21/12/2016	6.626	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	2.006.232	USD	521.712	21/12/2016	63	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	2.316.226	USD	596.131	21/12/2016	6.266	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	2.729.062	USD	700.805	21/12/2016	8.961	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	3.861.996	USD	1.001.313	21/12/2016	3.102	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	8.262.016	USD	2.155.567	21/12/2016	(6.808)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	SGD	126.135	USD	92.238	21/12/2016	312	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	SGD	127.581	USD	94.349	21/12/2016	(738)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	SGD	141.000	USD	103.624	21/12/2016	(367)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	SGD	141.000	USD	104.184	21/12/2016	(727)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	SGD	174.990	USD	128.883	21/12/2016	(486)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	SGD	250.859	USD	186.368	21/12/2016	(2.302)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	SGD	252.566	USD	185.462	21/12/2016	(144)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	SGD	463.934	USD	340.641	21/12/2016	(234)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	SGD	463.935	USD	340.085	21/12/2016	323	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	52.200	USD	17.229	21/12/2016	(108)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	313.800	USD	104.729	21/12/2016	(1.807)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	468.000	USD	155.949	21/12/2016	(2.451)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	1.201.354	USD	396.606	21/12/2016	(2.579)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	2.502.823	USD	826.946	21/12/2016	(6.055)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	2.842.800	USD	946.815	21/12/2016	(14.416)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	7.069.933	USD	2.352.272	21/12/2016	(33.431)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	8.049.450	USD	2.687.618	21/12/2016	(47.509)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	10.236.380	USD	3.407.571	21/12/2016	(50.180)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	11.579.400	USD	3.840.967	21/12/2016	(43.083)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	13.388.260	USD	4.428.226	21/12/2016	(37.061)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TWD	825.600	USD	26.453	21/12/2016*	18	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	TWD	2.222.400	USD	71.304	21/12/2016*	(47)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TWD	4.351.200	USD	140.416	21/12/2016*	(903)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TWD	4.428.000	USD	141.985	21/12/2016*	(10)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TWD	4.429.800	USD	141.512	21/12/2016*	521	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	TWD	4.567.800	USD	146.181	21/12/2016*	277	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	TWD	5.745.000	USD	184.454	21/12/2016*	(251)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TWD	5.750.400	USD	184.852	21/12/2016*	(477)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TWD	6.473.400	USD	208.101	21/12/2016*	(543)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TWD	32.632.800	USD	1.036.428	21/12/2016*	9.882	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	182.356	AUD	242.400	21/12/2016	(2.925)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	320.455	AUD	427.800	21/12/2016	(6.538)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	455.208	AUD	603.600	21/12/2016	(6.160)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	823.822	AUD	1.093.833	21/12/2016	(12.260)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	825.460	AUD	1.093.834	21/12/2016	(10.623)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	917.172	AUD	1.218.240	21/12/2016	(14.002)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.067.829	AUD	1.407.000	21/12/2016	(7.626)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.179.813	AUD	1.569.893	21/12/2016	(20.150)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.180.297	AUD	1.576.800	21/12/2016	(24.946)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.180.740	AUD	1.581.000	21/12/2016	(27.713)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.222.920	AUD	2.983.200	21/12/2016	(57.318)	(0,02)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.222.995	AUD	2.983.200	21/12/2016	(57.244)	(0,02)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	19.758	BRL	66.000	21/12/2016*	(86)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.577.506	CAD	2.085.000	21/12/2016	(13.847)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.580.806	CAD	2.085.600	21/12/2016	(11.004)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.086.966	CAD	2.758.200	21/12/2016	(18.200)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.092.304	CAD	2.760.600	21/12/2016	(14.693)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.134.524	CAD	2.800.200	21/12/2016	(2.697)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.283.073	CAD	3.011.400	21/12/2016	(15.344)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.287.002	CAD	3.016.800	21/12/2016	(15.536)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.304.231	CAD	3.047.400	21/12/2016	(21.663)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.342.653	CAD	3.087.000	21/12/2016	(13.465)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.355.977	CAD	3.092.400	21/12/2016	(4.263)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.372.048	CAD	3.087.600	21/12/2016	16.371	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.436.486	CAD	3.225.600	21/12/2016	(25.417)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	5.858.317	CAD	7.717.200	21/12/2016	(31.749)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	6.980.663	CAD	9.132.600	21/12/2016	10.308	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	4.543	CLP	3.076.200	21/12/2016*	(107)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	8.204	CLP	5.518.200	21/12/2016*	(136)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	9.055	CLP	6.127.800	21/12/2016*	(207)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	21.246	CLP	14.465.400	21/12/2016*	(617)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	56.146	CLP	38.424.000	21/12/2016*	(1.928)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	5.001	COP	14.823.600	21/12/2016*	(91)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	7.992	COP	23.863.200	21/12/2016*	(205)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	122.458	COP	373.068.000	21/12/2016*	(5.680)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	121.951	EUR	108.000	21/12/2016	446	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	730.070	EUR	651.600	21/12/2016	(3.007)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.112.783	EUR	994.200	21/12/2016	(5.733)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.594.515	EUR	1.420.800	21/12/2016	(3.943)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.085.108	EUR	2.755.780	21/12/2016	(15.256)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.207.843	EUR	2.835.376	21/12/2016	17.930	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.386.484	EUR	3.007.200	21/12/2016	3.262	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.468.181	EUR	3.100.800	21/12/2016	(20.345)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.475.207	EUR	3.100.800	21/12/2016	(13.318)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.500.879	EUR	3.100.800	21/12/2016	12.353	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.612.870	EUR	3.216.600	21/12/2016	(5.935)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	4.071.249	EUR	3.631.366	21/12/2016	(14.184)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	4.936.657	EUR	4.356.000	21/12/2016	35.305	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	6.262.511	EUR	5.586.717	21/12/2016	(22.772)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	6.653.624	EUR	5.873.400	21/12/2016	46.011	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	7.697.631	EUR	6.804.901	21/12/2016	41.842	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	9.978.766	EUR	8.831.660	21/12/2016	42.791	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	372.601	GBP	283.800	21/12/2016	3.457	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	393.430	GBP	297.600	21/12/2016	6.336	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	482.451	GBP	368.400	21/12/2016	3.266	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	575.758	GBP	432.000	21/12/2016	13.848	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	678.786	GBP	513.600	21/12/2016	10.737	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	846.389	GBP	643.200	21/12/2016	9.767	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	869.080	GBP	669.000	21/12/2016	(1.100)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	872.715	GBP	671.400	21/12/2016	(587)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.001.023	GBP	771.600	21/12/2016	(2.612)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.002.546	GBP	772.200	21/12/2016	(1.869)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.011.323	GBP	760.800	21/12/2016	21.736	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.012.674	GBP	778.200	21/12/2016	455	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.013.141	GBP	778.200	21/12/2016	922	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.052.473	GBP	789.000	21/12/2016	26.207	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.173.652	GBP	875.400	21/12/2016	35.003	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.185.051	GBP	911.400	21/12/2016	(424)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.196.421	GBP	910.800	21/12/2016	11.727	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.681.501	GBP	1.281.600	21/12/2016	14.500	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.456.625	GBP	1.839.000	21/12/2016	64.604	0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.578.872	GBP	1.950.000	21/12/2016	42.471	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	10.863.419	GBP	8.268.600	21/12/2016	108.299	0,03
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	496.134	HKD	3.846.000	21/12/2016	(252)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	42.563	HUF	11.715.600	21/12/2016	144	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	60.155	HUF	16.703.400	21/12/2016	(323)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	60.366	HUF	16.792.200	21/12/2016	(433)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	60.628	HUF	16.772.400	21/12/2016	(99)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	86.973	HUF	23.862.000	21/12/2016	576	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	12.747	IDR	168.610.200	21/12/2016*	(57)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	18.218	IDR	241.204.200	21/12/2016*	(99)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	41.147	IDR	555.701.400	21/12/2016*	(1.053)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	46.307	IDR	618.436.800	21/12/2016*	(657)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	89.153	IDR	1.197.334.800	21/12/2016*	(1.773)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	17.075	ILS	64.200	21/12/2016	(39)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	93.037	ILS	351.000	21/12/2016	(528)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	98.824	ILS	372.000	21/12/2016	(339)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.087.070	JPY	109.413.600	21/12/2016	2.825	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.096.088	JPY	109.598.400	21/12/2016	10.011	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.374.890	JPY	141.534.600	21/12/2016	(27.662)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.717.113	JPY	175.726.800	21/12/2016	(24.270)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.821.293	JPY	184.572.600	21/12/2016	(7.748)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.112.311	JPY	219.094.200	21/12/2016	(58.826)	(0,02)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.261.499	JPY	233.121.000	21/12/2016	(48.638)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.488.409	JPY	252.238.800	21/12/2016	(11.178)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	61.541	KRW	68.847.000	21/12/2016*	(940)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	32.332	MXN	634.200	21/12/2016	(49)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	78.938	MXN	1.543.200	21/12/2016	146	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	98.746	MXN	1.965.000	21/12/2016	(1.583)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	98.910	MXN	1.982.400	21/12/2016	(2.307)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	135.441	MXN	2.496.000	21/12/2016	8.001	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	150.687	MXN	2.965.800	21/12/2016	(741)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	169.052	MXN	3.150.600	21/12/2016	8.188	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	268.148	MXN	5.298.000	21/12/2016	(2.358)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	320.942	MXN	6.097.200	21/12/2016	9.631	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	414.188	MXN	7.770.000	21/12/2016	17.467	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	517.934	MXN	10.360.800	21/12/2016	(11.068)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	545.897	MXN	10.833.000	21/12/2016	(7.215)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	548.018	MXN	10.855.200	21/12/2016	(6.227)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	601.719	MXN	11.632.800	21/12/2016	7.772	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	627.073	MXN	12.147.600	21/12/2016	6.841	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	664.149	MXN	12.643.800	21/12/2016	18.581	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	667.142	MXN	12.721.800	21/12/2016	17.592	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	686.859	MXN	13.336.800	21/12/2016	5.908	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.785.744	MXN	34.413.600	21/12/2016	28.653	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	23.388	MYR	95.400	21/12/2016*	408	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	40.695	MYR	168.600	21/12/2016*	83	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	48.976	MYR	203.400	21/12/2016*	(18)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	59.207	MYR	244.200	21/12/2016*	385	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	62.061	MYR	257.400	21/12/2016*	59	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	62.407	MYR	257.400	21/12/2016*	405	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	62.602	MYR	259.800	21/12/2016*	22	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	78.198	MYR	324.600	21/12/2016*	9	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	83.791	MYR	347.400	21/12/2016*	110	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	84.894	MYR	351.600	21/12/2016*	202	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	164.211	MYR	669.000	21/12/2016*	3.064	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	863.844	MYR	3.560.400	21/12/2016*	6.225	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	13.339	NOK	110.400	21/12/2016	(470)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	459.312	NOK	3.823.800	21/12/2016	(18.958)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	550.448	NOK	4.579.200	21/12/2016	(22.305)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	567.806	NOK	4.723.800	21/12/2016	(23.033)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	694.876	NOK	5.733.000	21/12/2016	(22.191)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.122.698	NZD	1.539.000	21/12/2016	5.667	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.381.471	NZD	3.295.800	21/12/2016	(10.673)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.833.686	NZD	3.912.600	21/12/2016	(6.141)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.770.609	NZD	5.183.400	21/12/2016	8.415	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.773.416	NZD	5.223.000	21/12/2016	(17.521)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	4.873.190	NZD	6.732.000	21/12/2016	(13.003)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	55.740	PHP	2.708.400	21/12/2016*	226	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	55.914	PHP	2.718.000	21/12/2016*	204	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	68.661	PHP	3.348.600	21/12/2016*	25	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	69.003	PHP	3.318.000	21/12/2016*	994	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	69.077	PHP	3.326.400	21/12/2016*	896	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	69.113	PHP	3.367.200	21/12/2016*	96	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	119.306	PHP	5.575.200	21/12/2016*	5.032	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	157.573	PHP	7.582.200	21/12/2016*	2.162	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	255.290	PHP	12.358.200	21/12/2016*	1.986	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	255.857	PHP	12.359.400	21/12/2016*	2.528	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	334.741	PHP	16.110.600	21/12/2016*	4.524	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	335.229	PHP	18.148.400	21/12/2016*	4.237	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	336.525	PHP	16.228.200	21/12/2016*	3.898	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	340.149	PHP	16.303.800	21/12/2016*	5.972	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	351.579	PHP	16.644.000	21/12/2016*	10.430	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	125.423	PLN	482.400	21/12/2016	(38)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	364.160	PLN	1.410.600	21/12/2016	(2.704)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	705.224	PLN	2.737.800	21/12/2016	(6.814)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	918.135	PLN	3.595.800	21/12/2016	(17.050)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	961.168	PLN	3.775.200	21/12/2016	(20.674)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	963.138	PLN	3.773.400	21/12/2016	(18.236)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.462.727	PLN	5.730.600	21/12/2016	(27.669)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	58.034	SEK	495.000	21/12/2016	195	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	125.338	SEK	1.048.800	21/12/2016	2.790	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	259.592	SEK	2.197.800	21/12/2016	2.789	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	344.699	SEK	2.954.400	21/12/2016	(510)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	348.048	SEK	2.962.800	21/12/2016	1.857	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	348.461	SEK	2.955.600	21/12/2016	3.112	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	417.827	SEK	3.582.000	21/12/2016	(715)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	509.078	SEK	4.272.600	21/12/2016	9.843	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	626.402	SEK	5.369.400	21/12/2016	(990)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	631.196	SEK	5.357.400	21/12/2016	5.207	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	645.560	SEK	5.461.784	21/12/2016	7.373	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	686.710	SEK	5.843.400	21/12/2016	3.934	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	690.353	SEK	5.898.200	21/12/2016	1.407	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	691.093	SEK	5.848.200	21/12/2016	7.756	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	693.274	SEK	5.905.200	21/12/2016	3.277	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	695.406	SEK	5.882.400	21/12/2016	8.073	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	760.646	SEK	6.391.929	21/12/2016	13.776	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	778.613	SEK	6.630.000	21/12/2016	3.926	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.099.631	SEK	9.306.000	21/12/2016	12.264	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.114.965	SEK	9.544.200	21/12/2016	(235)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.358.142	SEK	11.583.651	21/12/2016	4.642	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.388.508	SEK	11.808.000	21/12/2016	8.793	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.761.499	SEK	14.890.200	21/12/2016	21.642	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.787.997	SEK	23.345.118	21/12/2016	60.219	0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.212.328	SEK	26.983.318	21/12/2016	59.441	0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	16.325	SGD	22.200	21/12/2016	36	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	34.906	SGD	47.400	21/12/2016	127	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelt Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	43.503	SGD	58.800	21/12/2016	359	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	45.475	SGD	61.800	21/12/2016	130	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	104.673	SGD	142.800	21/12/2016	(105)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	168.522	SGD	229.800	21/12/2016	(91)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	188.512	SGD	256.800	21/12/2016	88	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	189.598	SGD	258.600	21/12/2016	(147)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	197.161	SGD	269.400	21/12/2016	(509)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	273.963	SGD	374.400	21/12/2016	(749)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	444.977	SGD	606.000	21/12/2016	331	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	901.004	SGD	1.222.200	21/12/2016	4.227	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	102.644	TRY	311.400	21/12/2016	510	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	144.294	TRY	436.800	21/12/2016	1.029	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	188.055	TRY	571.200	21/12/2016	709	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	223.672	TRY	669.600	21/12/2016	4.052	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	411.547	TRY	1.248.600	21/12/2016	2.024	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	859.841	TRY	2.617.800	21/12/2016	1.239	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	862.944	TRY	2.611.800	21/12/2016	6.310	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.129.565	TRY	3.420.000	21/12/2016	7.852	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	52.339	TWD	1.656.000	21/12/2016	(758)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	233.953	ZAR	3.462.600	21/12/2016	(13.107)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	263.680	ZAR	3.970.800	21/12/2016	(19.640)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	277.926	ZAR	4.158.000	21/12/2016	(18.751)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	855.291	ZAR	12.658.200	21/12/2016	(47.883)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	300.000	USD	20.391	21/12/2016	1.015	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	1.340.400	USD	94.004	21/12/2016	1.635	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	1.375.800	USD	93.733	21/12/2016	4.432	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	2.526.600	USD	172.707	21/12/2016	7.569	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	2.563.759	USD	179.901	21/12/2016	3.025	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	2.578.800	USD	178.310	21/12/2016	5.690	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	2.872.200	USD	206.586	21/12/2016	(1.652)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	2.906.400	USD	206.671	21/12/2016	703	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	3.319.800	USD	228.332	21/12/2016	8.539	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	3.334.200	USD	233.505	21/12/2016	4.393	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	3.486.030	USD	245.344	21/12/2016	3.387	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	3.722.754	USD	256.681	21/12/2016	8.941	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	3.796.200	USD	269.140	21/12/2016	1.722	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	5.079.600	USD	370.068	21/12/2016	(7.634)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	5.094.000	USD	366.587	21/12/2016	(3.126)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	5.106.000	USD	368.334	21/12/2016	(4.016)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	5.121.000	USD	371.986	21/12/2016	(6.598)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	5.182.200	USD	371.487	21/12/2016	(1.732)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	5.930.475	USD	398.725	21/12/2016	21.566	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	8.546.982	USD	588.139	21/12/2016	21.696	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	11.823.000	USD	821.314	21/12/2016	22.268	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	17.008.800	USD	1.176.068	21/12/2016	37.525	0,01
Total Devisenterminkontrakte						573.351	0,16

* Nicht lieferbare Terminkontrakte. (Siehe Anmerkung 3)

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte zu Sicherungszwecken

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Citibank, N.A.	CHF	40.078	USD	41.193	21/12/2016	285	0,00
Citibank, N.A.	CHF	52.545	USD	53.951	21/12/2016	430	0,00
Citibank, N.A.	CHF	68.678	USD	71.160	21/12/2016	(83)	(0,00)
Citibank, N.A.	CHF	80.109	USD	81.811	21/12/2016	1.097	0,00
Citibank, N.A.	CHF	88.977	USD	91.360	21/12/2016	726	0,00
Citibank, N.A.	CHF	122.243	USD	126.077	21/12/2016	437	0,00
Citibank, N.A.	CHF	172.560	USD	176.618	21/12/2016	1.970	0,00
Citibank, N.A.	CHF	238.475	USD	246.188	21/12/2016	619	0,00
Citibank, N.A.	CHF	250.872	USD	260.376	21/12/2016	(739)	(0,00)
Citibank, N.A.	CHF	341.954	USD	354.664	21/12/2016	(763)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	17.000	USD	19.090	21/12/2016	36	0,00
Citibank, N.A.	EUR	30.099	USD	33.988	21/12/2016	(125)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	56.285	USD	63.400	21/12/2016	(77)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	76.866	USD	87.505	21/12/2016	(1.027)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	120.487	USD	134.939	21/12/2016	614	0,00
Citibank, N.A.	EUR	200.000	USD	225.624	21/12/2016	(616)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	347.724	USD	388.872	21/12/2016	2.332	0,00
Citibank, N.A.	EUR	400.000	USD	448.259	21/12/2016	1.757	0,00
Citibank, N.A.	EUR	468.652	USD	527.076	21/12/2016	177	0,00
Citibank, N.A.	EUR	499.999	USD	564.060	21/12/2016	(1.540)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	694.955	USD	784.206	21/12/2016	(2.354)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	1.477.940	USD	1.665.962	21/12/2016	(3.220)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	2.364.925	USD	2.665.597	21/12/2016	(4.961)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	2.948.603	USD	3.301.003	21/12/2016	16.295	0,00
Citibank, N.A.	EUR	3.033.769	USD	3.432.328	21/12/2016	(19.215)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	3.593.451	USD	4.033.585	21/12/2016	9.193	0,00
Citibank, N.A.	EUR	3.885.454	USD	4.356.154	21/12/2016	15.139	0,00
Citibank, N.A.	EUR	4.500.369	USD	5.049.739	21/12/2016	13.358	0,00
Citibank, N.A.	EUR	5.977.622	USD	6.700.760	21/12/2016	24.307	0,01
Citibank, N.A.	EUR	7.281.044	USD	8.236.311	21/12/2016	(44.842)	(0,01)
Citibank, N.A.	EUR	9.449.616	USD	10.677.079	21/12/2016	(45.879)	(0,01)
Citibank, N.A.	EUR	17.034.430	USD	19.324.492	21/12/2016	(160.068)	(0,04)
Citibank, N.A.	GBP	4.442	USD	5.855	21/12/2016	(78)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	7.788	USD	10.459	21/12/2016	(329)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	10.013	USD	13.166	21/12/2016	(142)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	10.746	USD	13.976	21/12/2016	1	0,00
Citibank, N.A.	GBP	14.599	USD	19.005	21/12/2016	(16)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	20.962	USD	27.738	21/12/2016	(472)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	21.250	USD	28.263	21/12/2016	(623)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	25.328	USD	33.294	21/12/2016	(349)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Managed Futures UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte zu Sicherungszwecken (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Netto-vermögens
Citibank, N.A.	GBP	32.693	USD	42.394	21/12/2016	131	0,00
Citibank, N.A.	GBP	61.170	USD	80.825	21/12/2016	(1.260)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	72.052	USD	93.843	21/12/2016	(124)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	446.313	USD	579.116	21/12/2016	1.411	0,00
Citibank, N.A.	GBP	784.998	USD	1.029.098	21/12/2016	(8.036)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	2.337.714	USD	3.034.161	21/12/2016	6.547	0,00
Citibank, N.A.	GBP	42.674.830	USD	56.067.363	21/12/2016	(559.430)	(0,15)
Citibank, N.A.	NOK	1.257.261	USD	155.030	21/12/2016	2.225	0,00
Citibank, N.A.	NOK	4.275.715	USD	521.435	21/12/2016	13.359	0,00
Citibank, N.A.	NOK	4.505.374	USD	552.956	21/12/2016	10.564	0,00
Citibank, N.A.	NOK	5.825.380	USD	697.586	21/12/2016	31.036	0,01
Citibank, N.A.	NOK	7.998.345	USD	972.863	21/12/2016	27.547	0,01
Citibank, N.A.	USD	99.236	CHF	95.966	21/12/2016	(83)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	56.266	EUR	50.000	21/12/2016	14	0,00
Citibank, N.A.	USD	3.458.047	EUR	3.065.697	21/12/2016	9.014	0,00
Citibank, N.A.	USD	2.213	GBP	1.700	21/12/2016	2	0,00
Citibank, N.A.	USD	8.636	GBP	6.500	21/12/2016	181	0,00
Citibank, N.A.	USD	36.486	GBP	27.342	21/12/2016	922	0,00
Citibank, N.A.	USD	82.574	GBP	61.905	21/12/2016	2.053	0,00
Citibank, N.A.	USD	184.804	GBP	142.401	21/12/2016	(420)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	4.160.043	GBP	3.114.343	21/12/2016	109.160	0,03
Citibank, N.A.	USD	196.774	NOK	1.617.786	21/12/2016	(5.574)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	60.117	USD	61.790	21/12/2016	427	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	120.166	USD	122.719	21/12/2016	1.646	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	133.465	USD	137.039	21/12/2016	1.089	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	183.365	USD	189.116	21/12/2016	655	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	357.710	USD	369.279	21/12/2016	928	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	376.306	USD	390.563	21/12/2016	(1.109)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	512.932	USD	531.997	21/12/2016	(1.145)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	4.422.904	USD	4.951.510	21/12/2016	24.436	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	4.550.652	USD	5.148.497	21/12/2016	(28.829)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	5.828.182	USD	6.534.241	21/12/2016	22.700	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	8.966.434	USD	10.051.154	21/12/2016	36.448	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	10.921.565	USD	12.354.482	21/12/2016	(67.279)	(0,02)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	14.174.425	USD	16.015.640	21/12/2016	(68.838)	(0,02)
JPMorgan Chase Bank N.A.	GBP	64.012.243	USD	84.101.147	21/12/2016	(839.249)	(0,23)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	6.413.574	USD	782.154	21/12/2016	20.037	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	6.758.059	USD	829.434	21/12/2016	15.844	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	8.738.070	USD	1.046.380	21/12/2016	46.552	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	11.997.518	USD	1.459.297	21/12/2016	41.319	0,01
Total Hedge Forward Foreign Exchange Contracts						(1.353.874)	(0,37)

Total-Return-Swaps außerbörslich gehandelt

Referenzwert	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Netto-vermögens	
BOVESPA Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	BRL	4.118.282	13/10/2016	(7.162)	(0,00)	
BOVESPA Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	BRL	9.521.326	13/10/2016	(49.628)	(0,02)	
BOVESPA Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	BRL	900.421	13/10/2016	(7.051)	(0,00)	
BOVESPA Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	BRL	1.471.220	13/10/2016	(2.682)	(0,00)	
FTSE CHINA A50 Futures Oct16	Bank of America, N.A.	USD	1.318.364	28/10/2016	(7.617)	(0,00)	
HANG SENG Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	HKD	3.509.569	28/10/2016	(1.627)	(0,00)	
HANG SENG Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	HKD	4.700.953	28/10/2016	(4.946)	(0,00)	
KOSPI2 Index Futures Dec16	Bank of America, N.A.	KRW	1.433.033.800	08/12/2016	(11.744)	(0,00)	
MSCI Taiwan Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	USD	1.890.668	28/10/2016	(11.318)	(0,00)	
SGX Nifty 50 Futures Oct16	Bank of America, N.A.	USD	1.116.004	27/10/2016	(25.978)	(0,01)	
TAIEX Futures Oct16	Bank of America, N.A.	TWD	127.385.468	19/10/2016	13.863	0,00	
TAIEX Futures Oct16	Bank of America, N.A.	TWD	58.330.016	19/10/2016	3.254	0,00	
FTSE CHINA A50 Futures Oct16	Goldman Sachs International	USD	680.713	28/10/2016	(1.420)	(0,00)	
FTSE CHINA A50 Futures Oct16	Goldman Sachs International	USD	684.000	28/10/2016	4.860	0,00	
FTSE CHINA A50 Futures Oct16	Goldman Sachs International	USD	691.848	28/10/2016	(2.988)	(0,00)	
HANG SENG Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	10.526.333	28/10/2016	(4.576)	(0,00)	
HANG SENG Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	10.566.190	28/10/2016	(9.716)	(0,00)	
HANG SENG Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	11.744.866	28/10/2016	(11.396)	(0,00)	
H-SHARES Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	10.169.040	28/10/2016	(11.483)	(0,00)	
H-SHARES Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	10.176.395	28/10/2016	(12.432)	(0,01)	
H-SHARES Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	9.726.755	28/10/2016	(16.347)	(0,01)	
KOSPI2 Index Futures Dec16	Goldman Sachs International	KRW	262.334.900	08/12/2016	(3.754)	(0,00)	
KOSPI2 Index Futures Dec16	Goldman Sachs International	KRW	260.955.200	08/12/2016	(2.502)	(0,00)	
KOSPI2 Index Futures Dec16	Goldman Sachs International	KRW	260.721.900	08/12/2016	(2.290)	(0,00)	
MSCI Singapore IX ETS Oct16	Goldman Sachs International	SGD	62.285	28/10/2016	546	0,00	
MSCI Singapore IX ETS Oct16	Goldman Sachs International	SGD	93.958	28/10/2016	430	0,00	
MSCI Singapore IX ETS Oct16	Goldman Sachs International	SGD	62.280	28/10/2016	550	0,00	
MSCI Taiwan Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	USD	3.499.395	28/10/2016	(48.224)	(0,02)	
MSCI Taiwan Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	USD	719.629	28/10/2016	(2.059)	(0,00)	
HANG SENG Index Futures Oct16	JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	22.273.404	28/10/2016	(16.256)	(0,01)	
HANG SENG Index Futures Oct16	JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	1.172.439	28/10/2016	(876)	(0,00)	
H-SHARES Index Futures Oct16	JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	23.399.136	28/10/2016	(46.316)	(0,01)	
KOSPI2 Index Futures Dec16	JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	129.266.250	08/12/2016	(151)	(0,00)	
KOSPI2 Index Futures Dec16	JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	2.078.063.200	08/12/2016	(11.316)	(0,00)	
KOSPI2 Index Futures Dec16	JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	129.450.200	08/12/2016	(318)	(0,00)	
SGX Nifty 50 Futures Oct16	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.289.983	27/10/2016	(37.207)	(0,01)	
Total Total-Return-Swaps						(347.877)	(0,10)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Investments	Kupon	Fälligkeitsdatum	Währung	Anzahl/Nominalwert	Marktwert in USD	% des Nettovermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						
Unternehmensanleihen						
Kanada						
Masonite International Corp	5,625%	15/03/2023	USD	1.300.000	1.371.500	1,25
Total Kanada					1.371.500	1,25
Panama						
McDermott International Inc	8,000%	05/01/2021	USD	1.500.000	1.408.125	1,28
Total Panama					1.408.125	1,28
Vereinigtes Königreich						
International Game Technology PLC	6,250%	15/02/2022	USD	1.600.000	1.696.000	1,54
Total Vereinigtes Königreich					1.696.000	1,54
Vereinigte Staaten						
Accuride Corp	9,500%	08/01/2018	USD	1.500.000	1.500.000	1,36
AK Steel Corp	7,625%	15/05/2020	USD	1.850.000	1.794.500	1,63
Alliance One International Inc	9,875%	15/07/2021	USD	1.500.000	1.282.500	1,17
AMAG Pharmaceuticals Inc	7,875%	09/01/2023	USD	1.400.000	1.330.000	1,21
Atwood Oceanics Inc	6,500%	02/01/2020	USD	1.900.000	1.482.000	1,35
Avon Products Inc	6,600%	15/03/2020	USD	1.700.000	1.691.500	1,54
Cable One Inc	5,750%	15/06/2022	USD	1.300.000	1.358.500	1,24
Clayton Williams Energy Inc	7,750%	04/01/2019	USD	1.150.000	1.124.125	1,02
Cloud Peak Energy Resources LLC	6,375%	15/03/2024	USD	1.450.000	739.500	0,67
Coeur Mining Inc	7,875%	02/01/2021	USD	1.400.000	1.435.000	1,31
Commercial Metals Co	4,875%	15/05/2023	USD	1.500.000	1.488.750	1,35
Comstock Resources Inc.	10,000%	15/03/2020	USD	1.000.000	922.500	0,84
CONSOL Energy Inc	5,875%	15/04/2022	USD	1.850.000	1.690.437	1,54
Crestwood Midstream Partners LP	6,250%	04/01/2023	USD	1.550.000	1.569.375	1,43
CSC Holdings LLC	6,750%	15/11/2021	USD	1.800.000	1.903.500	1,73
Diamondback Energy Inc	7,625%	10/01/2021	USD	1.100.000	1.163.250	1,06
DigitalGlobe Inc.	5,250%	02/01/2021	USD	1.450.000	1.439.125	1,31
DS Services of America Inc	10,000%	09/01/2021	USD	1.150.000	1.280.813	1,17
Energizer Holdings Inc	5,500%	15/06/2025	USD	1.200.000	1.236.000	1,12
EnerSys	5,000%	30/04/2023	USD	1.350.000	1.348.313	1,23
Enova International Inc	9,750%	06/01/2021	USD	1.000.000	895.000	0,81
Entegris Inc	6,000%	04/01/2022	USD	1.250.000	1.293.750	1,18
Forum Energy Technologies Inc	6,250%	10/01/2021	USD	1.400.000	1.326.500	1,21
Frontier Communications Corp	11,000%	15/09/2025	USD	2.200.000	2.281.125	2,07
GCP Applied Technologies Inc	9,500%	02/01/2023	USD	1.200.000	1.368.000	1,24
Harsco Corp	5,750%	15/05/2018	USD	1.000.000	1.014.000	0,92
HCA Inc	5,375%	02/01/2025	USD	1.450.000	1.493.500	1,36
Hecla Mining Co	6,875%	05/01/2021	USD	1.000.000	1.003.750	0,91
Hill-Rom Holdings Inc	5,750%	09/01/2023	USD	1.350.000	1.424.250	1,30
Iron Mountain Inc	6,000%	10/01/2020	USD	1.550.000	1.635.250	1,49
Kemet Corp	10,500%	05/01/2018	USD	1.400.000	1.403.500	1,28
Kindred Healthcare Inc	8,000%	15/01/2020	USD	1.350.000	1.366.875	1,24
Kratos Defense & Security Solutions Inc.	7,000%	15/05/2019	USD	1.550.000	1.441.500	1,31
Lee Enterprises Inc	9,500%	15/03/2022	USD	1.300.000	1.342.250	1,22
MEDNAX Inc	5,250%	12/01/2023	USD	1.300.000	1.360.125	1,24
National CineMedia LLC	6,000%	15/04/2022	USD	1.400.000	1.461.250	1,33
Natural Resource Partners L.P.	9,125%	10/01/2018	USD	1.397.000	1.286.986	1,17
Navient Corp	8,450%	15/06/2018	USD	2.450.000	2.627.625	2,39
NGPL PipeCo LLC	7,119%	15/12/2017	USD	1.000.000	1.042.500	0,95
Parsley Energy LLC	7,500%	15/02/2022	USD	1.250.000	1.328.125	1,21
Pilgrim's Pride Corp	5,750%	15/03/2025	USD	1.300.000	1.339.000	1,22
Pioneer Energy Services Corp	6,125%	15/03/2022	USD	1.000.000	660.000	0,60
Plantronics Inc	5,500%	31/05/2023	USD	1.350.000	1.390.500	1,26
Quad/Graphics Inc	7,000%	05/01/2022	USD	1.500.000	1.440.000	1,31
Radian Group Inc	7,000%	15/03/2021	USD	1.400.000	1.564.500	1,42
Radio One Inc	7,375%	15/04/2022	USD	1.000.000	1.005.000	0,91
Regal Entertainment Group	5,750%	15/03/2022	USD	1.350.000	1.387.125	1,26
Resolute Energy Corp	8,500%	05/01/2020	USD	1.400.000	1.302.000	1,18
RR Donnelley & Sons Co	7,875%	15/03/2021	USD	1.450.000	1.584.125	1,44
Sabra Health Care L.P.	5,500%	02/01/2021	USD	1.350.000	1.412.438	1,28
Sanchez Energy Corp	6,125%	15/01/2023	USD	1.100.000	880.000	0,80
Scientific Games International Inc	10,000%	12/01/2022	USD	2.000.000	1.827.500	1,66
Select Medical Corp	6,375%	06/01/2021	USD	1.400.000	1.375.500	1,25
Smithfield Foods Inc	6,625%	15/08/2022	USD	1.400.000	1.484.840	1,35
Sprint Corp	7,875%	15/09/2023	USD	1.000.000	1.002.600	0,91
Steel Dynamics Inc	5,125%	10/01/2021	USD	1.550.000	1.610.062	1,46
Talen Energy Supply LLC	4,625%	15/07/2019	USD	1.650.000	1.551.000	1,41
Teleflex Inc	4,875%	06/01/2026	USD	1.000.000	1.035.000	0,94
The Communications Sales & Leasing Inc.	8,250%	15/10/2023	USD	1.450.000	1.515.250	1,38
The William Carter Co	5,250%	15/08/2021	USD	1.000.000	1.046.630	0,95
Titan International Inc	6,875%	10/01/2020	USD	1.500.000	1.406.250	1,28
Toys R Us Property Co II LLC	8,500%	12/01/2017	USD	1.000.000	995.000	0,91
United States Steel Corp	7,375%	04/01/2020	USD	1.950.000	1.930.500	1,76
Vector Group Ltd	7,750%	15/02/2021	USD	1.300.000	1.366.625	1,24
WellCare Health Plans Inc	5,750%	15/11/2020	USD	1.300.000	1.342.250	1,22
Western Refining Logistics LP	7,500%	15/02/2023	USD	1.300.000	1.332.500	1,21
Yum! Brands Inc	3,875%	11/01/2020	USD	1.500.000	1.542.195	1,40
Total Vereinigte Staaten					92.502.939	84,12
Total Unternehmensanleihen					96.978.564	88,19
Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						
					96.978.564	88,19
Total Anlagen (Gesamtkosten: \$94.560.673)					96.978.564	88,19
Sonstige Vermögenswerte/(Verbindlichkeiten)					12.981.862	11,81
Nettovermögen					109.960.426	100,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Derivate
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Kreditausfall-Swaps - Gegebene, zentral abgewickelte Sicherheiten

Gegenpartei Währung	Beschreibung		Fixe Jahres- rate	Kredit- spanne	Nominalbetrag	Kosten	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(- verlust) in USD	% des Netto- vermögens
Citigroup Global Markets Inc.	North America High Yield CDX Spreads - Series 26	USD	5,00%	3,81%	(5.540.000)	238.220	06/20/2021	276.529	0,24
Citigroup Global Markets Inc.	North America High Yield CDX Spreads - Series 27	USD	5,00%	4,06%	(12.440.000)	485.455	12/20/2021	522.825	0,46
Total Kreditausfall-Swaps									
799.354 0,70									

Börsengehandelte Futures

Beschreibung Nominalbetrag	Gegenpartei	Währung	Anzahl Kontrakte	Fälligkeit	Nicht realisierter Wertzuwachs / (-verlust) in USD	% des Netto- vermögens	
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(6.825.399)	52	20/12/2016	11.789	0,01
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	(4.446.140)	34	20/12/2016	24.328	0,03
Total Futures							
36.117 0,04							

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Kupon	Fälligkeits-datum	Währung	Anzahl/Nominal-wert	Markt-wert in USD	% des Netto-vermögens
Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						
Forderungsbesicherte Wertpapiere						
Vereinigte Staaten						
John Deere Owner Trust 2015	0,870%	15/02/2018	USD	551.498	551.317	0,04
Total Vereinigte Staaten					551.317	0,04
Total durch Vermögenswerte besicherte Wertpapiere						
Kurzfristige Anlagen						
Australien						
Commonwealth Bank of Australia	0,000%	10/07/2016	USD	4.000.000	3.999.704	0,26
National Australia Bank Ltd	0,000%	11/01/2016-12/12/2016	USD	24.000.000	23.989.998	1,56
Wells Fargo Bank NA	1,020%	21/02/2017	USD	6.000.000	6.001.602	0,39
Westpac Banking Corp	0,000%	22/12/2016-01/04/2017	USD	11.500.000	11.473.824	0,75
Total Australien					45.465.128	2,96
Kanada						
The Bank of Nova Scotia	0,000%	11/02/2016-20/10/2016	USD	26.000.000	25.993.484	1,69
Total Kanada					25.993.484	1,69
Frankreich						
Societe Generale SA	0,000%	10/06/2016	USD	26.000.000	25.998.388	1,69
Total Frankreich					25.998.388	1,69
Japan						
Sumitomo Mitsui Banking Corp	0,950%	16/12/2016	USD	7.000.000	7.001.820	0,46
Sumitomo Mitsui Banking Corp	0,000%	11/04/2016-10/06/2016	USD	11.000.000	10.997.536	0,71
Total Japan					17.999.356	1,17
Luxemburg						
Nestle Finance International Ltd	0,000%	28/10/2016	USD	10.800.000	10.797.041	0,70
Total Luxemburg					10.797.041	0,70
Neuseeland						
BNZ International Funding Ltd	0,000%	11/03/2016	USD	3.000.000	2.998.740	0,20
Total Neuseeland					2.998.740	0,20
Norwegen						
DNB Bank ASA	0,750%	12/08/2016	USD	6.000.000	6.002.076	0,39
DNB Bank ASA	0,000%	10/03/2016-17/11/2016	USD	18.000.000	17.993.002	1,17
Total Norwegen					23.995.078	1,56
Singapur						
DBS Bank Ltd	0,000%	10/06/2016-28/11/2016	USD	24.000.000	23.993.102	1,56
Oversea-Chinese Banking Corp Ltd	0,000%	12/12/2016	USD	4.000.000	3.995.328	0,26
United Overseas Bank Ltd	0,000%	10/04/2016-17/10/2016	USD	26.000.000	25.997.085	1,70
Total Singapur					53.985.515	3,52
Schweden						
Nordea Bank AB	0,000%	12/02/2016-21/12/2016	USD	24.700.000	24.673.558	1,61
Skandinaviska Enskilda Banken AB	0,000%	11/03/2016-12/07/2016	USD	23.000.000	22.987.749	1,50
Swedbank New York	0,370%	10/06/2016	USD	24.000.000	24.000.000	1,56
Total Schweden					71.661.307	4,67
Vereinigtes Königreich						
ANZ New Zealand Int'l Ltd	0,000%	17/10/2016	USD	5.000.000	4.998.650	0,33
ASB Finance Ltd	0,000%	14/10/2016-16/12/2016	USD	20.000.000	19.987.992	1,30
Total Vereinigtes Königreich					24.986.642	1,63
Vereinigte Staaten						
Albion Capital LLC	0,000%	17/10/2016-25/10/2016	USD	26.000.000	25.993.853	1,70
American Honda Finance Corp	0,000%	28/11/2016	USD	16.750.000	16.735.829	1,09
Atlantic Asset Securitization LLC	0,000%	17/10/2016-10/11/2016	USD	21.000.000	20.995.221	1,36
Bank of Montreal	0,660%	10/03/2016	USD	8.000.000	8.000.176	0,52
Bank of Montreal	1,110%	02/03/2017	USD	8.000.000	8.004.784	0,52
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd	0,630%	10/03/2016	USD	11.500.000	11.500.218	0,75
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd	0,830%	12/01/2016	USD	10.000.000	10.001.830	0,65
Bank of Tokyo-Mitsubishi UFJ Ltd	0,850%	01/03/2017	USD	10.000.000	9.999.520	0,65
Barton Capital LLC	0,000%	10/06/2016-17/10/2016	USD	27.072.000	27.068.265	1,77
BMW US Capital LLC	0,000%	21/10/2016-21/11/2016	USD	26.000.000	25.985.898	1,70
Caterpillar Financial Services Corp	0,000%	11/07/2016-16/11/2016	USD	26.000.000	25.986.814	1,69
DZ Bank AG Deutsche Zentral-Genossenschaftsbank	0,750%	10/05/2016	USD	7.000.000	7.000.259	0,46
Fairway Finance Co LLC	0,000%	10/12/2016	USD	9.000.000	8.998.542	0,59
Fairway Finance LLC	0,000%	28/11/2016	USD	3.000.000	2.996.346	0,19
Gotham Funding Corp	0,000%	10/06/2016-15/12/2016	USD	27.000.000	26.985.764	1,76
Liberty Street Funding LLC	0,000%	12/07/2016-12/12/2016	USD	25.000.000	24.960.261	1,62
LMA Americas LLC	0,000%	10/06/2016-24/10/2016	USD	25.950.000	25.943.852	1,69
Manhattan Asset Funding Co LLC	0,000%	11/02/2016-12/12/2016	USD	24.000.000	23.983.844	1,56
Microsoft Corp	0,000%	17/01/2017	USD	27.000.000	26.943.759	1,75
Mizuho Bank Ltd	0,900%	12/01/2016	USD	9.000.000	9.003.879	0,59
Mizuho Bank Ltd	0,000%	11/01/2016-18/11/2016	USD	16.000.000	15.989.901	1,05
Novartis Finance Corp	0,000%	11/01/2016-24/10/2016	USD	24.000.000	23.991.497	1,56
Old Line Funding LLC	0,000%	12/12/2016-01/04/2017	USD	24.000.000	23.944.262	1,55
Roche Holdings Inc	0,000%	17/10/2016	USD	10.000.000	9.998.080	0,65
Royal Bank of Canada	0,770%	12/01/2016	USD	7.500.000	7.501.710	0,49
Royal Bank of Canada	0,840%	01/03/2017	USD	7.500.000	7.499.332	0,49
Starbird Funding Corp	0,000%	11/01/2016-17/10/2016	USD	25.000.000	24.987.526	1,62
Sumitomo Mitsui Banking Corp	0,900%	30/11/2016	USD	8.000.000	8.003.352	0,52
Svenska Handelsbanken	0,000%	20/03/2017	USD	12.000.000	11.932.848	0,78
Thunder Bay Funding LLC	0,000%	12/05/2016-15/12/2016	USD	22.500.000	22.474.147	1,46
Toronto Dominion Holding USA	0,000%	11/01/2016	USD	22.000.000	21.990.628	1,43
Toyota Motor Credit Corp	0,000%	28/11/2016-01/05/2017	USD	17.000.000	16.973.637	1,10
Victory Receivables Corp	0,000%	11/02/2016-12/08/2016	USD	14.000.000	13.990.390	0,91
Wal-Mart Stores Inc	0,000%	24/10/2016	USD	25.000.000	24.993.375	1,63

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Anlagen	Kupon	Fälligkeits-datum	Währung	Anzahl/Nominal-wert	Markt-wert in USD	% des Netto-vermögens
Working Capital Management Co	0,000%	12/01/2016-10/06/2016	USD	25.000.000	24.981.704	1,63
Total Vereinigte Staaten					606.341.303	39,48
Total kurzfristige Anlagen					910.221.982	59,27
Total Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zur amtlichen Notierung an einer Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden					910.773.299	59,31
Total Anlagen (Gesamtkosten: \$910.659.637)					910.773.299	59,31
Sonstige Vermögenswerte/(Verbindlichkeiten)					624.904.423	40,69
					1.535.677.722	100,00

Derivate

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Zentral abgewickelte Zinsswaps

Gegenpartei	Währung	Geleistete Zahlungen	Erhaltene Zahlungen	Nominal-betrag	Kosten	Fälligkeits-datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust in USD	% des Netto-vermögens
Citigroup Global Markets Inc.	USD	1,75%	US0003M INDEX	67.300.000	1.874.789	15/03/2027	1.812.359	0,12
Citigroup Global Markets Inc.	USD	1,75%	US0003M INDEX	378.580.000	(7.953.747)	15/03/2027	(10.194.991)	(0,67)
							(8.382.632)	(0,55)

Total Zinsswaps

Börsengehandelte Futures

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeits-datum	Nicht realisierter% des Netto-Wertzuwachs/-verlust in USD
Amsterdam Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	3.471.332	(39)	21/10/2016	(38.974) (0,00)
Amsterdam Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	35.393.800	(399)	21/10/2016	(533.908) (0,04)
Amsterdam Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	1.508.760	(17)	21/10/2016	(21.903) (0,00)
Amsterdam Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	2.415.582	(27)	21/10/2016	(13.135) (0,00)
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(9.143.458)	35	16/12/2016	(69.802) (0,00)
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(23.285.640)	90	16/12/2016	73.966 0,00
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(23.654.671)	91	16/12/2016	(48.855) (0,00)
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(4.784.357)	18	16/12/2016	(127.824) (0,01)
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(1.036.480)	4	16/12/2016	1.536 0,00
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(1.562.565)	6	16/12/2016	(6.491) (0,00)
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(3.101.700)	12	16/12/2016	13.283 0,00
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(7.263.018)	28	16/12/2016	2.166 0,00
Dax Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	(39.595.879)	152	16/12/2016	(176.638) (0,01)
Euro Stoxx 50 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	596.301	(20)	16/12/2016	4.149 0,00
Euro Stoxx 50 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	1.075.420	(36)	16/12/2016	9.797 0,00
Euro Stoxx 50 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	2.299.422	(76)	16/12/2016	53.292 0,00
Euro Stoxx 50 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	36.611.523	(1.227)	16/12/2016	286.417 0,02
Euro Stoxx 50 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	414.773	(14)	16/12/2016	(52) (0,00)
Euro Stoxx 50 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	37.267.958	(1.258)	16/12/2016	(7.378) (0,00)
Euro Stoxx 50 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	24.461.456	(629)	16/12/2016	(114.129) (0,01)
Euro Stoxx 50 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	85.252.341	(2.838)	16/12/2016	1.302.994 0,08
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(4.331.561)	65	16/12/2016	149.033 0,01
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(13.042.514)	196	16/12/2016	473.815 0,03
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(29.385.274)	441	16/12/2016	1.014.636 0,07
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(19.578.502)	294	16/12/2016	691.593 0,04
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(598.288)	9	16/12/2016	22.539 0,00
FTSE 100 Index Futures	Barclays Capital Inc.	GBP	(20.075.182)	297	16/12/2016	313.096 0,02
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	2.264.498	(5)	15/12/2016	(3.198) (0,00)
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	40.508.064	(89)	15/12/2016	(42.442) (0,00)
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	455.195	(1)	15/12/2016	(473) (0,00)
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	20.874.370	(44)	15/12/2016	40.438 0,00
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	114.697.631	(246)	15/12/2016	80.554 0,00
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	51.110.381	(109)	15/12/2016	56.632 0,00
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	1.860.253	(4)	15/12/2016	966 0,00
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	15.114.436	(33)	15/12/2016	(8.885) (0,00)
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	1.354.539	(3)	15/12/2016	(2.220) (0,00)
FTSE/JSE TOP 40 Futures	Barclays Capital Inc.	ZAR	459.780	(1)	15/12/2016	(141) (0,00)
Hang Seng Index Futures	Barclays Capital Inc.	HKD	(212.494.942)	181	28/10/2016	(195.031) (0,01)
Hang Seng Index Futures	Barclays Capital Inc.	HKD	(298.023.191)	254	28/10/2016	(251.234) (0,02)
Hang Seng Index Futures	Barclays Capital Inc.	HKD	(125.703.921)	107	28/10/2016	(126.304) (0,01)
IBEX 35 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	4.928.304	(56)	21/10/2016	81.318 0,01
IBEX 35 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	522.710	(6)	21/10/2016	2.746 0,00
IBEX 35 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	4.214.891	(48)	21/10/2016	59.198 0,00
IBEX 35 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	8.567.244	(97)	21/10/2016	175.288 0,01
IBEX 35 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	3.732.470	(43)	21/10/2016	4.417 0,00
IBEX 35 Index Futures	Barclays Capital Inc.	EUR	4.662.799	(53)	21/10/2016	75.293 0,00
KOSPI 200 Index Futures	Barclays Capital Inc.	KRW	(6.402.795.308)	49	12/08/2016	(69.819) (0,00)
KOSPI 200 Index Futures	Barclays Capital Inc.	KRW	(6.382.200.608)	49	12/08/2016	(51.120) (0,00)
KOSPI 200 Index Futures	Barclays Capital Inc.	KRW	(6.566.990.675)	50	12/08/2016	(101.685) (0,01)
MSCI Taiwan Index Futures	Barclays Capital Inc.	USD	(3.680.473)	106	28/10/2016	(56.453) (0,00)
MSCI Taiwan Index Futures	Barclays Capital Inc.	USD	(891.347)	26	28/10/2016	(2.927) (0,00)
OMXS30 Index Futures	Barclays Capital Inc.	SEK	346.753.589	(2.447)	21/10/2016	(304.565) (0,02)
OMXS30 Index Futures	Barclays Capital Inc.	SEK	197.465.912	(1.398)	21/10/2016	(248.315) (0,02)
OMXS30 Index Futures	Barclays Capital Inc.	SEK	161.169.703	(1.141)	21/10/2016	(202.114) (0,01)
TOPIX Index Futures	Barclays Capital Inc.	JPY	978.200.000	(73)	12/08/2016	122.550 0,01
TOPIX Index Futures	Barclays Capital Inc.	JPY	974.550.000	(73)	12/08/2016	86.506 0,01
TOPIX Index Futures	Barclays Capital Inc.	JPY	970.900.000	(73)	12/08/2016	50.462 0,00
10 Year Australian Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	83.474.893	(616)	15/12/2016	(709.891) (0,05)
10 Year Australian Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	82.192.604	(606)	15/12/2016	(642.606) (0,04)
10 Year Australian Treasury Bond Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	66.668.466	(495)	15/12/2016	(884.058) (0,06)
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	26.675.756	(182)	19/12/2016	(130.484) (0,01)
10 Year Canadian Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	508.116.316	(3.467)	19/12/2016	(2.517.814) (0,16)
10 Year Japan Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	JPY	10.307.828.572	(68)	13/12/2016	(506.507) (0,03)
10 Year Japan Treasury Bonds Futures	J.P. Morgan Securities PLC	JPY	2.123.800.000	(14)	13/12/2016	(88.481) (0,01)
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(18.910.933)	145	20/12/2016	154.302 0,01

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Börsengehandelte Futures (Fortsetzung)

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeits-datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust in USD des Netto-vermögens
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(28.416.829)	217	20/12/2016	115.281 0,01
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(35.448.373)	270	20/12/2016	52.410 0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(10.109.441)	77	20/12/2016	14.856 0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(110.640.437)	843	20/12/2016	200.895 0,01
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(467.671.078)	3.563	20/12/2016	807.768 0,05
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(25.103.579)	191	20/12/2016	9.938 0,00
10 Year US Treasury Note (CBT) Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(53.924.110)	410	20/12/2016	(15.514) (0,00)
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	15.050.582	(60)	13/03/2017	3.735 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	15.053.401	(60)	19/06/2017	3.532 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	14.046.552	(56)	13/03/2017	2.748 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	14.049.299	(56)	19/06/2017	2.689 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	9.283.622	(37)	18/09/2017	879 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	752.492	(3)	13/03/2017	145 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	752.630	(3)	19/06/2017	132 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	23.074.750	(92)	13/03/2017	2.578 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	23.079.353	(92)	19/06/2017	2.582 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	23.083.430	(92)	18/09/2017	1.996 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	17.558.632	(70)	13/03/2017	3.931 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	17.562.155	(70)	19/06/2017	3.957 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	12.546.097	(50)	18/09/2017	1.930 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	10.789.612	(43)	18/09/2017	1.624 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	6.772.995	(27)	13/03/2017	1.942 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	6.774.325	(27)	19/06/2017	1.919 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	2.007.498	(8)	18/09/2017	446 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	5.016.304	(20)	13/03/2017	621 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	5.017.436	(20)	19/06/2017	769 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	752.761	(3)	18/09/2017	110 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	16.057.866	(64)	18/09/2017	1.195 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	9.283.580	(37)	18/09/2017	832 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	21.570.275	(86)	13/03/2017	2.858 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	21.574.872	(86)	19/06/2017	3.192 0,00
3 Month Euro EURIBOR Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	20.073.390	(80)	18/09/2017	2.679 0,00
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	33.856.154	(34)	06/08/2017	(6.564) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	32.859.346	(33)	06/08/2017	(7.167) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	16.929.869	(17)	06/08/2017	(1.910) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	38.845.246	(39)	09/07/2017	(1.145) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	27.885.596	(28)	09/07/2017	(3.348) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	31.869.058	(32)	09/07/2017	(3.975) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	996.107	(1)	06/08/2017	66 0,00
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	23.892.923	(24)	03/09/2017	(7.077) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	51.767.325	(52)	03/09/2017	(15.848) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	58.734.968	(59)	03/09/2017	(18.775) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	58.739.240	(59)	03/09/2017	(15.504) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	144.359.940	(145)	03/09/2017	(37.498) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	17.923.090	(18)	06/08/2017	(4.054) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	30.868.278	(31)	06/08/2017	(6.420) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	36.846.464	(37)	06/08/2017	(4.844) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	33.858.113	(34)	06/08/2017	(5.064) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	34.853.552	(35)	06/08/2017	(5.510) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	31.865.429	(32)	06/08/2017	(5.555) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	32.858.452	(33)	06/08/2017	(7.851) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	33.853.655	(34)	06/08/2017	(8.477) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	35.854.689	(36)	09/07/2017	(2.941) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	39.838.078	(40)	09/07/2017	(3.625) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	33.881.400	(34)	09/07/2017	(3.821) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	7.966.663	(8)	03/09/2017	(555) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	7.967.121	(8)	06/08/2017	(804) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	10.954.841	(11)	03/09/2017	(243) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	10.955.379	(11)	06/08/2017	(655) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	8.964.931	(9)	09/07/2017	229 0,00
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	24.898.966	(25)	09/07/2017	(2.123) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	24.898.043	(25)	09/07/2017	(2.844) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	29.876.239	(30)	09/07/2017	(4.495) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	34.858.766	(35)	09/07/2017	(2.829) (0,00)
90-DAY Australian Bank Bill Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	24.898.709	(25)	09/07/2017	(2.334) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(24.262.325)	98	13/03/2017	6.150 0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(24.254.442)	98	19/06/2017	6.683 0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(112.572.604)	455	18/09/2017	28.521 0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(15.591.887)	63	13/03/2017	9.276 0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(15.585.983)	63	19/06/2017	10.454 0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(15.580.258)	63	18/09/2017	10.667 0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(5.445.575)	22	13/03/2017	2.450 0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(10.904.510)	44	13/03/2017	(8.460) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(10.899.590)	44	19/06/2017	(6.840) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.735.937)	7	13/03/2017	(2.475) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.735.262)	7	19/06/2017	(2.324) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(743.539)	3	19/06/2017	(852) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(743.858)	3	13/03/2017	(946) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(247.882)	1	13/03/2017	(244) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(247.764)	1	19/06/2017	(202) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(72.625.528)	293	13/03/2017	(67.740) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(72.589.319)	293	19/06/2017	(53.507) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(12.166.801)	49	13/03/2017	(32.563) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(12.162.874)	49	19/06/2017	(32.311) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(14.399.714)	58	13/03/2017	(36.739) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(14.394.310)	58	19/06/2017	(35.685) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(11.666.709)	47	13/03/2017	(27.746) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(11.662.523)	47	19/06/2017	(27.086) (0,00)
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(5.443.426)	22	19/06/2017	2.949 0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(5.441.542)	22	18/09/2017	2.908 0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.237.961)	5	13/03/2017	226 0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.237.511)	5	19/06/2017	301 0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(1.237.063)	5	18/09/2017	313 0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.961.973)	16	13/03/2017	227 0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Börsengehandelte Futures (Fortsetzung)

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeits-datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust in USD des Netto-vermögens
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(3.960.110)	16	19/06/2017	890 0,00
90-DAY Euro Dollar Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(39.847.297)	161	18/09/2017	(3.822) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	124.604	(1)	15/03/2017	(44) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	12.583.873	(101)	21/06/2017	(9.141) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	14.451.061	(116)	21/06/2017	(12.713) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	1.868.835	(15)	15/03/2017	(945) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	124.609	(1)	21/12/2016	45 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	124.600	(1)	15/03/2017	(49) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	12.584.024	(101)	21/06/2017	(8.945) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	3.239.361	(26)	21/12/2016	533 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	3.239.342	(26)	15/03/2017	(1.601) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	11.959.626	(96)	21/06/2017	(10.355) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	1.370.952	(11)	15/03/2017	(78) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	1.371.088	(11)	21/06/2017	(259) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	374.040	(3)	20/09/2017	19 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	3.240.176	(26)	15/03/2017	(518) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	2.735.411	(22)	15/03/2017	(8.589) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	7.336.801	(59)	15/03/2017	(21.831) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	6.091.467	(49)	15/03/2017	(20.479) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	3.105.856	(25)	15/03/2017	(13.092) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	3.105.169	(25)	15/03/2017	(13.984) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	6.726.051	(54)	15/03/2017	(5.680) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	15.191.591	(122)	15/03/2017	(18.420) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	5.104.864	(41)	15/03/2017	(6.849) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	1.245.172	(10)	15/03/2017	(1.562) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	1.370.842	(11)	15/03/2017	(222) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	997.160	(8)	15/03/2017	79 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	1.744.760	(14)	15/03/2017	(214) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	1.993.827	(16)	15/03/2017	(484) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	2.866.860	(23)	15/03/2017	257 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	2.866.315	(23)	15/03/2017	(452) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	3.862.704	(31)	21/06/2017	(2.381) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	12.461.132	(100)	21/06/2017	(6.646) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	11.841.372	(95)	20/09/2017	(3.575) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	2.617.248	(21)	15/03/2017	(182) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	2.617.354	(21)	21/06/2017	(725) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	12.962.138	(104)	20/09/2017	(5.275) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	1.371.499	(11)	20/09/2017	96 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	7.108.103	(57)	20/09/2017	2.114 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	1.246.703	(10)	20/09/2017	(61) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	3.863.632	(31)	15/03/2017	(170) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	3.864.090	(31)	21/06/2017	(581) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	14.335.090	(115)	20/09/2017	(3.292) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	1.371.451	(11)	20/09/2017	34 0,00
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	3.240.250	(26)	21/06/2017	(1.266) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	13.833.451	(111)	20/09/2017	(7.109) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	3.115.546	(25)	15/03/2017	(508) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	3.115.707	(25)	21/06/2017	(1.111) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	13.584.456	(109)	20/09/2017	(6.647) (0,00)
90-DAY Sterling Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	748.162	(6)	20/09/2017	146 0,00
CAC 40 Euro Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	(80.030.663)	1.803	21/10/2016	(540.637) (0,04)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(2.231.466)	9	13/03/2017	(623) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(2.231.844)	9	19/06/2017	(825) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(743.919)	3	18/09/2017	(224) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(4.214.786)	17	13/03/2017	(1.019) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(4.215.259)	17	19/06/2017	(1.218) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(2.727.312)	11	18/09/2017	(524) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(4.706.950)	19	13/03/2017	1.678 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(4.706.375)	19	19/06/2017	2.298 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(3.220.216)	13	18/09/2017	1.647 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(3.715.067)	15	18/09/2017	2.333 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	495.666	(2)	19/12/2016	50 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	6.690.952	(27)	19/12/2016	268 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	2.230.610	(9)	19/12/2016	313 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(5.696.348)	23	18/09/2017	3.644 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(495.422)	2	13/03/2017	212 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(495.401)	2	19/06/2017	247 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(3.467.597)	14	18/09/2017	2.023 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(2.972.571)	12	18/09/2017	1.471 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(1.486.633)	6	13/03/2017	356 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(1.486.622)	6	19/06/2017	422 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(1.239.682)	5	13/03/2017	(329) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(1.239.818)	5	19/06/2017	(385) (0,00)
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(4.707.489)	19	13/03/2017	1.267 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(4.707.380)	19	19/06/2017	1.531 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(3.220.537)	13	18/09/2017	1.402 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(27.252.461)	110	13/03/2017	8.420 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(27.252.001)	110	19/06/2017	9.820 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(25.762.931)	104	18/09/2017	12.257 0,00
Canadian Bank Accept Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(4.210.104)	17	18/09/2017	2.877 0,00
Euro-Bund Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	303.541.359	(1.843)	12/08/2016	(2.500.583) (0,16)
FTSE KLCI Futures	J.P. Morgan Securities PLC	MYR	(83.183)	1	31/10/2016	(117) (0,00)
FTSE KLCI Futures	J.P. Morgan Securities PLC	MYR	(18.606.041)	222	31/10/2016	(59.640) (0,00)
FTSE/MIB Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	EUR	29.074.129	(350)	16/12/2016	860.754 0,06
KOSPI 200 Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	KRW	(1.698.685.846)	13	12/08/2016	(18.510) (0,00)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(36.899.813)	287	28/12/2016	871.825 0,06
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(29.701.255)	229	28/12/2016	359.888 0,02
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(42.783.018)	326	28/12/2016	(138.116) (0,01)
Long Gilt Futures	J.P. Morgan Securities PLC	GBP	(73.547.100)	561	28/12/2016	(138.418) (0,01)
MEX BOLSA Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	MXN	(32.481.626)	70	16/12/2016	43.531 0,00
MEX BOLSA Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	MXN	(947.733)	2	16/12/2016	230 0,00
MSCI Singapore Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	SGD	17.810.918	(571)	28/10/2016	(135.070) (0,01)
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	2.378.298	(22)	16/12/2016	11.098 0,00
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	5.732.524	(54)	16/12/2016	(77.876) (0,01)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Börsengehandelte Futures (Fortsetzung)

Beschreibung	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Anzahl Kontrakte	Fälligkeits-datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust in USD	% des Netto-vermögens
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	36.522.151	(344)	16/12/2016	(492.249)	(0,03)
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	7.807.888	(72)	16/12/2016	60.688	0,00
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	12.213.565	(114)	16/12/2016	(52.835)	(0,00)
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	3.012.590	(28)	16/12/2016	(210)	(0,00)
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	2.430.295	(23)	16/12/2016	(44.505)	(0,00)
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	4.079.631	(38)	16/12/2016	(9.169)	(0,00)
S&P 500 E Mini Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	8.830.166	(82)	16/12/2016	6.966	0,00
S&P TSX 60 Index Futures	J.P. Morgan Securities PLC	CAD	(51.216.295)	300	15/12/2016	205.725	0,01
SET50 Futures	J.P. Morgan Securities PLC	THB	(25.304.952)	133	29/12/2016	(4.617)	(0,00)
SET50 Futures	J.P. Morgan Securities PLC	THB	(159.813.582)	840	29/12/2016	(28.952)	(0,00)
SGX Nifty 50 Futures	J.P. Morgan Securities PLC	USD	(2.637.642)	150	27/10/2016	(42.342)	(0,00)
SPI 200 Futures	J.P. Morgan Securities PLC	AUD	(97.107.850)	749	15/12/2016	3.297.679	0,21
Total Futures						(830.091)	(0,05)

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust in USD	% des Netto-vermögens
Citibank, N.A.	AUD	9.425.200	USD	7.200.880	21/12/2016	3.366	0,00
Citibank, N.A.	AUD	10.819.186	USD	8.164.751	21/12/2016	105.002	0,01
Citibank, N.A.	AUD	10.819.186	USD	8.148.555	21/12/2016	121.198	0,01
Citibank, N.A.	AUD	12.034.400	USD	9.076.848	21/12/2016	121.766	0,01
Citibank, N.A.	AUD	12.049.703	USD	9.071.894	21/12/2016	138.417	0,01
Citibank, N.A.	AUD	15.527.925	USD	11.669.722	21/12/2016	199.202	0,01
Citibank, N.A.	BRL	40.000	USD	11.834	21/12/2016*	193	0,00
Citibank, N.A.	BRL	80.000	USD	23.314	21/12/2016*	739	0,00
Citibank, N.A.	BRL	400.000	USD	120.609	21/12/2016*	(345)	(0,00)
Citibank, N.A.	BRL	400.000	USD	120.773	21/12/2016*	(510)	(0,00)
Citibank, N.A.	BRL	400.000	USD	120.458	21/12/2016*	(194)	(0,00)
Citibank, N.A.	BRL	1.160.000	USD	342.892	21/12/2016*	5.873	0,00
Citibank, N.A.	BRL	1.200.000	USD	362.266	21/12/2016*	(1.475)	(0,00)
Citibank, N.A.	BRL	2.280.000	USD	678.500	21/12/2016*	7.003	0,00
Citibank, N.A.	BRL	3.960.000	USD	1.158.140	21/12/2016*	32.470	0,00
Citibank, N.A.	BRL	5.512.632	USD	1.618.156	21/12/2016*	39.268	0,00
Citibank, N.A.	BRL	6.402.524	USD	1.886.320	21/12/2016*	38.658	0,00
Citibank, N.A.	BRL	7.080.000	USD	2.104.530	21/12/2016*	24.137	0,00
Citibank, N.A.	BRL	7.293.515	USD	2.176.147	21/12/2016*	16.716	0,00
Citibank, N.A.	BRL	7.387.918	USD	2.195.400	21/12/2016*	25.846	0,00
Citibank, N.A.	BRL	7.680.000	USD	2.295.141	21/12/2016*	13.922	0,00
Citibank, N.A.	BRL	8.240.000	USD	2.466.774	21/12/2016*	10.659	0,00
Citibank, N.A.	BRL	8.320.000	USD	2.508.284	21/12/2016*	(6.799)	(0,00)
Citibank, N.A.	BRL	8.560.000	USD	2.547.866	21/12/2016*	25.777	0,00
Citibank, N.A.	BRL	9.055.764	USD	2.710.911	21/12/2016*	11.788	0,00
Citibank, N.A.	BRL	9.423.072	USD	2.865.342	21/12/2016*	(32.208)	(0,00)
Citibank, N.A.	BRL	10.000.000	USD	2.982.415	21/12/2016*	24.178	0,00
Citibank, N.A.	BRL	13.304.575	USD	3.955.057	21/12/2016*	45.086	0,00
Citibank, N.A.	CAD	2.193.600	USD	1.702.220	21/12/2016	(27.979)	(0,00)
Citibank, N.A.	CAD	2.679.600	USD	2.034.168	21/12/2016	11.006	0,00
Citibank, N.A.	CAD	5.597.089	USD	4.276.177	21/12/2016	(4.262)	(0,00)
Citibank, N.A.	CAD	6.702.536	USD	5.128.791	21/12/2016	(13.156)	(0,00)
Citibank, N.A.	CAD	10.763.940	USD	8.342.877	21/12/2016	(127.420)	(0,01)
Citibank, N.A.	CAD	11.066.499	USD	8.581.807	21/12/2016	(135.425)	(0,01)
Citibank, N.A.	CAD	11.174.486	USD	8.582.234	21/12/2016	(53.432)	(0,00)
Citibank, N.A.	CAD	20.164.620	USD	15.390.078	21/12/2016	343	0,00
Citibank, N.A.	CAD	22.094.830	USD	17.163.764	21/12/2016	(300.131)	(0,02)
Citibank, N.A.	CNH	256.800	USD	38.151	21/12/2016	138	0,00
Citibank, N.A.	CNH	1.177.000	USD	175.219	21/12/2016	269	0,00
Citibank, N.A.	CNH	1.983.000	USD	294.581	21/12/2016	1.079	0,00
Citibank, N.A.	CNH	39.856.400	USD	5.916.507	21/12/2016	25.991	0,00
Citibank, N.A.	EUR	825.000	USD	927.539	21/12/2016	619	0,00
Citibank, N.A.	EUR	1.718.794	USD	1.924.214	21/12/2016	9.499	0,00
Citibank, N.A.	EUR	1.768.439	USD	2.000.766	21/12/2016	(11.201)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	2.264.901	USD	2.539.281	21/12/2016	8.825	0,00
Citibank, N.A.	EUR	3.484.463	USD	3.905.993	21/12/2016	14.169	0,00
Citibank, N.A.	EUR	4.244.251	USD	4.801.094	21/12/2016	(26.139)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	5.508.352	USD	6.223.863	21/12/2016	(26.744)	(0,00)
Citibank, N.A.	HKD	442.000	USD	57.044	21/12/2016	3	0,00
Citibank, N.A.	HKD	1.060.000	USD	136.796	21/12/2016	13	0,00
Citibank, N.A.	HKD	1.883.000	USD	243.031	21/12/2016	(1)	0,00
Citibank, N.A.	HKD	2.084.000	USD	268.924	21/12/2016	48	0,00
Citibank, N.A.	HKD	2.253.000	USD	290.843	21/12/2016	(59)	(0,00)
Citibank, N.A.	HKD	2.398.000	USD	309.454	21/12/2016	45	0,00
Citibank, N.A.	HKD	2.708.800	USD	349.585	21/12/2016	27	0,00
Citibank, N.A.	HKD	4.729.000	USD	610.405	21/12/2016	(54)	(0,00)
Citibank, N.A.	HKD	8.350.000	USD	1.077.693	21/12/2016	5	0,00
Citibank, N.A.	HKD	9.683.000	USD	1.249.933	21/12/2016	(192)	(0,00)
Citibank, N.A.	HUF	133.723.293	USD	490.253	21/12/2016	(6.081)	(0,00)
Citibank, N.A.	HUF	227.397.325	USD	822.134	21/12/2016	1.202	0,00
Citibank, N.A.	HUF	286.823.999	USD	1.034.573	21/12/2016	3.929	0,00
Citibank, N.A.	HUF	315.255.383	USD	1.140.219	21/12/2016	1.225	0,00
Citibank, N.A.	INR	97.923.235	USD	1.454.977	21/12/2016*	(1.352)	(0,00)
Citibank, N.A.	INR	123.553.790	USD	1.810.196	21/12/2016*	23.912	0,00
Citibank, N.A.	INR	136.119.394	USD	2.003.925	21/12/2016*	16.704	0,00
Citibank, N.A.	INR	147.570.838	USD	2.177.613	21/12/2016*	13.008	0,00
Citibank, N.A.	INR	198.032.743	USD	2.903.504	21/12/2016*	36.200	0,00
Citibank, N.A.	JPY	291.820.117	USD	2.849.455	21/12/2016	42.367	0,00
Citibank, N.A.	JPY	295.006.641	USD	2.913.657	21/12/2016	9.742	0,00
Citibank, N.A.	JPY	299.277.446	USD	2.994.882	21/12/2016	(29.161)	(0,00)
Citibank, N.A.	JPY	505.417.200	USD	4.986.130	21/12/2016	22.354	0,00
Citibank, N.A.	JPY	563.698.998	USD	5.526.931	21/12/2016	59.102	0,00
Citibank, N.A.	JPY	590.061.700	USD	5.817.650	21/12/2016	29.627	0,00
Citibank, N.A.	JPY	591.181.538	USD	5.815.218	21/12/2016	43.157	0,00
Citibank, N.A.	JPY	596.682.341	USD	5.813.883	21/12/2016	99.003	0,01
Citibank, N.A.	JPY	601.131.589	USD	5.823.524	21/12/2016	133.452	0,01
Citibank, N.A.	JPY	619.535.600	USD	6.114.485	21/12/2016	24.867	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Citibank, N.A.	JPY	890.755.121	USD	8.653.012	21/12/2016	174.018	0,01
Citibank, N.A.	JPY	921.508.752	USD	9.094.109	21/12/2016	37.677	0,00
Citibank, N.A.	JPY	1.108.173.757	USD	10.947.971	21/12/2016	33.591	0,00
Citibank, N.A.	MXN	2.800.000	USD	141.358	21/12/2016	1.605	0,00
Citibank, N.A.	MXN	13.600.000	USD	687.914	21/12/2016	6.476	0,00
Citibank, N.A.	MXN	59.015.304	USD	3.106.326	21/12/2016	(93.120)	(0,01)
Citibank, N.A.	MXN	59.752.696	USD	3.133.922	21/12/2016	(83.066)	(0,00)
Citibank, N.A.	MXN	65.200.000	USD	3.259.360	21/12/2016	69.624	0,01
Citibank, N.A.	NOK	4.633.200	USD	567.067	21/12/2016	12.441	0,00
Citibank, N.A.	NOK	8.771.600	USD	1.059.837	21/12/2016	37.289	0,00
Citibank, N.A.	NOK	33.194.800	USD	4.078.815	21/12/2016	73.096	0,01
Citibank, N.A.	NZD	1.438.838	USD	1.034.694	21/12/2016	9.638	0,00
Citibank, N.A.	NZD	1.438.909	USD	1.046.451	21/12/2016	(2.067)	(0,00)
Citibank, N.A.	NZD	1.721.332	USD	1.271.006	21/12/2016	(21.636)	(0,00)
Citibank, N.A.	NZD	2.767.777	USD	1.997.872	21/12/2016	11.025	0,00
Citibank, N.A.	NZD	3.637.430	USD	2.626.099	21/12/2016	14.005	0,00
Citibank, N.A.	NZD	3.700.376	USD	2.750.637	21/12/2016	(64.845)	(0,00)
Citibank, N.A.	NZD	4.212.538	USD	3.099.042	21/12/2016	(41.515)	(0,00)
Citibank, N.A.	PLN	10.000	USD	2.597	21/12/2016	4	0,00
Citibank, N.A.	PLN	54.000	USD	13.970	21/12/2016	74	0,00
Citibank, N.A.	PLN	106.000	USD	27.711	21/12/2016	(143)	(0,00)
Citibank, N.A.	PLN	980.575	USD	249.660	21/12/2016	5.364	0,00
Citibank, N.A.	PLN	1.691.686	USD	434.157	21/12/2016	5.811	0,00
Citibank, N.A.	PLN	1.759.339	USD	457.508	21/12/2016	56	0,00
Citibank, N.A.	PLN	2.031.185	USD	522.768	21/12/2016	5.496	0,00
Citibank, N.A.	PLN	2.393.216	USD	614.561	21/12/2016	7.859	0,00
Citibank, N.A.	PLN	3.386.729	USD	878.088	21/12/2016	2.722	0,00
Citibank, N.A.	PLN	7.245.270	USD	1.890.294	21/12/2016	(5.968)	(0,00)
Citibank, N.A.	TRY	1.200.000	USD	395.658	21/12/2016	(2.075)	(0,00)
Citibank, N.A.	TRY	1.771.593	USD	584.860	21/12/2016	(3.802)	(0,00)
Citibank, N.A.	TRY	3.690.820	USD	1.219.465	21/12/2016	(8.927)	(0,00)
Citibank, N.A.	TRY	10.425.771	USD	3.468.805	21/12/2016	(49.296)	(0,00)
Citibank, N.A.	TRY	11.870.228	USD	3.963.326	21/12/2016	(70.055)	(0,00)
Citibank, N.A.	TRY	15.095.215	USD	5.025.014	21/12/2016	(73.992)	(0,00)
Citibank, N.A.	TRY	19.743.173	USD	6.530.133	21/12/2016	(54.645)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	121.029	BRL	400.000	21/12/2016*	765	0,00
Citibank, N.A.	USD	847.929	BRL	2.880.000	21/12/2016*	(17.970)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.735.479	CHF	1.694.000	21/12/2016	(17.706)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	4.076.222	CHF	3.965.894	21/12/2016	(28.230)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	5.528.026	CHF	5.327.600	21/12/2016	14.293	0,00
Citibank, N.A.	USD	8.095.553	CHF	7.927.236	21/12/2016	(108.641)	(0,01)
Citibank, N.A.	USD	9.040.376	CHF	8.804.673	21/12/2016	(71.911)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	12.475.809	CHF	12.096.510	21/12/2016	(43.324)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	13.519.393	CHF	13.177.600	21/12/2016	(118.600)	(0,01)
Citibank, N.A.	USD	24.361.119	CHF	23.598.109	21/12/2016	(61.450)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	25.765.127	CHF	24.824.844	21/12/2016	72.964	0,01
Citibank, N.A.	USD	35.095.357	CHF	33.837.934	21/12/2016	75.209	0,01
Citibank, N.A.	USD	148.673	CNH	999.000	21/12/2016	(276)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	234.385	CNH	1.573.000	21/12/2016	(146)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	353.675	CNH	2.378.400	21/12/2016	(939)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	2.240	EUR	2.000	21/12/2016	(10)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.687.868	EUR	1.508.000	21/12/2016	(8.693)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	32.798	GBP	24.800	21/12/2016	540	0,00
Citibank, N.A.	USD	1.665.404	GBP	1.269.200	21/12/2016	14.532	0,00
Citibank, N.A.	USD	4.482.220	GBP	3.411.600	21/12/2016	44.689	0,00
Citibank, N.A.	USD	6.085.192	GBP	4.538.800	21/12/2016	181.491	0,01
Citibank, N.A.	USD	12.130	HKD	94.000	21/12/2016	(2)	0,00
Citibank, N.A.	USD	30.147	HKD	233.600	21/12/2016	(3)	0,00
Citibank, N.A.	USD	92.457	HKD	716.400	21/12/2016	(5)	0,00
Citibank, N.A.	USD	170.891	HKD	1.324.000	21/12/2016	8	0,00
Citibank, N.A.	USD	976.448	HKD	7.565.600	21/12/2016	(10)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.016.521	HKD	7.880.000	21/12/2016	(515)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	5.995.534	HKD	46.478.800	21/12/2016	(3.277)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.179.131	HUF	328.000.000	21/12/2016	(8.458)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	2.063.782	HUF	572.000.000	21/12/2016	(7.256)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	212.223	ILS	800.000	21/12/2016	(1.031)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	265.651	ILS	1.000.000	21/12/2016	(916)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	426.670	ILS	1.600.000	21/12/2016	162	0,00
Citibank, N.A.	USD	799.468	ILS	3.000.000	21/12/2016	(233)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.587.120	ILS	6.000.000	21/12/2016	(12.282)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	2.714.801	ILS	10.204.977	21/12/2016	(5.509)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	4.765.945	ILS	17.831.970	21/12/2016	12.529	0,00
Citibank, N.A.	USD	8.416.012	ILS	31.511.053	21/12/2016	16.203	0,00
Citibank, N.A.	USD	73.179	KRW	80.000.000	21/12/2016*	576	0,00
Citibank, N.A.	USD	462.562	KRW	520.000.000	21/12/2016*	(9.358)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	2.045.847	KRW	2.280.000.000	21/12/2016*	(23.342)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	2.534.686	KRW	2.840.000.000	21/12/2016*	(42.725)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	3.599.038	KRW	3.941.573.125	21/12/2016*	21.906	0,00
Citibank, N.A.	USD	3.821.090	KRW	4.294.271.902	21/12/2016*	(76.129)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	4.976.320	KRW	5.527.468.309	21/12/2016*	(40.073)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	5.190.430	KRW	5.682.244.524	21/12/2016*	33.571	0,00
Citibank, N.A.	USD	6.600.942	KRW	7.390.442.140	21/12/2016*	(106.173)	(0,01)
Citibank, N.A.	USD	21.055	MXN	400.000	21/12/2016	632	0,00
Citibank, N.A.	USD	21.316	MXN	423.000	21/12/2016	(281)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	52.698	MXN	1.033.000	21/12/2016	(45)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	8.919.766	NOK	73.141.684	21/12/2016	(228.587)	(0,01)
Citibank, N.A.	USD	9.458.954	NOK	77.070.279	21/12/2016	(180.776)	(0,01)
Citibank, N.A.	USD	11.933.030	NOK	99.650.718	21/12/2016	(530.997)	(0,03)
Citibank, N.A.	USD	16.641.967	NOK	136.822.119	21/12/2016	(471.352)	(0,03)
Citibank, N.A.	USD	103.900	PLN	400.000	21/12/2016	(131)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	5.763	SEK	49.000	21/12/2016	37	0,00
Citibank, N.A.	USD	325.717	SEK	2.769.600	21/12/2016	2.101	0,00
Citibank, N.A.	USD	839.376	SEK	7.101.567	21/12/2016	9.588	0,00
Citibank, N.A.	USD	989.014	SEK	8.310.967	21/12/2016	17.913	0,00
Citibank, N.A.	USD	1.765.897	SEK	15.061.393	21/12/2016	6.037	0,00
Citibank, N.A.	USD	3.625.038	SEK	30.353.991	21/12/2016	78.303	0,01
Citibank, N.A.	USD	4.176.765	SEK	35.084.482	21/12/2016	77.293	0,01
Citibank, N.A.	USD	10.610.493	SEK	90.378.400	21/12/2016	50.161	0,00
Citibank, N.A.	USD	263.459	SGD	360.000	21/12/2016	(687)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	441.240	SGD	600.000	21/12/2016	995	0,00
Citibank, N.A.	USD	443.907	SGD	600.000	21/12/2016	3.663	0,00
Citibank, N.A.	USD	660.806	SGD	900.000	21/12/2016	440	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Netto-vermögens
Citibank, N.A.	USD	705.206	SGD	960.000	21/12/2016	815	0,00
Citibank, N.A.	USD	828.062	SGD	1.120.000	21/12/2016	6.273	0,00
Citibank, N.A.	USD	1.262.702	SGD	1.720.000	21/12/2016	668	0,00
Citibank, N.A.	USD	1.321.468	SGD	1.807.114	21/12/2016	(4.485)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	1.351.716	SGD	1.827.838	21/12/2016	10.558	0,00
Citibank, N.A.	USD	1.846.480	SGD	2.507.067	21/12/2016	6.943	0,00
Citibank, N.A.	USD	1.965.362	SGD	2.680.000	21/12/2016	(1.062)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	2.304.362	SGD	3.100.000	21/12/2016	29.766	0,00
Citibank, N.A.	USD	2.657.072	SGD	3.618.480	21/12/2016	2.047	0,00
Citibank, N.A.	USD	2.670.053	SGD	3.594.038	21/12/2016	32.962	0,00
Citibank, N.A.	USD	3.486.985	SGD	4.720.000	21/12/2016	23.730	0,00
Citibank, N.A.	USD	4.517.205	SGD	6.160.000	21/12/2016	(2.636)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	4.872.309	SGD	6.646.731	21/12/2016	(4.666)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	4.880.287	SGD	6.646.732	21/12/2016	3.312	0,00
Citibank, N.A.	USD	204.266	TRY	612.000	21/12/2016	3.538	0,00
Citibank, N.A.	USD	7.430.576	TWD	233.960.000	21/12/2016*	(70.911)	(0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	50.364	USD	3.534	21/12/2016	59	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	68.483	USD	4.820	21/12/2016	67	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	73.132	USD	5.042	21/12/2016	176	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	115.717	USD	7.833	21/12/2016	424	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	167.904	USD	11.554	21/12/2016	426	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	400.000	USD	27.197	21/12/2016	1.343	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	1.200.000	USD	81.695	21/12/2016	3.926	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	2.800.000	USD	196.267	21/12/2016	3.516	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	3.086.000	USD	225.580	21/12/2016	(5.391)	(0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	4.000.000	USD	270.275	21/12/2016	15.129	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	4.800.000	USD	341.322	21/12/2016	1.162	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	5.200.000	USD	374.215	21/12/2016	(3.190)	(0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	6.800.000	USD	493.947	21/12/2016	(8.761)	(0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	8.000.000	USD	575.380	21/12/2016	(4.573)	(0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	8.400.000	USD	605.954	21/12/2016	(6.606)	(0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	10.400.000	USD	757.678	21/12/2016	(15.628)	(0,00)
Citibank, N.A.	ZAR	10.800.000	USD	746.762	21/12/2016	23.828	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	11.600.000	USD	822.634	21/12/2016	5.037	0,00
Citibank, N.A.	ZAR	22.800.000	USD	1.583.856	21/12/2016	42.945	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	14.137.800	USD	10.801.333	21/12/2016	5.035	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	16.228.781	USD	12.247.143	21/12/2016	157.487	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	16.228.781	USD	12.222.849	21/12/2016	181.782	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	18.051.600	USD	13.613.845	21/12/2016	184.076	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	18.074.554	USD	13.607.858	21/12/2016	207.608	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	AUD	23.291.884	USD	17.504.603	21/12/2016	298.781	0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	60.000	USD	17.751	21/12/2016*	289	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	120.000	USD	34.970	21/12/2016*	1.109	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	600.000	USD	180.914	21/12/2016*	(518)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	600.000	USD	181.160	21/12/2016*	(765)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	600.000	USD	180.687	21/12/2016*	(291)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	1.740.000	USD	514.339	21/12/2016*	8.808	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	1.800.000	USD	543.399	21/12/2016*	(2.213)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	3.420.000	USD	1.017.752	21/12/2016*	10.503	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	5.940.000	USD	1.737.213	21/12/2016*	48.703	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	8.268.949	USD	2.427.237	21/12/2016*	58.899	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	9.603.786	USD	2.829.484	21/12/2016*	57.983	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	10.620.000	USD	3.156.799	21/12/2016*	36.202	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	10.940.274	USD	3.264.225	21/12/2016*	25.070	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	11.081.877	USD	3.293.104	21/12/2016*	38.765	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	11.520.000	USD	3.442.716	21/12/2016*	20.879	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	12.360.000	USD	3.700.165	21/12/2016*	15.983	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	12.480.000	USD	3.762.430	21/12/2016*	(10.203)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	12.840.000	USD	3.821.804	21/12/2016*	38.661	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	13.583.646	USD	4.066.371	21/12/2016*	17.677	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	14.134.607	USD	4.298.019	21/12/2016*	(48.318)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	15.000.000	USD	4.473.628	21/12/2016*	36.261	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	BRL	19.956.861	USD	5.932.593	21/12/2016*	67.622	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	3.290.400	USD	2.553.333	21/12/2016	(41.972)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	4.019.400	USD	3.051.256	21/12/2016	16.506	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	8.395.633	USD	6.414.274	21/12/2016	(6.401)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	10.053.805	USD	7.693.198	21/12/2016	(19.743)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	16.145.910	USD	12.514.332	21/12/2016	(191.146)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	16.599.749	USD	12.872.727	21/12/2016	(203.154)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	16.761.729	USD	12.873.367	21/12/2016	(80.165)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	30.246.930	USD	23.085.146	21/12/2016	486	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CAD	33.142.244	USD	25.745.677	21/12/2016	(450.229)	(0,03)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CNH	385.200	USD	57.221	21/12/2016	211	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CNH	59.784.600	USD	8.874.772	21/12/2016	38.975	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	2.578.190	USD	2.886.324	21/12/2016	14.244	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	2.652.656	USD	3.001.150	21/12/2016	(16.805)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	3.397.353	USD	3.808.927	21/12/2016	13.232	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	5.226.696	USD	5.858.999	21/12/2016	21.246	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	6.366.378	USD	7.201.651	21/12/2016	(39.218)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	8.262.527	USD	9.335.804	21/12/2016	(40.127)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	663.000	USD	85.569	21/12/2016	2	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	4.063.200	USD	524.368	21/12/2016	51	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	200.584.938	USD	735.380	21/12/2016	(9.123)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	341.095.989	USD	1.233.203	21/12/2016	1.802	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	430.235.998	USD	1.551.862	21/12/2016	5.892	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	HUF	472.883.075	USD	1.710.331	21/12/2016	1.835	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	146.884.853	USD	2.182.468	21/12/2016*	(2.031)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	185.330.684	USD	2.715.283	21/12/2016*	35.865	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	204.739.093	USD	3.005.892	21/12/2016*	25.052	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	221.356.256	USD	3.266.423	21/12/2016*	19.507	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	INR	297.049.114	USD	4.355.261	21/12/2016*	54.295	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	437.730.174	USD	4.274.187	21/12/2016	63.545	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	442.509.962	USD	4.370.491	21/12/2016	14.608	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	448.916.170	USD	4.492.329	21/12/2016	(43.748)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	758.125.800	USD	7.479.205	21/12/2016	33.521	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	845.548.499	USD	8.290.407	21/12/2016	88.643	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	885.092.550	USD	8.726.486	21/12/2016	44.430	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	886.772.306	USD	8.722.837	21/12/2016	64.724	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	895.023.511	USD	8.720.835	21/12/2016	148.493	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	901.697.383	USD	8.735.297	21/12/2016	200.167	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	929.303.400	USD	9.171.738	21/12/2016	37.290	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	1.336.132.682	USD	12.979.534	21/12/2016	261.011	0,02

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust in USD	% des Netto-vermögens
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	1.382.263.127	USD	13.641.181	21/12/2016	56.498	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	JPY	1.662.260.636	USD	16.421.977	21/12/2016	50.366	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	MXN	4.200.000	USD	212.037	21/12/2016	2.407	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	MXN	20.400.000	USD	1.032.515	21/12/2016	9.069	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	MXN	88.522.958	USD	4.659.494	21/12/2016	(139.686)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MXN	89.629.042	USD	4.700.888	21/12/2016	(124.605)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	MXN	97.800.000	USD	4.889.047	21/12/2016	104.429	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	6.949.800	USD	850.601	21/12/2016	18.660	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	13.157.400	USD	1.589.720	21/12/2016	55.970	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NOK	49.792.200	USD	6.118.230	21/12/2016	109.636	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	2.158.258	USD	1.552.043	21/12/2016	14.455	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	2.158.363	USD	1.569.677	21/12/2016	(3.103)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	2.581.996	USD	1.906.510	21/12/2016	(32.456)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	4.151.666	USD	2.996.812	21/12/2016	16.533	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	5.456.146	USD	3.939.154	21/12/2016	21.003	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	5.550.564	USD	4.125.960	21/12/2016	(97.272)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	NZD	6.318.807	USD	4.648.569	21/12/2016	(62.278)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	1.470.865	USD	374.492	21/12/2016	8.046	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	2.537.530	USD	651.236	21/12/2016	8.716	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	2.639.009	USD	686.262	21/12/2016	83	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	3.046.776	USD	784.153	21/12/2016	8.243	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	3.589.824	USD	921.843	21/12/2016	11.787	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	5.080.091	USD	1.317.133	21/12/2016	4.081	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	PLN	10.867.905	USD	2.835.445	21/12/2016	(8.955)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	1.800.000	USD	593.327	21/12/2016	(2.952)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	2.657.391	USD	877.292	21/12/2016	(5.704)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	5.536.231	USD	1.829.201	21/12/2016	(13.393)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	15.638.658	USD	5.203.214	21/12/2016	(73.950)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	17.805.340	USD	5.944.996	21/12/2016	(105.090)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	22.642.820	USD	7.537.530	21/12/2016	(110.998)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	TRY	29.614.760	USD	9.795.212	21/12/2016	(81.979)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	181.543	BRL	600.000	21/12/2016*	1.147	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.271.891	BRL	4.320.000	21/12/2016*	(26.957)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.603.079	CHF	2.541.000	21/12/2016	(26.698)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	6.114.326	CHF	5.948.841	21/12/2016	(42.353)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	8.292.029	CHF	7.991.400	21/12/2016	21.429	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	12.143.315	CHF	11.890.854	21/12/2016	(162.976)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	13.560.547	CHF	13.207.009	21/12/2016	(107.883)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	18.713.689	CHF	18.144.765	21/12/2016	(65.009)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	20.280.892	CHF	19.766.400	21/12/2016	(176.097)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	36.541.634	CHF	35.397.165	21/12/2016	(92.221)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	38.647.643	CHF	37.237.287	21/12/2016	109.397	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	52.642.968	CHF	50.756.899	21/12/2016	112.748	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	530.574	CNH	3.567.600	21/12/2016	(1.347)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.531.799	EUR	2.262.000	21/12/2016	(13.043)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	49.197	GBP	37.200	21/12/2016	810	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.497.847	GBP	1.903.800	21/12/2016	21.540	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	6.723.322	GBP	5.117.400	21/12/2016	67.026	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	9.127.776	GBP	6.808.200	21/12/2016	272.226	0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	45.221	HKD	350.400	21/12/2016	(4)	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	138.687	HKD	1.074.600	21/12/2016	(7)	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.464.671	HKD	11.348.400	21/12/2016	(16)	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.524.780	HKD	11.820.000	21/12/2016	(775)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	8.993.290	HKD	69.718.200	21/12/2016	(4.926)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.768.694	HUF	492.000.000	21/12/2016	(12.689)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.095.669	HUF	858.000.000	21/12/2016	(10.888)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	318.385	ILS	1.200.000	21/12/2016	(1.495)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	640.004	ILS	2.400.000	21/12/2016	243	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	4.072.197	ILS	15.307.466	21/12/2016	(8.269)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	7.148.909	ILS	26.747.955	21/12/2016	18.785	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	12.624.002	ILS	47.266.579	21/12/2016	24.289	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	109.769	KRW	120.000.000	21/12/2016*	864	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	693.843	KRW	780.000.000	21/12/2016*	(14.038)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.068.767	KRW	3.420.000.000	21/12/2016*	(35.017)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.802.024	KRW	4.260.000.000	21/12/2016*	(64.092)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	5.398.550	KRW	5.912.359.688	21/12/2016*	32.853	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	5.731.628	KRW	6.441.407.851	21/12/2016*	(114.201)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	7.464.471	KRW	8.291.202.465	21/12/2016*	(60.119)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	7.785.635	KRW	8.523.366.786	21/12/2016*	50.347	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	9.901.400	KRW	11.085.663.210	21/12/2016*	(159.272)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	31.577	MXN	600.000	21/12/2016	942	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	13.379.632	NOK	109.712.525	21/12/2016	(342.897)	(0,02)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	14.188.413	NOK	115.605.419	21/12/2016	(271.182)	(0,02)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	17.889.522	NOK	149.476.076	21/12/2016	(796.518)	(0,05)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	24.962.920	NOK	205.233.180	21/12/2016	(707.059)	(0,05)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	155.849	PLN	600.000	21/12/2016	(197)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	488.575	SEK	4.154.400	21/12/2016	3.151	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.259.062	SEK	10.652.351	21/12/2016	14.380	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.483.520	SEK	12.466.452	21/12/2016	26.868	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.648.842	SEK	22.592.089	21/12/2016	9.053	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	5.437.549	SEK	45.530.985	21/12/2016	117.447	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	6.265.140	SEK	52.626.723	21/12/2016	115.931	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	15.915.720	SEK	135.567.600	21/12/2016	75.221	0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	395.200	SGD	540.000	21/12/2016	(1.020)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	661.823	SGD	900.000	21/12/2016	1.457	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	665.859	SGD	900.000	21/12/2016	5.493	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.057.807	SGD	1.440.000	21/12/2016	1.221	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.242.092	SGD	1.680.000	21/12/2016	9.408	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.893.931	SGD	2.580.000	21/12/2016	881	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	1.982.198	SGD	2.710.669	21/12/2016	(6.729)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.027.572	SGD	2.741.757	21/12/2016	15.834	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.769.716	SGD	3.760.601	21/12/2016	10.412	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	2.948.039	SGD	4.020.000	21/12/2016	(1.597)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	3.985.603	SGD	5.427.721	21/12/2016	3.065	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	4.005.074	SGD	5.391.057	21/12/2016	49.438	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	5.230.470	SGD	7.080.000	21/12/2016	35.589	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	6.774.502	SGD	9.240.000	21/12/2016	(5.259)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	7.308.455	SGD	9.970.098	21/12/2016	(7.008)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	7.320.421	SGD	9.970.097	21/12/2016	4.958	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	USD	11.145.850	TWD	350.940.000	21/12/2016*	(106.381)	(0,01)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	75.547	USD	5.301	21/12/2016	89	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	102.723	USD	7.230	21/12/2016	100	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Netto-vermögens
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	109.700	USD	7.564	21/12/2016	263	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	173.576	USD	11.749	21/12/2016	635	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	251.854	USD	17.331	21/12/2016	639	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	600.000	USD	40.781	21/12/2016	2.029	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	1.800.000	USD	122.478	21/12/2016	5.954	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	4.200.000	USD	294.140	21/12/2016	5.534	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	6.000.000	USD	405.413	21/12/2016	22.693	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	7.200.000	USD	511.984	21/12/2016	1.742	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	7.800.000	USD	561.324	21/12/2016	(4.786)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	10.200.000	USD	740.922	21/12/2016	(13.143)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	12.000.000	USD	863.113	21/12/2016	(6.902)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	12.600.000	USD	908.932	21/12/2016	(9.910)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	15.600.000	USD	1.136.518	21/12/2016	(23.444)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	16.200.000	USD	1.120.144	21/12/2016	35.741	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	17.400.000	USD	1.233.611	21/12/2016	7.895	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	ZAR	34.200.000	USD	2.375.787	21/12/2016	64.414	0,00
Total Devisenterminkontrakte						(1.596.150)	(0,10)

* Nicht lieferbare Terminkontrakte. (Siehe Anmerkung 3)

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte zu Sicherungszwecken

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Netto-vermögens
Citibank, N.A.	CHF	174.191	USD	179.038	21/12/2016	1.239	0,00
Citibank, N.A.	CHF	348.182	USD	355.578	21/12/2016	4.769	0,00
Citibank, N.A.	CHF	386.721	USD	397.077	21/12/2016	3.155	0,00
Citibank, N.A.	CHF	531.306	USD	547.970	21/12/2016	1.899	0,00
Citibank, N.A.	CHF	655.000	USD	670.411	21/12/2016	7.473	0,00
Citibank, N.A.	CHF	1.036.484	USD	1.070.005	21/12/2016	2.691	0,00
Citibank, N.A.	CHF	1.090.364	USD	1.131.672	21/12/2016	(3.213)	(0,00)
Citibank, N.A.	CHF	1.486.240	USD	1.541.480	21/12/2016	(3.315)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	5.141	USD	5.800	21/12/2016	(16)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	18.359	USD	20.827	21/12/2016	(172)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	21.437	USD	24.121	21/12/2016	(4)	0,00
Citibank, N.A.	EUR	34.927	USD	39.191	21/12/2016	104	0,00
Citibank, N.A.	EUR	159.966	USD	179.916	21/12/2016	52	0,00
Citibank, N.A.	EUR	378.459	USD	423.841	21/12/2016	1.941	0,00
Citibank, N.A.	EUR	703.710	USD	789.483	21/12/2016	2.220	0,00
Citibank, N.A.	EUR	775.000	USD	873.595	21/12/2016	(1.689)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	790.000	USD	891.450	21/12/2016	(2.668)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	821.433	USD	924.605	21/12/2016	(460)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	1.017.175	USD	1.148.604	21/12/2016	(4.241)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	1.060.000	USD	1.192.476	21/12/2016	67	0,00
Citibank, N.A.	EUR	1.321.821	USD	1.488.865	21/12/2016	(1.762)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	1.609.577	USD	1.812.544	21/12/2016	(1.704)	(0,00)
Citibank, N.A.	EUR	10.862.858	USD	12.158.050	21/12/2016	63.106	0,00
Citibank, N.A.	EUR	28.621.715	USD	32.042.416	21/12/2016	158.172	0,01
Citibank, N.A.	EUR	29.448.403	USD	33.317.165	21/12/2016	(186.519)	(0,01)
Citibank, N.A.	EUR	37.715.614	USD	42.284.642	21/12/2016	146.951	0,01
Citibank, N.A.	EUR	58.024.022	USD	65.043.432	21/12/2016	235.943	0,02
Citibank, N.A.	EUR	70.676.166	USD	79.948.825	21/12/2016	(435.276)	(0,03)
Citibank, N.A.	EUR	91.726.226	USD	103.641.057	21/12/2016	(445.338)	(0,03)
Citibank, N.A.	GBP	11.551	USD	15.346	21/12/2016	(322)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	22.460	USD	29.968	21/12/2016	(754)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	56.442	USD	73.512	21/12/2016	(97)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	72.352	USD	94.190	21/12/2016	(81)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	84.584	USD	111.061	21/12/2016	(1.041)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	97.762	USD	127.150	21/12/2016	11	0,00
Citibank, N.A.	GBP	101.938	USD	134.709	21/12/2016	(2.117)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	154.115	USD	202.038	21/12/2016	(1.578)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	161.234	USD	215.455	21/12/2016	(5.735)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	164.030	USD	216.220	21/12/2016	(2.863)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	175.807	USD	228.171	21/12/2016	504	0,00
Citibank, N.A.	GBP	188.047	USD	250.842	21/12/2016	(6.246)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	195.712	USD	253.782	21/12/2016	784	0,00
Citibank, N.A.	GBP	227.741	USD	305.856	21/12/2016	(9.629)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	269.005	USD	352.577	21/12/2016	(2.677)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	452.464	USD	589.072	21/12/2016	(544)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	493.256	USD	661.586	21/12/2016	(19.999)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	534.906	USD	707.815	21/12/2016	(12.053)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	579.390	USD	761.821	21/12/2016	(8.198)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	1.123.576	USD	1.494.365	21/12/2016	(32.909)	(0,00)
Citibank, N.A.	GBP	2.747.766	USD	3.663.846	21/12/2016	(89.777)	(0,01)
Citibank, N.A.	GBP	3.189.085	USD	4.137.952	21/12/2016	10.149	0,00
Citibank, N.A.	GBP	5.865.772	USD	7.751.172	21/12/2016	(121.454)	(0,01)
Citibank, N.A.	GBP	116.577.538	USD	153.162.770	21/12/2016	(1.528.229)	(0,10)
Citibank, N.A.	GBP	122.013.450	USD	159.879.826	21/12/2016	(1.174.694)	(0,08)
Citibank, N.A.	USD	6.809	EUR	5.980	21/12/2016	82	0,00
Citibank, N.A.	USD	276.659	EUR	246.789	21/12/2016	(966)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	449.384	EUR	399.993	21/12/2016	(624)	(0,00)
Citibank, N.A.	USD	11.259.824	EUR	9.960.746	21/12/2016	53.581	0,00
Citibank, N.A.	USD	8.759.594	GBP	6.557.716	21/12/2016	229.852	0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	261.287	USD	268.558	21/12/2016	1.858	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	522.274	USD	533.368	21/12/2016	7.153	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	580.082	USD	595.616	21/12/2016	4.732	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	796.960	USD	821.957	21/12/2016	2.847	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	1.554.723	USD	1.605.007	21/12/2016	4.034	0,00
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	1.635.546	USD	1.697.510	21/12/2016	(4.822)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	CHF	2.229.358	USD	2.312.222	21/12/2016	(4.975)	(0,00)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	42.932.572	USD	48.063.684	21/12/2016	237.198	0,02

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)

Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Außerbörslich gehandelte Devisenterminkontrakte zu Sicherungszwecken (Fortsetzung)

Gegenpartei	Gekaufte Währung	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust in USD des Nettovermögens
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	44.172.603	USD	49.975.808	21/12/2016	(279.841) (0,02)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	56.573.421	USD	63.427.042	21/12/2016	220.347 0,01
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	87.036.032	USD	97.565.269	21/12/2016	353.792 0,02
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	106.014.251	USD	119.923.390	21/12/2016	(653.065) (0,04)
JPMorgan Chase Bank N.A.	EUR	137.589.339	USD	155.461.780	21/12/2016	(668.202) (0,04)
JPMorgan Chase Bank N.A.	GBP	174.866.306	USD	229.744.441	21/12/2016	(2.292.631) (0,15)
Total Devisenterminkontrakte zu Sicherungszwecken						(6.255.794) (0,41)

Außerbörslich gehandelte Total-Return-Swaps

Referenzwert	Gegenpartei	Währung	Nominalbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust in USD	% des Nettovermögens
BOVESPA Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	BRL	105.032.128	13/10/2016	547.462 0,04	
HANG SENG Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	HKD	251.500.990	28/10/2016	(264.62) (0,02)	
HANG SENG Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	HKD	169.629.177	28/10/2016	(78.65) (0,01)	
H-SHARES Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	HKD	40.967.172	28/10/2016	21.559 0,00	
H-SHARES Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	HKD	68.605.049	28/10/2016	119.298 0,01	
KOSPI2 Index Futures Dec16	Bank of America, N.A.	KRW	47.550.667.000	12/08/2016	(389.67) (0,03)	
SGX Nifty 50 Futures Oct16	Bank of America, N.A.	USD	4.818.304	27/10/2016	(112.16) (0,01)	
TAIEX Futures Oct16	Bank of America, N.A.	TWD	277.067.576	19/10/2016	15.454 0,00	
TAIEX Futures Oct16	Bank of America, N.A.	TWD	513.181.457	19/10/2016	55.847 0,00	
TEL AVIV 25 Index Futures Oct16	Bank of America, N.A.	ILS	8.005.725	26/10/2016	18.421 0,00	
WIG20 INDEX Futures Dec16	Bank of America, N.A.	PLN	696.950	16/12/2016	1.185 0,00	
WIG20 INDEX Futures Dec16	Bank of America, N.A.	PLN	206.951	16/12/2016	(200) (0,00)	
WIG20 INDEX Futures Dec16	Bank of America, N.A.	PLN	479.601	16/12/2016	(1.323) (0,00)	
WIG20 INDEX Futures Dec16	Bank of America, N.A.	PLN	1.203.239	16/12/2016	(2.204) (0,00)	
WIG20 INDEX Futures Dec16	Bank of America, N.A.	PLN	722.453	16/12/2016	(1.190) (0,00)	
BIST 30 Futures Oct16	Goldman Sachs International	TRY	1.187.908	31/10/2016	(6.502) (0,00)	
BIST 3 Futures Oct16	Goldman Sachs International	TRY	2.046.444	31/10/2016	(10.00) (0,00)	
HANG SENG Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	71.643.685	28/10/2016	(69.51) (0,00)	
HANG SENG Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	66.666.776	28/10/2016	(28.98) (0,00)	
HANG SENG Index Futures Oct16	Goldman Sachs International	HKD	66.919.200	28/10/2016	(61.53) (0,00)	
MSCI Brazil Net Return Index Dec16	Goldman Sachs International	BRL	(24.920)	27/12/2016	(22.69) (0,00)	
MSCI Hong Kong Net Return Index Dec16	Goldman Sachs International	HKD	(173.731)	28/12/2016	(173.73) (0,01)	
MSCI Italy Net Return Index Dec16	Goldman Sachs International	EUR	(97.199)	23/12/2016	(97.19) (0,01)	
MSCI Mexico Net Return Index Dec16	Goldman Sachs International	MNX	22.001	26/12/2016	4.706 0,00	
MSCI Poland Net Return Index Dec16	Goldman Sachs International	PLN	(4.036)	23/12/2016	(3.767) (0,00)	
MSCI Singapore Net Return Index Dec16	Goldman Sachs International	SGD	(12.404)	27/12/2016	(12.40) (0,00)	
MSCI South Africa Net Return Index Dec16	Goldman Sachs International	ZAR	(16.937)	27/12/2016	6.222 0,00	
MSCI Spain Net Return Index Dec16	Goldman Sachs International	EUR	(21.678)	23/12/2016	(21.67) (0,00)	
MSCI Sweden Net Return Index Dec16	Goldman Sachs International	SEK	(516.891)	23/12/2016	(516.89) (0,03)	
MSCI Turkey Net Return Index Dec16	Goldman Sachs International	TRY	26.156	23/12/2016	15.043 0,00	
HANG SENG Index Futures Oct16	JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	1.173.560	28/10/2016	(1.020) (0,00)	
HANG SENG Index Futures Oct16	JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	5.862.197	28/10/2016	(4.378) (0,00)	
HANG SENG Index Futures Oct16	JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	2.355.142	28/10/2016	(3.075) (0,00)	
HANG SENG Index Futures Oct16	JPMorgan Chase Bank N.A.	HKD	130.123.569	28/10/2016	(94.97) (0,01)	
KOSPI2 Index Futures Dec16	JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	1.688.426.350	12/08/2016	(9.194) (0,00)	
KOSPI2 Index Futures Dec16	JPMorgan Chase Bank N.A.	KRW	129.450.200	12/08/2016	(318) (0,00)	
Total Total-Return-Swaps						(1.182.69) (0,08)

Außerbörslich gehandelte Total-Return-Basket-Swaps

Gegenpartei	Beschreibung	Enddatum	Wert in USD
Bank of America, N.A.	Der Teilfonds erhält die Gesamtrendite eines Portfolios aus Long- und Short-Positionen und zahlt den LIBOR-Zinssatz (London Interbank Offered Rate) plus oder minus eines Spreads, der basierend auf der Lokalwährung der Positionen im Swap in CHF ausgedrückt wird.	25.10.2018	(532.971)
Die folgende Tabelle weist die Long- und Short-Positionen und damit zusammenhängende Werte innerhalb des Total Return Equity Basket Swaps zum 30. September 2016 aus.			
Referenzwert			
Währung			
Aktien			
Nicht realisierter Wertzuwachs% des Nettoverlust) in USD vermögens			
Long-Positionen			
Stammaktien			
Schweiz			
ABB Ltd	CHF	104.461	(21.519) (0,00)
Adecco Group AG	CHF	15.624	(12.070) (0,00)
Baloise Holding AG	CHF	9.914	(9.190) (0,00)
Barry Callebaut AG	CHF	311	(641) (0,00)
DKSH Holding AG	CHF	4.693	725 0,00
Flughafen Zuerich AG	CHF	5.476	2.256 0,00
Galenica AG	CHF	3.681	(329.863) (0,02)
Geberit AG	CHF	683	985 0,00
Georg Fischer AG	CHF	1.499	26.248 0,00
Givaudan SA	CHF	144	(3.708) (0,00)
Helveta Holding AG	CHF	1.093	(9.569) (0,00)
Kuehne + Nagel International AG	CHF	2.255	2.555 0,00
Lonza Group AG	CHF	12.493	24.449 0,00
Nestle SA	CHF	42.550	19.722 0,00
Partners Group Holding AG	CHF	1.323	2.725 0,00
Roche Holding AG	CHF	5.054	(12.494) (0,00)
Schindler Holding AG	CHF	1.824	(2.067) (0,00)
Sika AG	CHF	90	(8.065) (0,00)
Straumann Holding AG	CHF	1.040	268 0,00
Swiss Life Holding AG	CHF	7.485	(21.587) (0,00)
Swiss Re AG	CHF	74.150	(84.014) (0,01)
Swisscom AG	CHF	3.816	(41.664) (0,00)
Temenos Group AG	CHF	3.786	(2.145) (0,00)
UBS Group AG	CHF	119.106	(4.907) (0,00)
Zurich Insurance Group AG	CHF	1.775	(7.679) (0,00)
Total Long-Positionen			
(491.249) (0,03)			
(491.249) (0,03)			

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs% des Netto-(-verlust) in USD vermögens
Short-Positionen			
Stammaktien			
Österreich			
ams AG	CHF	(41.468)	57.663 0,00 57.663 0,00
Schweiz			
Aryzta AG	CHF	(10.931)	(5.742) (0,00)
Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG	CHF	(105)	(8.652) (0,00)
Cie Financiere Richemont SA	CHF	(67.057)	20.721 0,00
Credit Suisse Group AG	CHF	(624.640)	186.584 0,01
Dufry AG	CHF	(15.772)	(77.979) (0,00)
Julius Baer Group Ltd	CHF	(6.885)	6.312 0,00
LafargeHolcim Ltd	CHF	(69.120)	(39.157) (0,00)
OC Oerlikon Corp AG	CHF	(79.621)	(8.201) (0,00)
Sunrise Communications Group AG	CHF	(9.961)	15.903 0,00
The Swatch Group AG	CHF	(9.428)	19.422 0,00 109.211 0,01
Total Short-Positionen			
Total Long- und Short-Positionen			
Nettobarmittel und sonstige Forderungen/(Verbindlichkeiten)			
Total Total-Return-Basket-Swap - Bank of America, N.A. - CHF			

Gegenpartei	Beschreibung	Enddatum	Wert in USD
Bank of America, N.A.	Der Teilfonds erhält die Gesamtrendite eines Portfolios aus Long- und Short-Positionen und zahlt den 1 Monats-CIBOR-Satz (Copenhagen Interbank Offered Rate) plus oder minus eines Spreads, der basierend auf der Lokalwährung der Positionen im Swap in DKK ausgedrückt wird.	25.10.2018	(582.773)

Die folgende Tabelle weist die Long- und Short-Positionen und damit zusammenhängende Werte innerhalb des Total-Return-Equity-Basket-Swaps zum 30. September 2016 aus.

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs% des Netto-(-verlust) in USD vermögens
Long-Positionen			
Stammaktien			
Dänemark			
Danske Bank A/S	DKK	29.938	10.815 0,00
DSV A/S	DKK	23.226	12.935 0,00
FLSmith & Co A/S	DKK	5.496	(2.068) (0,00)
GN Store Nord A/S	DKK	20.800	(21.915) (0,00)
H Lundbeck A/S	DKK	41.288	(66.495) (0,00)
ISS A/S	DKK	68.165	10.260 0,00
Jyske Bank A/S	DKK	13.516	(1.628) (0,00)
Novo Nordisk A/S	DKK	25.021	(79.087) (0,01)
TDC A/S	DKK	150.409	(9.056) (0,00)
Vestas Wind Systems A/S	DKK	40.156	(9.066) (0,00)
William Demant Holding A/S	DKK	84.484	(31.791) (0,00) (187.096) (0,01)
Total Long-Positionen			
Short-Positionen			
Stammaktien			
Dänemark			
AP Moeller - Maersk A/S	DKK	(580)	(2.619) (0,00)
Coloplast A/S	DKK	(25.463)	(3.833) (0,00)
Genmab A/S	DKK	(1.618)	2.192 0,00
Novozymes A/S	DKK	(30.294)	(5.016) (0,00)
Tryg A/S	DKK	(11.827)	1.424 0,00 (7.852) (0,00)
Total Short-Positionen			
Total Long- und Short-Positionen			
Nettobarmittel und sonstige Forderungen/(Verbindlichkeiten)			
Total Total-Return-Basket-Swap - Bank of America, N.A. - DKK			

Gegenpartei	Beschreibung	Enddatum	Wert in USD
Bank of America, N.A.	Der Teilfonds erhält die Gesamtrendite eines Portfolios aus Long- und Short-Positionen und zahlt den 1-Monats-EURIBOR-Satz (Euro Interbank Offered Rate) plus oder minus eines Spreads, der basierend auf der Lokalwährung der Positionen im Swap in EUR ausgedrückt wird.	25.10.2018	3.623.561

Die folgende Tabelle weist die Long- und Short-Positionen und damit zusammenhängende Werte innerhalb des Total-Return-Equity-Basket-Swaps zum 30. September 2016 aus.

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/-verlust in USD	% des Netto-vermögens
Long-Positionen				
Stammaktien				
Belgien				
Ageas	EUR	56.286	(29.339) (0,00)	
bpost SA	EUR	81.050	29.073 0,00	
Colruyt SA	EUR	13.607	(31.573) (0,00)	
KBC Group NV	EUR	39.337	(70.993) (0,01)	
Proximus SADP	EUR	45.980	(36.594) (0,00)	
Solvay SA	EUR	2.247	5.038 0,00	
Umicore SA	EUR	12.952	11.760 0,00 (122.628) (0,01)	
Finnland				
Amer Sports OYJ	EUR	20.609	(5.313) (0,00)	
Cargotec OYJ	EUR	23.918	268 0,00	
Elisa OYJ	EUR	33.536	(1.504) (0,00)	
Huhtamaki OYJ	EUR	12.269	(4.538) (0,00)	
Kesko OYJ	EUR	22.702	11.706 0,00	
Kone OYJ	EUR	9.712	(19.487) (0,00)	
Metsä OYJ	EUR	21.992	12.819 0,00	
Nestlé OYJ	EUR	138.342	94.595 0,01	
Orion OYJ	EUR	30.775	(6.899) (0,00)	

Die Erläuterungen im Anhang bilden einen wesentlichen Bestandteil dieses Abschlusses.

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Long-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Finnland (Fortsetzung)				
Stora Enso OYJ	EUR	121.789	(10.239)	(0,00)
UPM-Kymmene OYJ	EUR	122.347	21.943	0,00
				93.351 0,01
Frankreich				
Aeroports de Paris	EUR	2.222	(3.138)	(0,00)
Air France-KLM	EUR	377.372	9.729	0,00
Arkema SA	EUR	15.551	(19.698)	(0,00)
Atos SE	EUR	48.527	52.220	0,00
BNP Paribas SA	EUR	48.143	(29.951)	(0,00)
Capgemini SA	EUR	32.678	(3.297)	(0,00)
Christian Dior SE	EUR	7.043	(3.947)	(0,00)
Cie Generale des Etablissements Michelin	EUR	50.446	89.910	0,00
CNP Assurances	EUR	47.397	(2.391)	(0,00)
Danone SA	EUR	15.557	(174)	(0,00)
Dassault Systemes	EUR	6.566	(810)	(0,00)
Eiffage SA	EUR	15.485	(10.762)	(0,00)
Elior Group	EUR	8.185	(1.468)	(0,00)
Eutelsat Communications SA	EUR	17.156	8.654	0,00
Faurecia	EUR	26.569	2.085	0,00
Imerys SA	EUR	2.859	3.044	0,00
Ipsen SA	EUR	14.873	24.007	0,00
Lagardere SCA	EUR	53.596	27.336	0,00
Orange SA	EUR	341.684	116.818	0,01
Orpea	EUR	3.072	(1.240)	(0,00)
Peugeot SA	EUR	230.039	45.126	0,00
Publicis Groupe SA	EUR	26.333	10.922	0,00
Relex SA	EUR	17.574	5.713	0,00
Safran SA	EUR	4.351	(49)	(0,00)
Sanofi	EUR	34.318	(8.463)	(0,00)
SCOR SE	EUR	64.593	(44.529)	(0,00)
SEB SA	EUR	4.658	3.394	0,00
Societe BIC SA	EUR	7.580	4.248	0,00
Societe Generale SA	EUR	81.604	(58.543)	(0,00)
Sodexo SA	EUR	20.364	29.675	0,00
Technip SA	EUR	24.263	104.439	0,01
Teleperformance	EUR	26.558	20.839	0,00
Thales SA	EUR	46.042	94.964	0,01
TOTAL SA	EUR	32.899	15.489	0,00
Valeo SA	EUR	41.280	102.726	0,01
Veolia Environnement SA	EUR	140.986	48.992	0,00
Vinci SA	EUR	30.336	7.481	0,00
			639.351 0,04	
Deutschland				
adidas AG	EUR	9.594	1.613	0,00
Allianz SE	EUR	16.736	(42.210)	(0,00)
Aurubis AG	EUR	39.692	(34.259)	(0,00)
Axel Springer SE	EUR	5.038	2.146	0,00
Brenntag AG	EUR	14.936	9.794	0,00
Covestro AG	EUR	63.896	256.773	0,02
Deutsche Lufthansa AG	EUR	451.743	(264.331)	(0,02)
Deutsche Post AG	EUR	35.015	5.338	0,00
Duerr AG	EUR	4.479	(11.598)	(0,00)
Evonik Industries AG	EUR	48.755	(7.105)	(0,00)
Fraport AG Frankfurt Airport Services Worldwide	EUR	4.787	(1.395)	(0,00)
Freenet AG	EUR	82.336	(16.613)	(0,00)
Fresenius Medical Care AG & Co KGaA	EUR	31.800	(38.498)	(0,00)
FUCHS PETROLUB SE	EUR	5.815	3.911	0,00
Hannover Rueck SE	EUR	43.805	(81.020)	(0,01)
HeidelbergCement AG	EUR	14.491	9.909	0,00
Hella KGaA Hueck & Co	EUR	15.697	(11.173)	(0,00)
Henkel AG & Co KGaA	EUR	35.726	2.002	0,00
HOCHTIEF AG	EUR	16.982	14.277	0,00
K+S AG	EUR	43.378	1.702	0,00
KION Group AG	EUR	31.373	12.660	0,00
MAN SE	EUR	2.235	326	0,00
METRO AG	EUR	65.831	(16.235)	(0,00)
MTU Aero Engines AG	EUR	9.248	3.317	0,00
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	EUR	22.161	(67.072)	(0,01)
OSRAM Licht AG	EUR	44.949	86.663	0,01
ProSiebenSat.1 Media SE	EUR	11.458	12.330	0,00
Rheinmetall AG	EUR	28.882	(32.699)	(0,00)
RHOEN-KLINIKUM AG	EUR	10.988	(4.126)	(0,00)
SAP SE	EUR	13.430	(4.667)	(0,00)
Siemens AG	EUR	30.932	(6.935)	(0,00)
Software AG	EUR	74.900	46.178	0,00
STADA Arzneimittel AG	EUR	36.686	(14.187)	(0,00)
Suedzucker AG	EUR	155.749	67.216	0,00
Symrise AG	EUR	14.232	3.031	0,00
Talax AG	EUR	35.947	(15.715)	(0,00)
			(130.652) (0,01)	
Italien				
A2A SpA	EUR	2.935.219	72.385	0,00
Assicurazioni Generali SpA	EUR	21.787	(6.350)	(0,00)
Autogrill SpA	EUR	56.335	(2.210)	(0,00)
Banca Generali SpA	EUR	17.346	(7.194)	(0,00)
Banca Popolare dell'Emilia Romagna SC	EUR	112.771	3.539	0,00
Brembo SpA	EUR	4.611	258	0,00
Buzzi Unicem SpA	EUR	75.446	5.920	0,00
Davide Campari-Milano SpA	EUR	94.034	13.703	0,00
Diapor SpA	EUR	2.961	(1.328)	(0,00)
Enei SpA	EUR	1.910.123	94.211	0,01
FincoBank Banca Fineco SpA	EUR	191.465	6.439	0,00
Hera SpA	EUR	236.077	(1.059)	(0,00)
Leonardo-Finmeccanica SpA	EUR	52.056	(5.835)	(0,00)
Mediobanca SpA	EUR	427.188	(138.868)	(0,01)
Poste Italiane SpA	EUR	322.774	(25.327)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Long-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Italien (Fortsetzung)				
Prysmian SpA	EUR	119.995	29.592	0,00
Recordati SpA	EUR	75.159	17.692	0,00
Snam SpA	EUR	389.095	30.531	0,00
Telecom Italia SpA	EUR	456.006	(6.330)	(0,00)
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	EUR	538.623	16.906	0,00
UniCredit SpA	EUR	266.569	(25.100)	(0,00)
				71.515
				0,00
Niederlande				
Aalberts Industries NV	EUR	7.755	(1.521)	(0,00)
ABN AMRO Group NV	EUR	54.846	(26.436)	(0,00)
Akzo Nobel NV	EUR	4.665	(3.347)	(0,00)
ASM International NV	EUR	18.050	(708)	(0,00)
Boskalis Westminster	EUR	20.880	15.331	0,00
Delta Lloyd NV	EUR	299.477	42.969	0,00
Gemalto NV	EUR	6.861	(38.685)	(0,00)
Heineken NV	EUR	10.812	1.091	0,00
Koninklijke Ahold Delhaize NV	EUR	183.292	(63.693)	(0,00)
Koninklijke DSM NV	EUR	19.932	(6.033)	(0,00)
Koninklijke Philips NV	EUR	57.565	(3.226)	(0,00)
NN Group NV	EUR	109.858	2.463	0,00
Randstad Holding NV	EUR	22.845	(24.712)	(0,00)
Wolters Kluwer NV	EUR	103.112	60.103	0,00
				(46.404)
				(0,00)
Portugal				
NOS SGPS SA	EUR	7.789	(524)	(0,00)
				(524)
				(0,00)
Spanien				
ACS Actividades de Construcción y Servicios SA	EUR	9.234	(2.432)	(0,00)
Aena SA	EUR	8.952	8.028	0,00
Almirall SA	EUR	79.366	20.462	0,00
Amadeus IT Group SA	EUR	13.219	2.741	0,00
Banco de Sabadell SA	EUR	992.971	(10.018)	(0,00)
Ebro Foods SA	EUR	93.545	(5.767)	(0,00)
Enagas SA	EUR	22.309	15.379	0,00
Endesa SA	EUR	204.085	20.589	0,00
Ferrovial SA	EUR	53.777	38.580	0,00
Gemesa Corp Tecnologica SA	EUR	71.594	4.815	0,00
Gas Natural SDG SA	EUR	25.170	8.041	0,00
Iberdrola SA	EUR	379.996	34.076	0,00
Prosegur Cía de Seguridad SA	EUR	88.681	36.781	0,00
Red Eléctrica Corp SA	EUR	10.792	1.331	0,00
Repsol SA	EUR	200.534	47.206	0,01
Técnicas Reunidas SA	EUR	30.624	77.238	0,01
				297.050
				0,02
Vereinigtes Königreich				
Fiat Chrysler Automobiles NV	EUR	313.193	(21.064)	(0,00)
Unilever NV	EUR	67.364	27.939	0,00
				6.875
				0,00
Total Long-Positionen				807.934
				0,05
Short-Positionen				
Stammaktien				
Belgien				
Anheuser-Busch InBev SA	EUR	(61.106)	(41.098)	(0,00)
Telenet Group Holding NV	EUR	(32.450)	(2.910)	(0,00)
UCB SA	EUR	(10.897)	16.002	0,00
				(28.006)
				(0,00)
Finnland				
Fortum OYJ	EUR	(39.488)	(23.902)	(0,00)
Nokia OYJ	EUR	(1.221.026)	(194.357)	(0,02)
Nokian Renkaat OYJ	EUR	(46.823)	(33.591)	(0,00)
Otakumpu OYJ	EUR	(74.386)	(20.846)	(0,00)
				(272.696)
				(0,02)
Frankreich				
Accor SA	EUR	(95.832)	5.371	0,00
Air Liquide SA	EUR	(13.774)	(3.242)	(0,00)
Airbus Group SE	EUR	(18.581)	(17.288)	(0,00)
Alstom SA	EUR	(55.076)	6.791	0,00
Bolloré SA	EUR	(399.452)	46.120	0,00
Bureau Veritas SA	EUR	(69.946)	(7.449)	(0,00)
Carrefour SA	EUR	(43.038)	8.684	0,00
Casino Guichard Perrachon SA	EUR	(3.952)	2.968	0,00
Credit Agricole SA	EUR	(100.457)	5.405	0,00
Edenred	EUR	(143.138)	(8.825)	(0,00)
Electricité de France SA	EUR	(44.894)	(3.019)	(0,00)
Engie SA	EUR	(62.045)	(5.216)	(0,00)
Essilor International SA	EUR	(13.023)	32.116	0,00
Groupe Eurotunnel SE	EUR	(265.821)	(12.813)	(0,00)
Hermès International	EUR	(6.847)	41.830	0,00
Iliad SA	EUR	(8.128)	911	0,00
Kering	EUR	(3.587)	9.047	0,00
Legrand SA	EUR	(4.944)	4.156	0,00
L'Oréal SA	EUR	(3.662)	(2.668)	(0,00)
VMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	EUR	(13.891)	8.564	0,00
Natixis SA	EUR	(665.819)	(8.956)	(0,00)
Pernod Ricard SA	EUR	(7.652)	8.577	0,00
Plastic Omnium SA	EUR	(30.726)	(10.849)	(0,00)
Remy Cointreau SA	EUR	(31.408)	13.379	0,00
Renault SA	EUR	(3.641)	(5.918)	(0,00)
SFR Group SA	EUR	(65.790)	39.455	0,00
Télévision Française 1	EUR	(3.132)	334	0,00
Vallourec SA	EUR	(300.837)	(39.792)	(0,00)
Vivendi SA	EUR	(151.248)	(4.239)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens	
Short-Positionen (Fortsetzung)					
Stammaktien (Fortsetzung)					
Frankreich (Fortsetzung)					
Zodiac Aerospace	EUR	(143.674)	(46.705)	(0,00)	
			56.729	0,00	
Deutschland					
Bayer AG	EUR	(31.062)	48.050	0,01	
Bayerische Motoren Werke AG	EUR	(37.398)	(419)	(0,00)	
Beiersdorf AG	EUR	(38.154)	20.957	0,00	
Bilfinger SE	EUR	(33.985)	(4.000)	(0,00)	
Continental AG	EUR	(2.305)	4.134	0,00	
Daimler AG	EUR	(47.206)	(2.117)	(0,00)	
Deutsche Bank AG	EUR	(513.575)	(172.708)	(0,01)	
E.ON SE	EUR	(295.013)	28.440	0,00	
HUGO BOSS AG	EUR	(24.074)	19.160	0,00	
LANXESS AG	EUR	(16.901)	(49.068)	(0,00)	
Linde AG	EUR	(2.187)	(16.425)	(0,00)	
Merck KGaA	EUR	(15.536)	3.657	0,00	
Nordex SE	EUR	(21.203)	(22.817)	(0,00)	
RWE AG	EUR	(236.619)	(123.336)	(0,01)	
Sartorius AG	EUR	(2.728)	612	0,00	
Schaeffler AG	EUR	(14.177)	(3.417)	(0,00)	
Telefonica Deutschland Holding AG	EUR	(318.314)	45.672	0,00	
thyssenkrupp AG	EUR	(49.629)	3.616	0,00	
Uniper SE	EUR	(11.954)	(11.979)	(0,00)	
United Internet AG	EUR	(21.370)	11.618	0,00	
Volkswagen AG	EUR	(39.602)	39.953	0,00	
Zalando SE	EUR	(6.230)	(1.886)	(0,00)	
			(182.303)	(0,01)	
Italien					
Azimut Holding SpA	EUR	(106.635)	29.883	0,00	
Banco Popolare SC	EUR	(1.575.119)	(63.563)	(0,00)	
Eni SpA	EUR	(273.005)	(140.772)	(0,01)	
Intesa Sanpaolo SpA	EUR	(170.481)	8.982	0,00	
Luxottica Group SpA	EUR	(58.057)	59.873	0,00	
Mediaset SpA	EUR	(150.448)	675	0,00	
Moncler SpA	EUR	(58.842)	(3.298)	(0,00)	
Saipem SpA	EUR	(915.847)	(19.711)	(0,00)	
Salvatore Ferragamo SpA	EUR	(32.114)	1.440	0,00	
Unione di Banche Italiane SpA	EUR	(1.808.883)	109.494	0,01	
Unipol Gruppo Finanziario SpA	EUR	(377.251)	34.676	0,00	
			17.679	0,00	
Luxemburg					
APERAM SA	EUR	(13.159)	(1.770)	(0,00)	
ArcelorMittal	EUR	(805.948)	(10.841)	(0,00)	
Eurofins Scientific SE	EUR	(1.843)	206	0,00	
Tenaris SA	EUR	(289.602)	(376.570)	(0,02)	
			(388.975)	(0,02)	
Niederlande					
Aegon NV	EUR	(539.257)	41.105	0,00	
Altice NV	EUR	(351.003)	171.154	0,01	
ASML Holding NV	EUR	(44.013)	(23.188)	(0,00)	
Fugro NV	EUR	(26.934)	(21.738)	(0,00)	
Koninklijke KPN NV	EUR	(684.637)	21.488	0,00	
Koninklijke Vopak NV	EUR	(28.847)	(24.090)	(0,00)	
OCI NV	EUR	(87.528)	3.924	0,00	
			168.655	0,01	
Portugal					
Banco Comercial Portugues SA	EUR	(6.017.310)	2.023	0,00	
Jeronimo Martins SGPS SA	EUR	(3.314)	149	0,00	
			2.172	0,00	
Spanien					
Abertis Infraestructuras SA	EUR	(139.799)	784	0,00	
Atresmedia Corp de Medios de Comunicacion SA	EUR	(52.970)	5.344	0,00	
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	EUR	(147.215)	8.911	0,00	
Banco Popular Espanol SA	EUR	(3.396.972)	205.623	0,01	
Bankia SA	EUR	(517.177)	(6.377)	(0,00)	
CaixaBank SA	EUR	(253.627)	5.118	0,00	
Cellnex Telecom SA	EUR	(185.382)	(33.249)	(0,00)	
Distribuidora Internacional de Alimentacion SA	EUR	(108.033)	21.798	0,00	
Industria de Diseno Textil SA	EUR	(90.693)	(4.575)	(0,00)	
Mapfre SA	EUR	(369.178)	(22.761)	(0,00)	
Mediaset Espana Comunicacion SA	EUR	(20.194)	226	0,00	
Obrascon Huarte Lain SA	EUR	(78.108)	(10.682)	(0,00)	
Telefonica SA	EUR	(465.207)	191.381	0,01	
Zardoya Otis SA	EUR	(86.372)	(13.554)	(0,00)	
			347.987	0,02	
Schweiz					
STMicroelectronics NV	EUR	(284.339)	(23.905)	(0,00)	
			(23.905)	(0,00)	
Vereinigtes Königreich					
CNH Industrial NV	EUR	(140.952)	7.900	0,00	
Dialog Semiconductor PLC	EUR	(5.021)	(3.293)	(0,00)	
RELX NV	EUR	(140.350)	(50.344)	(0,00)	
			(45.737)	(0,00)	
Vereinigte Staaten					
QIAGEN NV	EUR	(60.877)	(51.521)	(0,00)	
			(51.521)	(0,00)	
Total Short-Positionen				(399.921)	(0,02)
Total Long- und Short-Positionen				408.013	0,03
Nettobarmittel und sonstige Forderungen/(Verbindlichkeiten)				3.215.548	0,21
Total Total-Return-Basket-Swap - Bank of America, N.A. - EUR				3.623.561	0,24

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Gegenpartei	Beschreibung		Enddatum	Wert in USD
Bank of America, N.A.	Der Teilfonds erhält die Gesamtrendite eines Portfolios aus Long- und Short-Positionen und zahlt den LIBOR-Zinssatz (London Interbank Offered Rate) plus oder minus eines Spreads, der basierend auf der Lokalwährung der Positionen im Swap in GBP ausgedrückt wird.		25.10.2018	(1.489.224)

Die folgende Tabelle weist die Long- und Short-Positionen und damit zusammenhängende Werte innerhalb des Total-Return-Equity-Basket-Swaps zum 30. September 2016 aus.

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Netto-vermögens
Long-Positionen				
Stammaktien				
Deutschland				
TUI AG	GBP	63.293	18.904	0,00
			18.904	0,00
Insel Man				
Paysafe Group PLC	GBP	67.707	(4.748)	(0,00)
			(4.748)	(0,00)
Südafrika				
Investec PLC	GBP	98.671	(2.947)	(0,00)
Mondi PLC	GBP	69.285	900	0,00
			(2.047)	(0,00)
Schweiz				
Coca-Cola HBC AG	GBP	37.687	17.618	0,00
Wolseley PLC	GBP	15.974	6.431	0,00
			24.049	0,00
Vereinigtes Königreich				
Aggreko PLC	GBP	57.905	(3.384)	(0,00)
Ames Foster Wheeler PLC	GBP	172	33	0,00
Anglo American PLC	GBP	105.225	55.751	0,00
Ashtead Group PLC	GBP	82.547	62.173	0,01
Associated British Foods PLC	GBP	21.414	(12.792)	(0,00)
Babcock International Group PLC	GBP	47.358	(38.129)	(0,00)
BAE Systems PLC	GBP	103.921	3.374	0,00
Barratt Developments PLC	GBP	561.610	66.367	0,01
Bellway PLC	GBP	68.106	30.955	0,00
Berendsen PLC	GBP	11.134	(2.892)	(0,00)
Berkeley Group Holdings PLC	GBP	43.728	(9.653)	(0,00)
BP PLC	GBP	200.231	46.804	0,00
Britvic PLC	GBP	32.049	(7.491)	(0,00)
BT Group PLC	GBP	532.950	(20.071)	(0,00)
Bunzl PLC	GBP	26.288	(2.731)	(0,00)
Close Brothers Group PLC	GBP	66.989	(42.626)	(0,00)
Compass Group PLC	GBP	95.451	24.171	0,00
Daily Mail & General Trust PLC	GBP	20.210	11.548	0,00
DCC PLC	GBP	17.366	37.210	0,00
Direct Line Insurance Group PLC	GBP	307.283	(33.120)	(0,00)
Dixons Carphone PLC	GBP	138.458	7.372	0,00
DS Smith PLC	GBP	100.611	(12.673)	(0,00)
easyJet PLC	GBP	84.843	(2.204)	(0,00)
GKN PLC	GBP	202.102	(9.448)	(0,00)
Greene King PLC	GBP	97.110	7.566	0,00
Hays PLC	GBP	202.023	262	0,00
Hiscox Ltd	GBP	13.407	(5.049)	(0,00)
Howden Joinery Group PLC	GBP	99.650	5.047	0,00
HSBC Holdings PLC	GBP	401.557	32.852	0,00
Imperial Brands PLC	GBP	44.372	(10.372)	(0,00)
Inchcape PLC	GBP	114.786	(745)	(0,00)
Indivior PLC	GBP	377.544	(30.152)	(0,00)
Informa PLC	GBP	24.776	(643)	(0,00)
Intermediate Capital Group PLC	GBP	281.531	40.216	0,00
International Consolidated Airlines Group SA	GBP	414.217	(16.675)	(0,00)
ITV PLC	GBP	168.970	7.460	0,00
J Sainsbury PLC	GBP	507.054	(40.166)	(0,00)
John Wood Group PLC	GBP	69.635	24.868	0,00
Johnson Matthey PLC	GBP	19.245	7.248	0,00
Kingfisher PLC	GBP	241.028	21.597	0,00
Legal & General Group PLC	GBP	349.440	(5.445)	(0,00)
Meggitt PLC	GBP	43.665	1.134	0,00
Micro Focus International PLC	GBP	63.204	57.454	0,00
National Grid PLC	GBP	383.954	89.873	0,01
Persimmon PLC	GBP	212.562	74.529	0,01
Playtech PLC	GBP	77.978	11.139	0,00
Provident Financial PLC	GBP	32.709	56.068	0,00
Reckitt Benckiser Group PLC	GBP	14.761	14.376	0,00
Regus PLC	GBP	169.728	(9.257)	(0,00)
Rentokil Initial PLC	GBP	480.131	6.858	0,00
Rightmove PLC	GBP	24.146	43.271	0,00
Royal Mail PLC	GBP	443.938	(126.253)	(0,01)
RPC Group PLC	GBP	15.822	4.520	0,00
Sky PLC	GBP	160.399	123.935	0,01
SSE PLC	GBP	60.310	33.677	0,00
Tate & Lyle PLC	GBP	19.901	3.230	0,00
Taylor Wimpey PLC	GBP	1.737.174	65.421	0,01
The Sage Group PLC	GBP	117.003	5.318	0,00
Travis Perkins PLC	GBP	25.693	2.336	0,00
UBM PLC	GBP	36.224	2.117	0,00
Vodafone Group PLC	GBP	1.208.155	14.120	0,00
WH Smith PLC	GBP	9.179	3.695	0,00
Whitbread PLC	GBP	9.666	4.393	0,00
William Hill PLC	GBP	431.278	21.282	0,00
Wm Morrison Supermarkets PLC	GBP	1.084.349	(7.041)	(0,00)
WPP PLC	GBP	105.173	36.630	0,00
			719.238	0,05
Total Long-Positionen			755.396	0,05
Short-Positionen				
Stammaktien Australien				
BHP Billiton PLC	GBP	(322.188)	(280.322)	(0,02)
			(280.322)	(0,02)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Short-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Chile				
Antofagasta PLC	GBP	(442.133)	(100.477)	(0,01)
			(100.477)	(0,01)
Irland				
Experian PLC	GBP	(179.809)	23.350	0,00
			23.350	0,00
Jordanien				
Hikma Pharmaceuticals PLC	GBP	(28.903)	24.772	0,00
			24.772	0,00
Niederlande				
Royal Dutch Shell PLC	GBP	(97.191)	(99.077)	(0,00)
			(99.077)	(0,00)
Schweiz				
Glencore PLC	GBP	(223.748)	(7.990)	(0,00)
			(7.990)	(0,00)
Vereinigtes Königreich				
AA PLC	GBP	(211.281)	9.603	0,00
Admiral Group PLC	GBP	(21.179)	6.601	0,00
ASOS PLC	GBP	(38.860)	(99.413)	(0,01)
AstraZeneca PLC	GBP	(41.697)	60.537	0,01
Auto Trader Group PLC	GBP	(107.645)	(8.946)	(0,00)
Aviva PLC	GBP	(321.943)	13.797	0,00
Barclays PLC	GBP	(698.504)	36.737	0,00
Booker Group PLC	GBP	(350.538)	2.276	0,00
British American Tobacco PLC	GBP	(25.107)	(14.835)	(0,00)
BTG PLC	GBP	(80.666)	10.999	0,00
Burberry Group PLC	GBP	(53.367)	22.870	0,00
Capita PLC	GBP	(128.186)	500.219	0,03
Centrica PLC	GBP	(1.059.451)	(41.274)	(0,00)
Croda International PLC	GBP	(12.937)	(12.096)	(0,00)
Diageo PLC	GBP	(233.375)	4.546	0,00
Drax Group PLC	GBP	(119.155)	(5.106)	(0,00)
G4S PLC	GBP	(673.915)	60.385	0,00
GlaxoSmithKline PLC	GBP	(174.579)	(4.534)	(0,00)
Henderson Group PLC	GBP	(64.755)	(1.514)	(0,00)
ICAP PLC	GBP	(173.560)	42.598	0,00
IMI PLC	GBP	(70.683)	(1.836)	(0,00)
Inmarsat PLC	GBP	(107.340)	(32.060)	(0,00)
InterContinental Hotels Group PLC	GBP	(22.785)	(21.600)	(0,00)
Intertek Group PLC	GBP	(31.225)	2.839	0,00
Just Eat PLC	GBP	(211.456)	15.103	0,00
Man Group PLC	GBP	(222.546)	4.046	0,00
Next PLC	GBP	(16.905)	(6.586)	(0,00)
Old Mutual PLC	GBP	(995.085)	(34.890)	(0,00)
Pearson PLC	GBP	(130.199)	(56.641)	(0,00)
Pennon Group PLC	GBP	(102.051)	(10.912)	(0,00)
Petrofac Ltd	GBP	(165.542)	(121.460)	(0,01)
Rio Tinto PLC	GBP	(103.043)	(123.776)	(0,01)
Rolls-Royce Holdings PLC	GBP	(102.720)	(4.669)	(0,00)
Rotork PLC	GBP	(104.182)	8.659	0,00
Royal Bank of Scotland Group PLC	GBP	(1.146.065)	22.324	0,00
RSA Insurance Group PLC	GBP	(126.956)	(4.946)	(0,00)
Serco Group PLC	GBP	(727.136)	28.328	0,00
Severn Trent PLC	GBP	(25.359)	(14.819)	(0,00)
Smith & Nephew PLC	GBP	(80.914)	(1.051)	(0,00)
Smiths Group PLC	GBP	(13.998)	(9.634)	(0,00)
Sports Direct International PLC	GBP	(66.481)	(1.770)	(0,00)
St James's Place PLC	GBP	(89.970)	11.099	0,00
Standard Chartered PLC	GBP	(276.232)	4.663	0,00
Standard Life PLC	GBP	(391.737)	5.240	0,00
Tesco PLC	GBP	(2.622.872)	(143.054)	(0,01)
The Weir Group PLC	GBP	(42.327)	(54.966)	(0,00)
Thomas Cook Group PLC	GBP	(198.622)	2.966	0,00
			44.047	0,00
Vereinigte Staaten				
Shire PLC	GBP	(101.575)	177.412	0,01
			177.412	0,01
Total Short-Positionen			(218.285)	(0,02)
Total Long- und Short-Positionen			537.111	0,03
Nettobarmittel und sonstige Forderungen/(Verbindlichkeiten)			(2.026.335)	(0,13)
Total Total-Return-Basket-Swap - Bank of America, N.A. - GBP			(1.489.224)	(0,10)

Referenzwert	Beschreibung	Enddatum	Wert in USD
Merrill Lynch International	Der Teilfonds erhält die Gesamtrendite eines Portfolios aus Long- und Short-Positionen und zahlt den LIBOR-Zinssatz (London Interbank Offered Rate) plus oder minus eines Spreads, der basierend auf der Lokalwährung der Positionen im Swap in JPY ausgedrückt wird.	03.10.2016-28.09.2018	(602.965)

Die folgende Tabelle weist die Long- und Short-Positionen und damit zusammenhängende Werte innerhalb des Total-Return-Equity-Basket-Swaps zum 30. September 2016 aus.

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Long-Positionen				
Stammaktien				
Japan				
ABC-Mart Inc	JPY	13.400	(4.481)	(0,00)
Air Water Inc	JPY	45.000	3.692	0,00
Aisin Seiki Co Ltd	JPY	29.300	(11.208)	(0,00)
Ajinomoto Co Inc	JPY	86.800	9.327	0,00
Alfresa Holdings Corp	JPY	131.800	(56.269)	(0,00)
Amada Holdings Co Ltd	JPY	201.200	(13.626)	(0,00)
ANA Holdings Inc	JPY	1.599.000	(116.422)	(0,01)
Aozora Bank Ltd	JPY	1.408.000	(178.454)	(0,01)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/ Verlust (USD)	% des Nettovermögens
Long-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Japan (Fortsetzung)				
Asahi Group Holdings Ltd	JPY	8.700	1.432	0,00
Astellas Pharma Inc	JPY	165.800	(17.859)	(0,00)
Bandai Namco Holdings Inc	JPY	127.700	(7.053)	(0,00)
Bridgestone Corp	JPY	68.600	29.582	0,00
Brother Industries Ltd	JPY	55.600	23.706	0,00
Canon Inc	JPY	21.900	2.512	0,00
Central Japan Railway Co	JPY	8.000	(5.484)	(0,00)
Century Tokyo Leasing Corp	JPY	19.900	(22.606)	(0,00)
Chiyoda Corp	JPY	40.000	1.792	0,00
Chubu Electric Power Co Inc	JPY	242.500	(90.108)	(0,01)
Citizen Watch Co Ltd	JPY	89.000	(2.193)	(0,00)
Coca-Cola West Co Ltd	JPY	18.700	46.608	0,00
Cosmos Pharmaceutical Corp	JPY	1.000	11.484	0,00
Dai Nippon Printing Co Ltd	JPY	26.000	(5.686)	(0,00)
Daicel Corp	JPY	123.000	64.344	0,00
Daiichi Sankyo Co Ltd	JPY	169.400	(40.164)	(0,00)
Don Quijote Holdings Co Ltd	JPY	10.100	947	0,00
East Japan Railway Co	JPY	13.000	(9.467)	(0,00)
Ezaki Glico Co Ltd	JPY	21.500	84.452	0,00
FamilyMart UNY Holdings Co Ltd	JPY	42.200	(30.872)	(0,00)
Fuji Heavy Industries Ltd	JPY	167.500	(145.913)	(0,01)
FUJIFILM Holdings Corp	JPY	60.100	(24.682)	(0,00)
Fujitsu Ltd	JPY	235.000	6.405	0,00
Fukuoka Financial Group Inc	JPY	226.000	(67.797)	(0,00)
Hakuhodo DY Holdings Inc	JPY	145.100	11.188	0,00
Hankyu Hanshin Holdings Inc	JPY	35.100	(19.637)	(0,00)
Haseko Corp	JPY	302.200	78.498	0,00
Hikari Tsushin Inc	JPY	9.800	4.338	0,00
Hisamitsu Pharmaceutical Co Inc	JPY	27.200	31.019	0,00
Hitachi Capital Corp	JPY	64.500	(89.740)	(0,01)
Hitachi Chemical Co Ltd	JPY	120.200	(16.189)	(0,00)
Hitachi High-Technologies Corp	JPY	103.200	200.501	0,01
Hitachi Metals Ltd	JPY	64.400	35.262	0,00
Hokuhoku Financial Group Inc	JPY	75.800	(54.812)	(0,00)
Hoshizaki Corp	JPY	3.200	8.028	0,00
Hoya Corp	JPY	32.300	(10.729)	(0,00)
Idemitsu Kosan Co Ltd	JPY	110.500	115.334	0,01
Iida Group Holdings Co Ltd	JPY	75.400	46.244	0,00
Isuzu Motors Ltd	JPY	57.200	(17.333)	(0,00)
Ito En Ltd	JPY	6.500	5.755	0,00
ITOCHU Corp	JPY	265.800	(31.537)	(0,00)
Itochu Techno-Solutions Corp	JPY	81.700	(24.156)	(0,00)
Izumi Co Ltd	JPY	13.300	(9.484)	(0,00)
J Front Retailing Co Ltd	JPY	61.900	19.315	0,00
Japan Airlines Co Ltd	JPY	221.300	(127.280)	(0,01)
Japan Post Holdings Co Ltd	JPY	169.100	(115.123)	(0,01)
JSR Corp	JPY	27.900	(7.764)	(0,00)
JTEKT Corp	JPY	97.200	47.981	0,00
Kajima Corp	JPY	401.000	(104)	(0,00)
Kaken Pharmaceutical Co Ltd	JPY	16.200	(28.662)	(0,00)
Kamigumi Co Ltd	JPY	68.000	(7.337)	(0,00)
Kaneka Corp	JPY	349.000	(72.409)	(0,01)
Kao Corp	JPY	31.200	(11.459)	(0,00)
KDDI Corp	JPY	138.900	(37.200)	(0,00)
Kelhan Holdings Co Ltd	JPY	183.000	(37.460)	(0,00)
Kewpie Corp	JPY	74.600	(91.103)	(0,01)
Kobayashi Pharmaceutical Co Ltd	JPY	5.400	853	0,00
Konami Holdings Corp	JPY	122.600	229.168	0,01
Konica Minolta Inc	JPY	65.700	(1.177)	(0,00)
Kose Corp	JPY	16.300	11.908	0,00
Kuraray Co Ltd	JPY	117.600	22.703	0,00
Kurita Water Industries Ltd	JPY	25.500	10.622	0,00
Kyocera Corp	JPY	3.900	2.803	0,00
Kyushu Financial Group Inc	JPY	51.000	(15.236)	(0,00)
Lion Corp	JPY	84.000	75.769	0,00
Makita Corp	JPY	6.100	(3.379)	(0,00)
Marubeni Corp	JPY	134.200	1.879	0,00
Maruichi Steel Tube Ltd	JPY	8.400	1.246	0,00
Matsumotokiyoshi Holdings Co Ltd	JPY	12.200	(8.337)	(0,00)
Mazda Motor Corp	JPY	148.700	(1.792)	(0,00)
Medipal Holdings Corp	JPY	124.200	(33.762)	(0,00)
MEIJI Holdings Co Ltd	JPY	26.000	68.844	0,00
Miraca Holdings Inc	JPY	8.600	(11.779)	(0,00)
Mitsubishi Chemical Holdings Corp	JPY	323.900	(29.288)	(0,00)
Mitsubishi Electric Corp	JPY	157.000	13.245	0,00
Mitsubishi Gas Chemical Co Inc	JPY	200.000	26.537	0,00
Mitsubishi Motors Corp	JPY	3.300	(147)	(0,00)
Mitsubishi Tanabe Pharma Corp	JPY	179.700	62.237	0,00
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc	JPY	220.900	(56.909)	(0,00)
Mitsubishi UFJ Lease & Finance Co Ltd	JPY	290.700	(32.726)	(0,00)
Mitsui & Co Ltd	JPY	172.200	61.611	0,00
Mitsui Chemicals Inc	JPY	706.000	89.384	0,01
Mixi Inc	JPY	57.100	25.183	0,00
Mizuho Financial Group Inc	JPY	2.342.700	(252.871)	(0,02)
MS&AD Insurance Group Holdings Inc	JPY	111.800	(196.930)	(0,01)
Nagoya Railroad Co Ltd	JPY	275.000	4.370	0,00
Nankai Electric Railway Co Ltd	JPY	52.000	(11.573)	(0,00)
Nexon Co Ltd	JPY	157.800	35.963	0,00
NH Foods Ltd	JPY	55.000	(2.257)	(0,00)
NHK Spring Co Ltd	JPY	253.600	7.092	0,00
Nikon Corp	JPY	105.200	(21.685)	(0,00)
Nippon Electric Glass Co Ltd	JPY	151.000	14.942	0,00
Nippon Express Co Ltd	JPY	320.000	(95.343)	(0,01)
Nippon Shokubai Co Ltd	JPY	35.800	(15.274)	(0,00)
Nippon Telegraph & Telephone Corp	JPY	140.600	(174.851)	(0,01)
Nissan Motor Co Ltd	JPY	156.100	(48.549)	(0,00)
Nissrin Seifun Group Inc	JPY	124.500	(3.286)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Long-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Japan (Fortsetzung)				
Nissin Food Holdings Co Ltd	JPY	9.000	(7.163)	(0,00)
Nitori Holdings Co Ltd	JPY	25.400	77.326	0,00
Nomura Research Institute Ltd	JPY	30.620	(18.091)	(0,00)
NTT Data Corp	JPY	18.200	(912)	(0,00)
Obayashi Corp	JPY	393.600	9.917	0,00
Obic Co Ltd	JPY	5.100	340	0,00
Oracle Corp Japan	JPY	15.500	(1.852)	(0,00)
ORIX Corp	JPY	206.000	(48.852)	(0,00)
Osaka Gas Co Ltd	JPY	749.000	(19.232)	(0,00)
Otsuka Corp	JPY	37.500	(17.379)	(0,00)
Otsuka Holdings Co Ltd	JPY	70.100	25.347	0,00
Park24 Co Ltd	JPY	65.000	9.392	0,00
Pola Orbit Holdings Inc	JPY	38.100	43.862	0,00
Renesas Electronics Corp	JPY	75.500	(13.985)	(0,00)
Resona Holdings Inc	JPY	1.632.000	(610.046)	(0,04)
Rohm Co Ltd	JPY	16.800	51.833	0,00
Sankyo Co Ltd	JPY	40.400	(24.819)	(0,00)
Santen Pharmaceutical Co Ltd	JPY	106.900	4.750	0,00
Sawai Pharmaceutical Co Ltd	JPY	2.800	(769)	(0,00)
SCSK Corp	JPY	9.700	6.433	0,00
Secom Co Ltd	JPY	15.500	3.530	0,00
Seiko Epson Corp	JPY	131.500	12.837	0,00
Sekisui Chemical Co Ltd	JPY	138.200	(56.769)	(0,00)
Sekisui House Ltd	JPY	24.600	(159)	(0,00)
Seven & i Holdings Co Ltd	JPY	51.000	35.795	0,00
Shimadzu Corp	JPY	70.000	16.585	0,00
Shimamura Co Ltd	JPY	37.800	(33.335)	(0,00)
Shimizu Corp	JPY	248.000	(9.573)	(0,00)
Shinsel Bank Ltd	JPY	1.301.000	(66.619)	(0,00)
Shionogi & Co Ltd	JPY	8.600	5.204	0,00
Shiseido Co Ltd	JPY	10.300	(1.776)	(0,00)
SoftBank Group Corp	JPY	44.000	(33.790)	(0,00)
Sohgo Security Services Co Ltd	JPY	17.900	31.704	0,00
Sojitz Corp	JPY	1.655.200	(10.790)	(0,00)
Sompo Japan Nipponkoa Holdings Inc	JPY	108.600	(210.360)	(0,01)
Square Enix Holdings Co Ltd	JPY	20.800	21.900	0,00
Sugi Holdings Co Ltd	JPY	21.600	(16.721)	(0,00)
Sumitomo Chemical Co Ltd	JPY	349.000	(17.286)	(0,00)
Sumitomo Corp	JPY	122.200	(4.531)	(0,00)
Sumitomo Dainippon Pharma Co Ltd	JPY	139.100	119.908	0,01
Sumitomo Heavy Industries Ltd	JPY	188.000	(17.850)	(0,00)
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc	JPY	22.700	(41.829)	(0,00)
Sumitomo Mitsui Trust Holdings Inc	JPY	51.800	(131.795)	(0,01)
Sumitomo Rubber Industries Ltd	JPY	235.500	(16.054)	(0,00)
Sundrug Co Ltd	JPY	11.800	7.391	0,00
Suzukeni Co Ltd	JPY	56.270	(26.822)	(0,00)
Taisei Corp	JPY	427.000	(41.646)	(0,00)
Taiho Pharmaceutical Holdings Co Ltd	JPY	6.800	11.129	0,00
Takashimaya Co Ltd	JPY	139.000	(958)	(0,00)
TDK Corp	JPY	22.400	1.174	0,00
Teijin Ltd	JPY	88.200	(40.359)	(0,00)
Terumo Corp	JPY	14.600	(9.644)	(0,00)
The Chugoku Bank Ltd	JPY	46.800	(29.187)	(0,00)
The Gunma Bank Ltd	JPY	196.700	(56.272)	(0,00)
The Yokohama Rubber Co Ltd	JPY	16.300	(1.576)	(0,00)
Toho Gas Co Ltd	JPY	456.000	30.793	0,00
Tohoku Electric Power Co Inc	JPY	108.200	(49.559)	(0,00)
Tokyo Broadcasting System Holdings Inc	JPY	16.700	(408)	(0,00)
Tokyo Electric Power Co Holdings Inc	JPY	571.300	33.840	0,00
Tokyo Electron Ltd	JPY	34.100	(36.140)	(0,00)
Tokyo Gas Co Ltd	JPY	308.000	(54.214)	(0,00)
Tokyu Corp	JPY	152.000	(45.200)	(0,00)
Toppan Printing Co Ltd	JPY	43.000	(4.278)	(0,00)
Tosoh Corp	JPY	564.000	24.086	0,00
TOTO Ltd	JPY	10.200	(734)	(0,00)
Toyo Suisan Kaisha Ltd	JPY	55.500	(41.199)	(0,00)
Toyota Gosei Co Ltd	JPY	78.100	(53.856)	(0,00)
Toyota Boshoku Corp	JPY	45.600	16.539	0,00
Tsuruha Holdings Inc	JPY	10.100	37.022	0,00
West Japan Railway Co	JPY	58.600	(77.350)	(0,01)
Yamada Denki Co Ltd	JPY	333.100	(14.961)	(0,00)
Yamaguchi Financial Group Inc	JPY	315.000	(162.320)	(0,01)
Yamaha Corp	JPY	27.200	21.337	0,00
Yamazaki Baking Co Ltd	JPY	166.300	(156.294)	(0,01)
Yokogawa Electric Corp	JPY	33.100	10.181	0,00
Total Long-Positionen			(2.686.067)	(0,18)
Short-Positionen			(2.686.067)	(0,18)
Stammaktien				
Japan				
Acorn Co Ltd	JPY	(159.300)	17.898	0,00
Advantest Corp	JPY	(31.100)	(10.102)	(0,00)
Aeon Co Ltd	JPY	(241.800)	8.375	0,00
AEON Financial Service Co Ltd	JPY	(74.700)	71.202	0,00
Alps Electric Co Ltd	JPY	(237.600)	(101.835)	(0,01)
Asahi Glass Co Ltd	JPY	(56.000)	(4.785)	(0,00)
Asics Corp	JPY	(222.300)	57.850	0,00
Benesse Holdings Inc	JPY	(24.900)	13.801	0,00
Calbee Inc	JPY	(135.500)	(17.653)	(0,00)
Casio Computer Co Ltd	JPY	(43.500)	(4.168)	(0,00)
Chugai Pharmaceutical Co Ltd	JPY	(86.500)	5.631	0,00
Concordia Financial Group Ltd	JPY	(39.100)	17.213	0,00
Credit Saison Co Ltd	JPY	(43.100)	12.797	0,00
Daido Steel Co Ltd	JPY	(90.000)	(8.865)	(0,00)
Dai-ichi Life Holdings Inc	JPY	(14.700)	5.989	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (-verlust) in USD	% des Netto- vermögens
Short-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Japan (Fortsetzung)				
Daiwa Securities Group Inc	JPY	(421.000)	94.589	0,01
DeNA Co Ltd	JPY	(19.000)	10.032	0,00
Denso Corp	JPY	(81.400)	79.090	0,01
Dentsu Inc	JPY	(14.800)	(4.499)	(0,00)
Eisai Co Ltd	JPY	(65.700)	70.581	0,00
Electric Power Development Co Ltd	JPY	(91.200)	75.681	0,01
FANUC Corp	JPY	(22.000)	(33.790)	(0,00)
Fast Retailing Co Ltd	JPY	(17.700)	46.888	0,00
Hamamatsu Photonics KK	JPY	(73.900)	2.752	0,00
Hino Motors Ltd	JPY	(37.500)	754	0,00
Hirose Electric Co Ltd	JPY	(1.800)	(2.219)	(0,00)
Hitachi Construction Machinery Co Ltd	JPY	(61.900)	(42.749)	(0,00)
Hitachi Ltd	JPY	(526.000)	(4.134)	(0,00)
Hokuriku Electric Power Co	JPY	(49.200)	25.038	0,00
Honda Motor Co Ltd	JPY	(37.800)	15.183	0,00
IHI Corp	JPY	(1.243.000)	(90.385)	(0,01)
Inpex Corp	JPY	(271.600)	(196.031)	(0,01)
Japan Display Inc	JPY	(385.000)	(26.168)	(0,00)
Japan Post Bank Co Ltd	JPY	(135.700)	59.943	0,00
Japan Tobacco Inc	JPY	(60.400)	(69.693)	(0,00)
JFE Holdings Inc	JPY	(233.000)	(41.122)	(0,00)
JX Holdings Inc	JPY	(198.900)	(26.339)	(0,00)
Kakaku.com Inc	JPY	(159.800)	38.321	0,00
Kansai Paint Co Ltd	JPY	(117.900)	8.057	0,00
Kawasaki Heavy Industries Ltd	JPY	(704.000)	(527)	(0,00)
Keikyu Corp	JPY	(226.000)	(7.016)	(0,00)
Keio Corp	JPY	(55.000)	15.036	0,00
Keisei Electric Railway Co Ltd	JPY	(58.000)	39.714	0,00
Keyence Corp	JPY	(1.500)	(13.143)	(0,00)
Kikkoman Corp	JPY	(158.000)	(7.263)	(0,00)
Kintetsu Group Holdings Co Ltd	JPY	(203.000)	21.195	0,00
Kirin Holdings Co Ltd	JPY	(89.200)	(29.210)	(0,00)
Kobe Steel Ltd	JPY	(568.900)	34.739	0,00
Koito Manufacturing Co Ltd	JPY	(19.800)	6.229	0,00
Kubota Corp	JPY	(75.500)	(5.770)	(0,00)
Kyowa Hakko Kirin Co Ltd	JPY	(61.300)	1.122	0,00
Kyushu Electric Power Co Inc	JPY	(344.200)	38.872	0,00
LXIL Group Corp	JPY	(78.100)	25.058	0,00
M3 Inc	JPY	(27.300)	(11.513)	(0,00)
Mabuchi Motor Co Ltd	JPY	(23.400)	(54.974)	(0,00)
Marui Group Co Ltd	JPY	(64.400)	26.975	0,00
Minebea Co Ltd	JPY	(260.300)	(49.441)	(0,00)
MISUMI Group Inc	JPY	(81.400)	(68.993)	(0,00)
Mitsubishi Corp	JPY	(20.400)	(29.532)	(0,00)
Mitsubishi Heavy Industries Ltd	JPY	(657.000)	86.778	0,01
Mitsubishi Logistics Corp	JPY	(168.000)	36.142	0,00
Mitsubishi Materials Corp	JPY	(59.700)	(16.328)	(0,00)
Mitsui OSK Lines Ltd	JPY	(700.000)	(1.789)	(0,00)
MonotaRO Co Ltd	JPY	(31.000)	8.772	0,00
Murata Manufacturing Co Ltd	JPY	(36.000)	(121.806)	(0,01)
Nabtesco Corp	JPY	(36.300)	2.442	0,00
NGK Insulators Ltd	JPY	(50.100)	(6.875)	(0,00)
NGK Spark Plug Co Ltd	JPY	(264.000)	158.595	0,01
Nidec Corp	JPY	(29.400)	(83.729)	(0,01)
Nintendo Co Ltd	JPY	(23.200)	(72.687)	(0,00)
Nippon Paint Holdings Co Ltd	JPY	(189.300)	50.122	0,00
Nippon Shinyaku Co Ltd	JPY	(6.100)	(1.778)	(0,00)
Nippon Steel & Sumitomo Metal Corp	JPY	(117.800)	(53.460)	(0,00)
Nippon Yusen KK	JPY	(182.000)	11.060	0,00
Nissan Chemical Industries Ltd	JPY	(23.200)	(12.078)	(0,00)
Nitto Denko Corp	JPY	(18.200)	1.317	0,00
NOK Corp	JPY	(37.900)	(53.720)	(0,00)
Nomura Holdings Inc	JPY	(371.100)	50.960	0,00
NSK Ltd	JPY	(24.000)	353	0,00
NTN Corp	JPY	(279.000)	12.607	0,00
Odakyu Electric Railway Co Ltd	JPY	(102.000)	61.524	0,00
Oji Holdings Corp	JPY	(82.000)	3.352	0,00
Olympus Corp	JPY	(82.100)	7.517	0,00
Omron Corp	JPY	(88.900)	(8.358)	(0,00)
Ono Pharmaceutical Co Ltd	JPY	(20.100)	3.101	0,00
Oriental Land Co Ltd	JPY	(48.700)	26.466	0,00
Panasonic Corp	JPY	(81.400)	17.774	0,00
Pigeon Corp	JPY	(141.900)	(67.099)	(0,00)
Rakuten Inc	JPY	(479.900)	159.718	0,01
Recruit Holdings Co Ltd	JPY	(17.100)	(14.114)	(0,00)
Rinnai Corp	JPY	(3.100)	(347)	(0,00)
Ryohin Keikaku Co Ltd	JPY	(6.000)	(21.466)	(0,00)
Sega Sammy Holdings Inc	JPY	(173.400)	(25.491)	(0,00)
Seibu Holdings Inc	JPY	(151.900)	73.847	0,01
Seven Bank Ltd	JPY	(580.300)	55.083	0,00
Shikoku Electric Power Co Inc	JPY	(240.100)	85.997	0,01
Shimano Inc	JPY	(16.200)	(11.349)	(0,00)
Shin-Etsu Chemical Co Ltd	JPY	(30.700)	551	0,00
SMC Corp	JPY	(2.300)	(8.553)	(0,00)
Sony Corp	JPY	(51.900)	31.095	0,00
Sony Financial Holdings Inc	JPY	(489.500)	140.026	0,01
Sosei Group Corp	JPY	(1.500)	(2.375)	(0,00)
Stanley Electric Co Ltd	JPY	(93.400)	(15.148)	(0,00)
Start Today Co Ltd	JPY	(20.700)	6.678	0,00
Sumco Corp	JPY	(268.900)	(74.064)	(0,00)
Sumitomo Metal Mining Co Ltd	JPY	(324.000)	(273.506)	(0,02)
Suntory Beverage & Food Ltd	JPY	(21.200)	(12.003)	(0,00)
T&D Holdings Inc	JPY	(283.600)	131.427	0,01
Taiheiyo Cement Corp	JPY	(288.000)	7.327	0,00
Taiyo Nippon Sanso Corp	JPY	(247.800)	459	0,00
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	JPY	(94.800)	(1.273)	(0,00)
The Bank of Kyoto Ltd	JPY	(533.000)	207.599	0,01

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Short-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Japan (Fortsetzung)				
The Chiba Bank Ltd	JPY	(583.000)	222.747	0,01
The Chugoku Electric Power Co Inc	JPY	(185.800)	126.470	0,01
The Hachijuni Bank Ltd	JPY	(253.700)	64.674	0,00
The Hiroshima Bank Ltd	JPY	(162.000)	46.365	0,00
The Iyo Bank Ltd	JPY	(366.700)	116.777	0,01
The Kansai Electric Power Co Inc	JPY	(90.400)	12.900	0,00
The Shizuoka Bank Ltd	JPY	(497.000)	189.681	0,01
THK Co Ltd	JPY	(17.600)	(7.852)	(0,00)
Tobu Railway Co Ltd	JPY	(182.000)	13.172	0,00
Tokio Marine Holdings Inc	JPY	(36.500)	49.833	0,00
Toray Industries Inc	JPY	(55.000)	(3.765)	(0,00)
Toyo Seikan Group Holdings Ltd	JPY	(12.500)	1.915	0,00
Toyota Industries Corp	JPY	(28.100)	47.799	0,00
Toyota Motor Corp	JPY	(20.200)	15.152	0,00
Trenz Micro Inc	JPY	(37.100)	(28.655)	(0,00)
Unicharm Corp	JPY	(56.600)	(17.808)	(0,00)
Yahoo Japan Corp	JPY	(458.100)	39.571	0,00
Yakult Honsha Co Ltd	JPY	(98.300)	74.931	0,01
Yamaha Motor Co Ltd	JPY	(255.500)	(187.104)	(0,01)
Yamato Holdings Co Ltd	JPY	(110.300)	75.602	0,01
Yaskawa Electric Corp	JPY	(248.700)	(103.154)	(0,01)
			1.213.230	0,08
Total Short-Positionen			1.213.230	0,08
Total Long- und Short-Positionen			(1.472.837)	(0,10)
Nettobarmittel und sonstige Forderungen/(Verbindlichkeiten)			869.872	0,06
Total Total-Return-Basket-Swap - Merrill Lynch International - JPY			(602.965)	(0,04)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Gegenpartei	Beschreibung		Enddatum	Wert in USD
Bank of America, N.A.	Der Teilfonds erhält die Gesamtrendite eines Portfolios aus Long- und Short-Positionen und zahlt den NIBOR-Satz (Norwegen Interbank Offered Rate) plus oder minus eines bestimmten Spreads, der basierend auf der Lokalwährung der Positionen im Swap in NOK ausgedrückt wird.		25.10.2018	298.290

Die folgende Tabelle weist die Long- und Short-Positionen und damit zusammenhängende Werte innerhalb des Total-Return-Equity-Basket-Swaps zum 30. September 2016 aus.

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Long-Positionen				
Stammaktien				
Norwegen				
DNB ASA	NOK	89.392	16.768	0,00
Leroy Seafood Group ASA	NOK	7.338	18.352	0,00
Marine Harvest ASA	NOK	149.171	134.309	0,01
Orkla ASA	NOK	53.718	5.710	0,00
Salmar ASA	NOK	10.161	13.215	0,00
Yara International ASA	NOK	51.009	(20.412)	(0,00)
			167.942	0,01
Vereinigtes Königreich				
Subsea 7 SA	NOK	196.865	91.088	0,01
			91.088	0,01
			259.030	0,02
Total Long-Positionen				
Short-Positionen				
Stammaktien				
Norwegen				
Schibsted ASA	NOK	(423.344)	23.294	0,00
Statoil ASA	NOK	(72.180)	88.457	0,01
Telenor ASA	NOK	(240.054)	(225.144)	(0,02)
		(146.794)	(56.906)	(0,00)
			(170.299)	(0,01)
			(170.299)	(0,01)
Total Short-Positionen				
Total Long- und Short-Positionen				
			88.731	0,01
Nettobarmittel und sonstige Forderungen/(Verbindlichkeiten)				
			209.559	0,01
			298.290	0,02

Gegenpartei	Beschreibung		Enddatum	Wert in USD
Bank of America, N.A.	Der Teilfonds erhält die Gesamtrendite eines Portfolios aus Long- und Short-Positionen und zahlt den STIBOR-Satz (Stockholm Interbank Offered Rate) plus oder minus eines Spreads, der basierend auf der Lokalwährung der Positionen im Swap in SEK ausgedrückt wird.		25.10.2018	(74.964)

Die folgende Tabelle weist die Long- und Short-Positionen und damit zusammenhängende Werte innerhalb des Total-Return-Equity-Basket-Swaps zum 30. September 2016 aus.

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Long-Positionen				
Stammaktien				
Malta				
Unibet Group PLC	SEK	21.299	1.859	0,00
			1.859	0,00
Schweden				
Assa Abloy AB	SEK	13.901	647	0,00
BillerudKorsnas AB	SEK	21.834	2.541	0,00
Boliden AB	SEK	79.650	79.724	0,01
Electrolux AB	SEK	54.907	47.289	0,00
Husqvarna AB	SEK	129.905	15.875	0,00
ICA Gruppen AB	SEK	48.691	(19.834)	(0,00)
NCC AB	SEK	25.245	9.696	0,00
Saab AB	SEK	21.600	12.318	0,00
Securitas AB	SEK	147.952	5.166	0,00
Skanska AB	SEK	63.658	22.968	0,00
Svenska Cellulosa AB SCA	SEK	86.471	(81.518)	(0,00)
Swedbank AB	SEK	11.572	2.424	0,00
Swedish Match AB	SEK	23.449	2.456	0,00
			99.752	0,01
			101.611	0,01
Total Long-Positionen				
Short-Positionen				
Stammaktien				
Luxemburg				
Milicom International Cellular SA	SEK	(23.654)	10.737	0,00
			10.737	0,00
Schweden				
Alfa Laval AB	SEK	(14.707)	2.054	0,00
Atlas Copco AB	SEK	(9.416)	(3.068)	(0,00)
Getinge AB	SEK	(22.136)	(1.030)	(0,00)
Hennes & Mauritz AB	SEK	(165.576)	92.500	0,00
Hexagon AB	SEK	(26.482)	(3.699)	(0,00)
Skandinaviska Enskilda Banken AB	SEK	(243.863)	(18.449)	(0,00)
Svenska Handelsbanken AB	SEK	(148.253)	(24.156)	(0,00)
Swedish Orphan Biovitrum AB	SEK	(43.639)	(7.111)	(0,00)
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	SEK	(310.613)	(99.416)	(0,01)
Volvo AB	SEK	(131.051)	(16.778)	(0,00)
			(79.153)	(0,01)
			(68.416)	(0,01)
Total Short-Positionen				
Total Long- und Short-Positionen				
			33.195	0,00
Nettobarmittel und sonstige Forderungen/(Verbindlichkeiten)				
			(108.159)	(0,01)
			(74.964)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Gegenpartei	Beschreibung		Enddatum	Wert in USD
Bank of America, N.A.	Der Teilfonds erhält die Gesamtrendite eines Portfolios aus Long- und Short-Positionen und zahlt den LIBOR-Zinssatz (London Interbank Offered Rate) plus oder minus eines Spreads, der basierend auf der Lokalwährung der Positionen im Swap in USD ausgedrückt wird.		26.09.2018	14.389

Die folgende Tabelle weist die Long- und Short-Positionen und damit zusammenhängende Werte innerhalb des Total-Return-Equity-Basket-Swaps zum 30. September 2016 aus.

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Netto-vermögens
Long-Positionen				
Stammaktien				
USA				
International Game Technology PLC	USD	8.880	(1.154) (1.154) (1.154)	(0,00) (0,00) (0,00)
Total Long-Positionen				
Nettobarmittel und sonstige Forderungen/(Verbindlichkeiten)				
Total Total-Return-Basket-Swap - Bank of America, N.A. - USD				
Total-Return-Basket-Swaps				
außerbörslich gehandelt				

Gegenpartei	Beschreibung		Enddatum	Wert in USD
Goldman Sachs International	Der Teilfonds erhält die Gesamtrendite eines Portfolios aus Long- und Short-Positionen und zahlt den LIBOR-Zinssatz (London Interbank Offered Rate) plus oder minus eines Spreads, der basierend auf der Lokalwährung der Positionen im Swap in USD ausgedrückt wird.		22.12.2020	(6.410.856)

Die folgende Tabelle weist die Long- und Short-Positionen und damit zusammenhängende Werte innerhalb des Total-Return-Equity-Basket-Swaps zum 30. September 2016 aus.

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Netto-vermögens
Long-Positionen				
Stammaktien				
Bermuda				
Arch Capital Group Ltd	USD	27.594	(39.183)	(0,00)
Aspen Insurance Holdings Ltd	USD	68.078	140.921	0,01
RenaissanceRe Holdings Ltd	USD	12.267	14.843	0,00
116.581				0,01
Kanada				
Waste Connections Inc	USD	31.409	(18.531)	(0,00)
(18.531)				(0,00)
Puerto Rico				
Popular Inc	USD	133.466	(153.486)	(0,01)
(153.486)				(0,01)
Singapur				
Broadcom Ltd	USD	3.170	6.467	0,00
6.467				0,00
Schweden				
Autoliv Inc	USD	7.269	(654)	(0,00)
(654)				(0,00)
Schweiz				
Intercontinental Exchange Inc	USD	14.800	(190.624)	(0,01)
TE Connectivity Ltd	USD	15.425	20.669	0,00
(169.955)				(0,01)
Vereinigte Staaten				
3M Co	USD	27.873	(4.738)	(0,00)
Aaron's Inc	USD	82.924	(9.122)	(0,00)
Abbott Laboratories	USD	80.689	10.490	0,00
AbbVie Inc	USD	23.922	(10.047)	(0,00)
Abercrombie & Fitch Co	USD	44.972	(71.505)	(0,00)
Accenture PLC	USD	50.946	593.521	0,04
Activision Blizzard Inc	USD	129.328	(1.293)	(0,00)
Acuity Brands Inc	USD	2.220	(6.416)	(0,00)
Aetna Inc	USD	86.250	13.800	0,00
Aflac Inc	USD	125.518	(26.359)	(0,00)
AGCO Corp	USD	101.338	145.927	0,01
Air Lease Corp	USD	54.358	11.415	0,00
Air Products & Chemicals Inc	USD	14.048	49.589	0,00
Akamai Technologies Inc	USD	43.112	28.023	0,00
Alaska Air Group Inc	USD	62.329	(24.308)	(0,00)
Alleghany Corp	USD	1.068	(459)	(0,00)
Allied World Assurance Co Holdings AG	USD	27.114	10.846	0,00
Alphabet Inc	USD	1.952	15.577	0,00
AMC Networks Inc	USD	27.840	3.898	0,00
Amdocs Ltd	USD	114.535	(218.762)	(0,01)
AMERCO	USD	8.690	(43.624)	(0,00)
Ameren Corp	USD	225.345	(112.673)	(0,01)
American Eagle Outfitters Inc	USD	312.422	(315.546)	(0,02)
American Electric Power Co Inc	USD	189.097	(187.206)	(0,01)
American Financial Group Inc	USD	45.924	4.133	0,00
American International Group Inc	USD	28.197	34.400	0,00
Ameriprise Financial Inc	USD	35.208	(53.164)	(0,00)
AmerisourceBergen Corp	USD	13.915	(52.877)	(0,00)
Amgen Inc	USD	20.050	(115.488)	(0,01)
AmTrust Financial Services Inc	USD	156.655	(17.232)	(0,00)
Antero Resources Corp	USD	354.825	(49.676)	(0,00)
Anthem Inc	USD	83.392	(161.780)	(0,01)
AO Smith Corp	USD	73.050	376.207	0,02
Applied Materials Inc	USD	145.608	(71.348)	(0,00)
AptarGroup Inc	USD	3.131	(4.352)	(0,00)
Aramark	USD	13.164	6.684	0,00
Archer-Daniels-Midland Co	USD	85.149	(28.951)	(0,00)
Arrow Electronics Inc	USD	78.940	(6.315)	(0,00)
Ashland Inc	USD	5.496	(28.689)	(0,00)
Associated Banc-Corp	USD	22.765	2.504	0,00
Assurant Inc	USD	48.810	101.037	0,01

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Long-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Assured Guaranty Ltd	USD	145.366	14.537	0,00
AT&T Inc	USD	161.334	136.327	0,01
Atmos Energy Corp	USD	26.673	(12.536)	(0,00)
AutoNation Inc	USD	15.536	(11.963)	(0,00)
AutoZone Inc	USD	3.345	62.853	0,00
Avery Dennison Corp	USD	67.039	(11.397)	(0,00)
Avnet Inc	USD	114.396	(121.260)	(0,01)
Axis Capital Holdings Ltd	USD	62.289	(44.225)	(0,00)
Bank of Hawaii Corp	USD	8.863	7.090	0,00
Baxter International Inc	USD	110.657	(21.025)	(0,00)
BB&T Corp	USD	116.849	(73.615)	(0,00)
Becton Dickinson and Co	USD	19.842	29.763	0,00
Bed Bath & Beyond Inc	USD	32.904	(26.981)	(0,00)
Belden Inc	USD	15.295	49.243	0,00
Bemis Co Inc	USD	92.138	(57.126)	(0,00)
Berry Plastics Group Inc	USD	29.693	(24.942)	(0,00)
Best Buy Co Inc	USD	156.536	(59.484)	(0,00)
Big Lots Inc	USD	55.565	46.675	0,00
Biogen Inc	USD	9.748	44.256	0,00
Bio-Rad Laboratories Inc	USD	13.987	35.807	0,00
BlackRock Inc	USD	10.002	(95.719)	(0,01)
BOK Financial Corp	USD	23.564	3.770	0,00
Booz Allen Hamilton Holding Corp	USD	53.732	81.135	0,01
Brinker International Inc	USD	80.375	(39.384)	(0,00)
Broardridge Financial Solutions Inc	USD	66.417	(84.350)	(0,01)
Brocade Communications Systems Inc	USD	463.389	85.727	0,01
Bruker Corp	USD	63.685	28.021	0,00
Brunswick Corp	USD	79.823	154.058	0,01
Bunge Ltd	USD	12.748	(10.963)	(0,00)
CA Inc	USD	149.417	125.510	0,01
Cabot Corp	USD	69.538	118.215	0,01
Cadence Design Systems Inc	USD	118.724	111.601	0,01
Campbell Soup Co	USD	24.818	(18.117)	(0,00)
Capital One Financial Corp	USD	95.634	(9.563)	(0,00)
Cardinal Health Inc	USD	45.339	15.869	0,00
Carlisle Cos Inc	USD	23.110	63.090	0,00
Carnival Corp	USD	116.002	317.845	0,02
Carter's Inc	USD	26.865	(275.366)	(0,02)
Casey's General Stores Inc	USD	37.134	(37.877)	(0,00)
CDK Global Inc	USD	7.744	4.282	0,00
CDW Corp	USD	59.006	(20.652)	(0,00)
Celanese Corp	USD	72.256	272.405	0,02
Centene Corp	USD	10.011	(7.184)	(0,00)
CenturyLink Inc	USD	227.727	132.082	0,01
CH Robinson Worldwide Inc	USD	52.414	179.256	0,01
Charles River Laboratories International Inc	USD	46.612	92.758	0,01
Chubb Ltd	USD	46.423	(17.641)	(0,00)
Church & Dwight Co Inc	USD	72.784	53.132	0,00
Cinemark Holdings Inc	USD	62.362	3.118	0,00
Cintas Corp	USD	43.764	(74.399)	(0,00)
Cisco Systems Inc	USD	274.164	152.161	0,01
Citizens Financial Group Inc	USD	115.855	(11.739)	(0,00)
Citrix Systems Inc	USD	42.850	88.271	0,01
CLARCOR Inc	USD	5.770	10.534	0,00
CME Group Inc	USD	18.156	(87.875)	(0,01)
CMS Energy Corp	USD	116.564	(53.619)	(0,00)
Cognizant Technology Solutions Corp	USD	28.228	(162.593)	(0,01)
Comcast Corp	USD	83.991	41.156	0,00
Commerce Bancshares Inc	USD	63.413	(15.219)	(0,00)
Commercial Metals Co	USD	339.913	275.330	0,02
Community Health Systems Inc	USD	346	(114)	(0,00)
Computer Sciences Corp	USD	80.814	191.529	0,01
ConAgra Foods Inc	USD	15.614	53.868	0,00
ConocoPhillips	USD	40.345	176.308	0,01
Consolidated Edison Inc	USD	182.510	(105.856)	(0,01)
Constellation Brands Inc	USD	23.264	14.075	0,00
Convergys Corp	USD	187.824	214.119	0,01
CoreLogic Inc	USD	28.656	(2.292)	(0,00)
Corning Inc	USD	181.613	146.198	0,01
Costco Wholesale Corp	USD	7.602	12.239	0,00
CR Bard Inc	USD	15.024	(67.908)	(0,00)
Cracker Barrel Old Country Store Inc	USD	23.493	(215.196)	(0,01)
Crane Co	USD	30.060	37.575	0,00
Credit Acceptance Corp	USD	950	(6.406)	(0,00)
Crown Holdings Inc	USD	51.801	146.597	0,01
CST Brands Inc	USD	1.362	218	0,00
CSX Corp	USD	107.591	100.060	0,01
Cummins Inc	USD	48.829	352.057	0,02
Curtiss-Wright Corp	USD	24.071	84.008	0,01
CVS Health Corp	USD	26.648	(16.522)	(0,00)
Danaher Corp	USD	69.211	51.216	0,00
Darden Restaurants Inc	USD	76.605	(59.752)	(0,00)
Dean Foods Co	USD	244.108	68.350	0,00
Deckers Outdoor Corp	USD	14.678	(28.475)	(0,00)
Delta Air Lines Inc	USD	166.363	236.235	0,02
Deluxe Corp	USD	78.876	(38.649)	(0,00)
DENTSPLY SIRONA Inc	USD	51.928	(27.522)	(0,00)
DeVry Education Group Inc	USD	22.799	14.363	0,00
Diamond Offshore Drilling Inc	USD	181.251	500.253	0,03
Dick's Sporting Goods Inc	USD	19.117	(82.394)	(0,01)
Dillard's Inc	USD	12.756	58.295	0,00
Discover Financial Services	USD	98.405	(105.293)	(0,01)
Dover Corp	USD	19.722	79.378	0,01
DR Horton Inc	USD	166.443	(68.242)	(0,00)
Dr Pepper Snapple Group Inc	USD	77.810	0	0,00
Dril-Quip Inc	USD	63.668	271.226	0,02
DST Systems Inc	USD	30.378	(36.454)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Long-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
USA (Fortsetzung)				
DTE Energy Co	USD	97.934	(40.153)	(0,00)
Duke Energy Corp	USD	24.067	(3.081)	(0,00)
Eastman Chemical Co	USD	36.693	79.257	0,01
Eaton Corp PLC	USD	63.132	92.173	0,01
eBay Inc	USD	116.739	149.426	0,01
Edison International	USD	57.926	(27.804)	(0,00)
Edwards Lifesciences Corp	USD	23.447	71.748	0,00
Electronic Arts Inc	USD	33.878	65.723	0,00
Emerson Electric Co	USD	36.438	77.138	0,00
Endurance Specialty Holdings Ltd	USD	25.711	6.428	0,00
Entergy Corp	USD	132.739	(248.222)	(0,02)
EQT Corp	USD	13.898	(13.759)	(0,00)
Equifax Inc	USD	49.641	112.189	0,01
Euronet Worldwide Inc	USD	16.176	47.881	0,00
Everest Re Group Ltd	USD	23.191	(7.653)	(0,00)
Exelon Corp	USD	212.936	(172.478)	(0,01)
Expeditor International of Washington Inc	USD	76.449	110.087	0,01
FactSet Research Systems Inc	USD	15.555	(234.725)	(0,02)
Fair Isaac Corp	USD	19.339	(77.549)	(0,01)
Federated Investors Inc	USD	22.025	(59.772)	(0,00)
FedEx Corp	USD	19.763	263.243	0,02
Fidelity National Information Services Inc	USD	19.931	14.749	0,00
Fifth Third Bancorp	USD	324.911	(87.726)	(0,01)
First American Financial Corp	USD	91.341	(136.098)	(0,01)
First Republic Bank	USD	3.499	665	0,00
First Solar Inc	USD	88.645	445.884	0,03
FirstEnergy Corp	USD	9.281	(5.105)	(0,00)
Fiserv Inc	USD	40.229	(11.666)	(0,00)
Flextronics International Ltd	USD	330.310	100.745	0,01
Flowers Foods Inc	USD	98.624	(48.326)	(0,00)
Fluor Corp	USD	37.231	55.102	0,00
FNF Group	USD	64.536	(17.425)	(0,00)
Foot Locker Inc	USD	60.855	25.559	0,00
Ford Motor Co	USD	197.616	(12.845)	(0,00)
Fortune Brands Home & Security Inc	USD	69.815	107.515	0,01
FTI Consulting Inc	USD	4.846	12.307	0,00
Fulton Financial Corp	USD	91.891	(3.676)	(0,00)
GameStop Corp	USD	128.928	(72.200)	(0,00)
Gannett Co Inc	USD	42.765	7.698	0,00
GATX Corp	USD	50.439	116.514	0,01
General Mills Inc	USD	46.292	(68.049)	(0,00)
General Motors Co	USD	237.680	(14.261)	(0,00)
Genpact Ltd	USD	130.421	82.165	0,01
Gilead Sciences Inc	USD	40.020	(10.405)	(0,00)
Global Payments Inc	USD	55.848	96.617	0,01
Graham Holdings Co	USD	3.186	(111.860)	(0,01)
Graphic Packaging Holding Co	USD	81.831	0	0,00
Great Plains Energy Inc	USD	155.633	98.049	0,01
Guess? Inc	USD	42.286	(19.874)	(0,00)
Hancock Holding Co	USD	11.836	993	0,00
Harman International Industries Inc	USD	2.443	3.469	0,00
Harris Corp	USD	16.299	14.669	0,00
Hasbro Inc	USD	30.326	53.070	0,00
Hawaiian Electric Industries Inc	USD	46.213	(3.697)	(0,00)
HCA Holdings Inc	USD	29.964	(29.964)	(0,00)
HD Supply Holdings Inc	USD	23.029	(3.823)	(0,00)
Heilmerich & Payne Inc	USD	32.468	293.511	0,02
Herman Miller Inc	USD	110.158	(745.770)	(0,05)
Hess Corp	USD	29.793	210.637	0,01
Hewlett Packard Enterprise Co	USD	170.054	22.107	0,00
Hill-Rom Holdings Inc	USD	13.593	18.351	0,00
HollyFrontier Corp	USD	95.278	(180.075)	(0,01)
Honeywell International Inc	USD	45.660	79.905	0,01
Hormel Foods Corp	USD	112.921	158.089	0,01
HP Inc	USD	330.029	320.128	0,02
HSN Inc	USD	5.525	(6.685)	(0,00)
Hubbell Inc	USD	9.864	36.201	0,00
Huntington Ingalls Industries Inc	USD	75.890	(139.638)	(0,01)
Huntsman Corp	USD	278.623	358.031	0,02
IAC/InterActiveCorp	USD	12.410	54.852	0,00
IDACORP Inc	USD	35.095	10.879	0,00
Illinois Tool Works Inc	USD	40.174	106.461	0,01
Ingersoll-Rand PLC	USD	101.330	336.416	0,02
Ingredion Inc	USD	72.885	186.586	0,01
Integrated Device Technology Inc	USD	27.196	46.505	0,00
Intel Corp	USD	171.096	92.392	0,01
InterDigital Inc	USD	41.578	83.156	0,01
International Business Machines Corp	USD	27.720	118.919	0,01
International Flavors & Fragrances Inc	USD	7.627	31.194	0,00
International Game Technology PLC	USD	129.890	48.059	0,00
International Paper Co	USD	91.135	(137.614)	(0,01)
Intrexon Corp	USD	63.498	(635)	(0,00)
Intuit Inc	USD	11.918	3.814	0,00
Invesco Ltd	USD	32.321	2.876	0,00
ITT Inc	USD	78.390	39.195	0,00
j2 Global Inc	USD	19.423	(26.221)	(0,00)
Jabil Circuit Inc	USD	216.439	(313.837)	(0,02)
Jack Henry & Associates Inc	USD	36.733	1.469	0,00
Jack in the Box Inc	USD	6.792	(25.130)	(0,00)
Jacobs Engineering Group Inc	USD	45.531	74.216	0,00
Janus Capital Group Inc	USD	116.309	(10.468)	(0,00)
JetBlue Airways Corp	USD	189.183	(17.026)	(0,00)
John Wiley & Sons Inc	USD	46.127	50.740	0,00
Johnson & Johnson	USD	73.462	39.669	0,00
JPMorgan Chase & Co	USD	149.295	11.944	0,00
Juniper Networks Inc	USD	109.792	114.184	0,01
Juno Therapeutics Inc	USD	25.952	22.838	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Long-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
USA (Fortsetzung)				
KB Home	USD	300.753	213.535	0,01
Kimberly-Clark Corp	USD	33.098	118.822	0,01
Kohl's Corp	USD	34.185	(14.358)	(0,00)
L-3 Communications Holdings Inc	USD	48.347	138.756	0,01
Lam Research Corp	USD	42.500	58.650	0,00
Lancaster Colony Corp	USD	14.254	(6.984)	(0,00)
Lear Corp	USD	101.752	319.501	0,02
Leggett & Platt Inc	USD	49.015	(179.885)	(0,01)
Leidos Holdings Inc	USD	85.925	72.312	0,00
Lennar Corp	USD	20.346	(60.021)	(0,00)
Lennox International Inc	USD	9.420	283	0,00
Level 3 Communications Inc	USD	64.614	(167.350)	(0,01)
Lincoln National Corp	USD	37.960	(16.323)	(0,00)
Lowe's Cos Inc	USD	33.122	3.643	0,00
LyondellBasell Industries NV	USD	63.346	136.194	0,01
Mallinckrodt PLC	USD	47.960	(307.424)	(0,02)
Manhattan Associates Inc	USD	30.671	(23.003)	(0,00)
ManpowerGroup Inc	USD	52.114	146.961	0,01
Marathon Petroleum Corp	USD	43.958	(162.645)	(0,01)
MarketAxess Holdings Inc	USD	7.812	(31.014)	(0,00)
Marriott International Inc	USD	28.899	(37.858)	(0,00)
Masco Corp	USD	80.063	85.667	0,01
McCormick & Co Inc	USD	8.687	30.752	0,00
McKesson Corp	USD	11.721	(21.042)	(0,00)
Mentor Graphics Corp	USD	145.946	337.135	0,02
Merck & Co Inc	USD	78.598	79.384	0,01
Meredith Corp	USD	31.997	5.759	0,00
MetLife Inc	USD	59.024	(1.180)	(0,00)
Michael Kors Holdings Ltd	USD	72.312	(209.705)	(0,01)
Microsoft Corp	USD	73.788	31.729	0,00
Minerals Technologies Inc	USD	34.069	109.702	0,01
Mohawk Industries Inc	USD	12.385	(96.231)	(0,01)
Molina Healthcare Inc	USD	81.637	18.777	0,00
Molson Coors Brewing Co	USD	30.625	172.725	0,01
Morgan Stanley	USD	90.838	(34.518)	(0,00)
MSC Industrial Direct Co Inc	USD	39.322	35.783	0,00
MSCI Inc	USD	49.787	(63.229)	(0,00)
MSG Networks Inc	USD	44.173	7.951	0,00
Murphy Oil Corp	USD	35.707	175.678	0,01
Murphy USA Inc	USD	65.425	(162.254)	(0,01)
Mylan NV	USD	126.761	(423.382)	(0,03)
Nasdaq Inc	USD	112.318	(212.281)	(0,01)
Navient Corp	USD	65.294	38.129	0,00
NeuStar Inc	USD	107.720	18.312	0,00
Newfield Exploration Co	USD	52.851	65.535	0,00
NewMarket Corp	USD	949	8.456	0,00
News Corp	USD	110.526	33.667	0,00
NextEra Energy Inc	USD	17.298	(13.146)	(0,00)
NiSource Inc	USD	215.966	(34.555)	(0,00)
Norfolk Southern Corp	USD	52.845	211.908	0,01
Northern Trust Corp	USD	24.218	(37.296)	(0,00)
Northrop Grumman Corp	USD	36.478	40.491	0,00
Nu Skin Enterprises Inc	USD	59.550	238.795	0,02
Nuance Communications Inc	USD	106.502	25.560	0,00
Nucor Corp	USD	51.917	153.155	0,01
NVIDIA Corp	USD	42.093	204.572	0,01
NVR Inc	USD	3.009	(68.846)	(0,00)
Oceaneering International Inc	USD	87.549	207.491	0,01
Old Republic International Corp	USD	245.047	(149.479)	(0,01)
Omnicom Group Inc	USD	43.642	23.567	0,00
ON Semiconductor Corp	USD	101.875	78.444	0,01
ONE Gas Inc	USD	43.109	21.123	0,00
OneMain Holdings Inc	USD	16.275	(14.322)	(0,00)
ONEOK Inc	USD	30.639	117.960	0,01
Oracle Corp	USD	32.841	(709)	(0,00)
O'Reilly Automotive Inc	USD	9.481	40.105	0,00
Oshkosh Corp	USD	84.939	(168.179)	(0,01)
Owens & Minor Inc	USD	10.337	8.683	0,00
Owens Corning	USD	171.217	188.339	0,01
PACCAR Inc	USD	49.315	107.507	0,01
Packaging Corp of America	USD	38.869	(12.438)	(0,00)
PAREXEL International Corp	USD	6.805	6.124	0,00
Parker-Hannifin Corp	USD	25.388	74.133	0,00
Patterson-UTI Energy Inc	USD	125.827	340.991	0,02
Penske Automotive Group Inc	USD	29.305	(31.942)	(0,00)
People's United Financial Inc	USD	154.837	(4.645)	(0,00)
PepsiCo Inc	USD	37.404	103.235	0,01
Pfizer Inc	USD	184.543	(3.691)	(0,00)
PG&E Corp	USD	64.342	(52.117)	(0,00)
Phillips 66	USD	33.940	(13.915)	(0,00)
Pilgrim's Pride Corp	USD	219.814	(61.548)	(0,00)
Pinnacle Foods Inc	USD	55.149	(21.508)	(0,00)
Pinnacle West Capital Corp	USD	146.667	(8.800)	(0,00)
Plantronics Inc	USD	18.548	17.435	0,00
PNM Resources Inc	USD	34.223	7.529	0,00
PolyOne Corp	USD	6.025	11.574	0,00
Post Holdings Inc	USD	29.092	(65.166)	(0,00)
PPG Industries Inc	USD	11.464	23.272	0,00
Prudential Financial Inc	USD	93.158	81.047	0,01
Public Service Enterprise Group Inc	USD	271.081	(138.251)	(0,01)
QEP Resources Inc	USD	177.899	409.168	0,03
QUALCOMM Inc	USD	24.977	160.509	0,01
Quintiles Transnational Holdings Inc	USD	36.247	(6.524)	(0,00)
Ralph Lauren Corp	USD	59.661	131.254	0,01
Raymond James Financial Inc	USD	3.342	1.805	0,00
Raytheon Co	USD	46.805	30.891	0,00
		78.654	(186.410)	(0,01)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Long-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Regal Beloit Corp	USD	4.243	6.789	0,00
Regal Entertainment Group	USD	24.354	(487)	(0,00)
Regions Financial Corp	USD	299.603	20.972	0,00
Reinsurance Group of America Inc	USD	72.253	46.964	0,00
Reliance Steel & Aluminum Co	USD	78.174	213.415	0,01
Republic Services Inc	USD	158.086	(69.558)	(0,00)
Rockwell Automation Inc	USD	14.499	76.410	0,00
Ross Stores Inc	USD	27.832	31.172	0,00
Rowan Cos Plc	USD	442.738	1.0	0,07
Royal Caribbean Cruises Ltd	USD	53.713	481.268	0,03
RPM International Inc	USD	31.394	31.708	0,00
Ryder System Inc	USD	66.383	12.613	0,00
S&P Global Inc	USD	20.601	37.082	0,00
SCANA Corp	USD	111.731	3.352	0,00
Science Applications International Corp	USD	23.602	30.919	0,00
Scripps Networks Interactive Inc	USD	64.048	242.101	0,02
Sensient Technologies Corp	USD	19.297	3.859	0,00
Service Corp International	USD	34.133	683	0,00
Skechers U.S.A. Inc	USD	55.790	(36.264)	(0,00)
Skyworks Solutions Inc	USD	9.116	(16.318)	(0,00)
Snap-on Inc	USD	18.900	6.426	0,00
Sonoco Products Co	USD	77.596	31.038	0,00
Southwest Airlines Co	USD	99.328	135.086	0,01
Spectrum Brands Holdings Inc	USD	23.331	143.719	0,01
Spirit AeroSystems Holdings Inc	USD	180.500	205.770	0,01
SS&C Technologies Holdings Inc	USD	28.995	(11.018)	(0,00)
Stanley Black & Decker Inc	USD	48.250	46.320	0,00
State Street Corp	USD	60.894	(9.743)	(0,00)
Steel Dynamics Inc	USD	136.266	76.309	0,00
STERIS PLC	USD	24.519	21.332	0,00
Stryker Corp	USD	20.852	35.031	0,00
SunTrust Banks Inc	USD	210.703	(105.352)	(0,01)
SUPERVALU Inc	USD	227.635	35.283	0,00
Synaptics Inc	USD	30.610	(19.284)	(0,00)
Synchrony Financial	USD	92.074	50.641	0,00
SYNNEX Corp	USD	45.226	412.461	0,03
Synopsis Inc	USD	71.319	42.791	0,00
Sysco Corp	USD	21.408	(11.346)	(0,00)
Target Corp	USD	21.844	(20.970)	(0,00)
Tech Data Corp	USD	96.721	(65.770)	(0,00)
TEGNA Inc	USD	114.473	19.460	0,00
Teledyne Technologies Inc	USD	12.373	13.115	0,00
Teleflex Inc	USD	28.313	(330.696)	(0,02)
Teradyne Inc	USD	159.863	54.353	0,00
Tesoro Corp	USD	47.980	(288.840)	(0,02)
Texas Instruments Inc	USD	51.666	33.066	0,00
Texas Roadhouse Inc	USD	56.971	(241.557)	(0,02)
The Allstate Corp	USD	135.841	207.837	0,01
The Bank of New York Mellon Corp	USD	124.076	(88.094)	(0,01)
The Boston Beer Co Inc	USD	6.150	(36.039)	(0,00)
The Cheesecake Factory Inc	USD	55.529	(20.546)	(0,00)
The Clorox Co	USD	33.782	63.779	0,01
The Cooper Cos Inc	USD	1.797	(19.426)	(0,00)
The Dow Chemical Co	USD	187.446	(196.818)	(0,01)
The Dun & Bradstreet Corp	USD	7.208	12.109	0,00
The Goodyear Tire & Rubber Co	USD	135.030	(51.311)	(0,00)
The Hanover Insurance Group Inc	USD	48.914	56.740	0,00
The Hartford Financial Services Group Inc	USD	96.963	52.360	0,00
The Home Depot Inc	USD	17.691	24.944	0,00
The Interpublic Group of Cos Inc	USD	111.464	(43.471)	(0,00)
The JM Smucker Co	USD	44.095	(67.906)	(0,00)
The Kroger Co	USD	165.468	(163.813)	(0,01)
The Michaels Cos Inc	USD	18.791	(10.147)	(0,00)
The Mosaic Co	USD	45.251	(46.156)	(0,00)
The PNC Financial Services Group Inc	USD	88.283	(60.915)	(0,00)
The Procter & Gamble Co	USD	62.572	60.069	0,00
The Progressive Corp	USD	75.515	16.613	0,00
The Scotts Miracle-Gro Co	USD	14.200	29.820	0,00
The Sherwin-Williams Co	USD	4.826	10.376	0,00
The Southern Co	USD	119.803	(67.090)	(0,00)
The Timken Co	USD	10.909	23.273	0,00
The T.J.X. Cos Inc	USD	8.563	(3.853)	(0,00)
The Toro Co	USD	53.080	(20.701)	(0,00)
The Travelers Cos Inc	USD	110.023	(78.116)	(0,01)
The Walt Disney Co	USD	19.096	764	0,00
The Western Union Co	USD	90.772	54.009	0,00
Thomson Reuters Corp	USD	24.420	9.280	0,00
Thor Industries Inc	USD	43.286	226.819	0,01
Time Warner Inc	USD	41.094	155.746	0,01
TopBuild Corp	USD	22.096	(5.082)	(0,00)
Torchmark Corp	USD	48.579	(31.091)	(0,00)
Total System Services Inc	USD	93.205	11.185	0,00
Transocean Ltd	USD	259.153	432.786	0,03
Trinity Industries Inc	USD	207.015	70.385	0,00
Trustmark Corp	USD	71.685	(7.169)	(0,00)
Tupperware Brands Corp	USD	30.292	42.712	0,00
Tyson Foods Inc	USD	193.857	151.208	0,01
UGI Corp	USD	104.464	(30.295)	(0,00)
Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc	USD	3.010	11.438	0,00
United Continental Holdings Inc	USD	128.478	66.809	0,00
United Parcel Service Inc	USD	45.763	75.509	0,00
United States Steel Corp	USD	36.902	74.911	0,00
United Therapeutics Corp	USD	46.834	(347.977)	(0,02)
UnitedHealth Group Inc	USD	36.201	34.029	0,00
Universal Health Services Inc	USD	22.070	(33.105)	(0,00)
Unum Group	USD	147.592	(57.561)	(0,00)
US Bancorp	USD	142.982	(27.167)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Long-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Valero Energy Corp	USD	88.605	(435.051)	(0,03)
Validus Holdings Ltd	USD	78.046	15.609	0,00
Valmont Industries Inc	USD	7.062	37.782	0,00
Vantiv Inc	USD	25.192	44.086	0,00
Varian Medical Systems Inc	USD	7.229	23.567	0,00
Vectren Corp	USD	14.433	2.165	0,00
VeriSign Inc	USD	13.264	6.367	0,00
Verizon Communications Inc	USD	63.170	77.067	0,00
Vishay Intertechnology Inc	USD	146.012	31.393	0,00
VMware Inc	USD	25.962	10.125	0,00
VWR Corp	USD	56.387	(3.947)	(0,00)
Wal-Mart Stores Inc	USD	120.478	(12.048)	(0,00)
Waste Management Inc	USD	157.212	66.029	0,00
Waters Corp	USD	16.753	34.679	0,00
WebMD Health Corp	USD	14.932	5.674	0,00
WellCare Health Plans Inc	USD	66.135	205.680	0,01
Wells Fargo & Co	USD	161.599	(300.574)	(0,02)
Werner Enterprises Inc	USD	129.687	(23.344)	(0,00)
West Pharmaceutical Services Inc	USD	20.522	(160.687)	(0,01)
Western Alliance Bancorp	USD	9.393	6.151	0,00
Western Refining Inc	USD	37.677	(105.872)	(0,01)
Westlake Chemical Corp	USD	61.773	170.493	0,01
WGL Holdings Inc	USD	46.924	(26.277)	(0,00)
Whirlpool Corp	USD	39.489	(30.801)	(0,00)
White Mountains Insurance Group Ltd	USD	541	(2.159)	(0,00)
Willis Towers Watson PLC	USD	2.123	13.417	0,00
Woodward Inc	USD	42.430	70.009	0,00
World Fuel Services Corp	USD	56.821	81.254	0,01
Worthington Industries Inc	USD	26.652	168.441	0,01
WPX Energy Inc	USD	88.626	112.555	0,01
WR Berkley Corp	USD	19.217	10.762	0,00
Wyndham Worldwide Corp	USD	33.111	(26.489)	(0,00)
Xcel Energy Inc	USD	329.192	19.752	0,00
Xerox Corp	USD	227.136	43.156	0,00
Xylem Inc	USD	18.387	26.718	0,00
Zimmer Biomet Holdings Inc	USD	5.660	23.377	0,00
			10.489.836	0,68
Total Long-Positionen			10.270.258	0,67
Short-Positionen				
Stammaktien				
Bermuda				
Golar LNG Ltd	USD	(87.892)	49.219	0,00
IHS Markit Ltd	USD	(110.378)	(100.444)	(0,01)
Marvell Technology Group Ltd	USD	(86.908)	(50.248)	(0,00)
			(101.473)	(0,01)
Ireland				
XL Group Ltd	USD	(93.836)	8.149	0,00
			8.149	0,00
Schweiz				
Weatherford International PLC	USD	(1.763.786)	(370.395)	(0,02)
			(370.395)	(0,02)
Vereinigtes Königreich				
Acadia Healthcare Co Inc	USD	(124.213)	396.239	0,02
Delphi Automotive PLC	USD	(48.361)	(1.451)	(0,00)
Liberty Global PLC	USD	(141.379)	(12.724)	(0,00)
Noble Corp plc	USD	(337.977)	(346.313)	(0,02)
Pentair PLC	USD	(62.100)	(209.898)	(0,01)
			(174.147)	(0,01)
Vereinigte Staaten				
3D Systems Corp	USD	(11.972)	(19.867)	(0,00)
ABIOMED Inc	USD	(29.373)	(107.211)	(0,01)
ACI Worldwide Inc	USD	(12.200)	(8.052)	(0,00)
Acxiom Corp	USD	(68.839)	8.261	0,00
Adobe Systems Inc	USD	(21.008)	(165.753)	(0,01)
Advance Auto Parts Inc	USD	(23.210)	42.706	0,00
Advanced Micro Devices Inc	USD	(301.185)	(188.241)	(0,01)
AECOM	USD	(46.414)	(59.874)	(0,00)
Agilent Technologies Inc	USD	(86.973)	(122.632)	(0,01)
Agios Pharmaceuticals Inc	USD	(50.760)	(235.526)	(0,02)
Akorn Inc	USD	(66.244)	118.577	0,01
Albemarle Corp	USD	(4.961)	(30.758)	(0,00)
Alcoa Inc	USD	(264.289)	(169.145)	(0,01)
Alexion Pharmaceuticals Inc	USD	(21.365)	237.792	0,02
Align Technology Inc	USD	(31.777)	46.394	0,00
Alkermetes PLC	USD	(87.922)	292.780	0,02
Allegheny Technologies Inc	USD	(170.220)	(267.245)	(0,02)
Allegion PLC	USD	(54.629)	(46.435)	(0,00)
Allergan plc	USD	(31.199)	476.721	0,03
Alliance Data Systems Corp	USD	(13.669)	44.834	0,00
Alliant Energy Corp	USD	(55.555)	(5.000)	(0,00)
Allison Transmission Holdings Inc	USD	(109.835)	(119.720)	(0,01)
Allscripts Healthcare Solutions Inc	USD	(109.435)	3.830	0,00
Alnylam Pharmaceuticals Inc	USD	(75.662)	688.524	0,04
Amazon.com Inc	USD	(5.176)	(308.438)	(0,02)
American Airlines Group Inc	USD	(20.081)	(14.860)	(0,00)
American Express Co	USD	(53.147)	14.350	0,00
AMETEK Inc	USD	(89.613)	(34.053)	(0,00)
Amphenol Corp	USD	(70.821)	(70.113)	(0,00)
Anadarko Petroleum Corp	USD	(77.406)	(428.829)	(0,03)
Analog Devices Inc	USD	(8.546)	(17.348)	(0,00)
ANSYS Inc	USD	(3.160)	2.275	0,00
Aon PLC	USD	(65.001)	(140.402)	(0,01)
Apache Corp	USD	(15.523)	(96.542)	(0,01)
Apple Inc	USD	(7.221)	9.837	0,00

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Short-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Arista Networks Inc	USD	(23.876)	(74.254)	(0,00)
Armstrong World Industries Inc	USD	(49.960)	25.480	0,00
ARRIS International PLC	USD	(76.292)	(12.970)	(0,00)
Arthur J Gallagher & Co	USD	(93.474)	(81.322)	(0,01)
Artisan Partners Asset Management Inc	USD	(98.309)	48.171	0,00
Ascena Retail Group Inc	USD	(294.894)	810.958	0,05
athenahealth Inc	USD	(30.440)	(53.574)	(0,00)
Autodesk Inc	USD	(72.890)	(243.453)	(0,02)
Automatic Data Processing Inc	USD	(44.151)	(26.932)	(0,00)
Avangrid Inc	USD	(82.933)	(29.856)	(0,00)
Avis Budget Group Inc	USD	(92.907)	340.040	0,02
Avon Products Inc	USD	(537.324)	(37.613)	(0,00)
Axalta Coating Systems Ltd	USD	(164.534)	(80.622)	(0,01)
B/E Aerospace Inc	USD	(183.771)	(510.883)	(0,03)
Baker Hughes Inc	USD	(57.303)	(89.966)	(0,01)
Ball Corp	USD	(68.622)	(188.024)	(0,01)
BancorpSouth Inc	USD	(29.507)	12.393	0,00
Bank of America Corp	USD	(132.050)	42.256	0,00
Bank of the Ozarks Inc	USD	(147.506)	131.280	0,01
BankUnited Inc	USD	(19.328)	13.723	0,00
BioMarin Pharmaceutical Inc	USD	(65.679)	426.257	0,03
Bio-Techne Corp	USD	(43.878)	35.102	0,00
Black Hills Corp	USD	(43.686)	(73.392)	(0,00)
Black Knight Financial Services Inc	USD	(38.859)	777	0,00
BorgWarner Inc	USD	(101.635)	(4.065)	(0,00)
Boston Scientific Corp	USD	(112.164)	23.554	0,00
Bristol-Myers Squibb Co	USD	(66.522)	77.831	0,00
Brookdale Senior Living Inc	USD	(265.848)	303.067	0,02
Brown & Brown Inc	USD	(76.721)	(20.715)	(0,00)
Brown-Forman Corp	USD	(58.430)	(52.003)	(0,00)
Buffalo Wild Wings Inc	USD	(8.754)	117.829	0,01
BWX Technologies Inc	USD	(27.893)	837	0,00
Cabela's Inc	USD	(60.106)	(236.217)	(0,02)
Cable One Inc	USD	(1.025)	(13.069)	(0,00)
Cabot Oil & Gas Corp	USD	(106.760)	(132.382)	(0,01)
CalAtlantic Group Inc	USD	(145.509)	98.946	0,01
CarMax Inc	USD	(65.755)	297.213	0,02
Carpenter Technology Corp	USD	(66.554)	(245.584)	(0,02)
Catalent Inc	USD	(49.229)	12.967	0,00
Caterpillar Inc	USD	(40.224)	(250.193)	(0,02)
Cathay General Bancorp	USD	(7.000)	1.470	0,00
CBOE Holdings Inc	USD	(37.614)	151.208	0,01
CBS Corp	USD	(45.581)	(171.385)	(0,01)
CEB Inc	USD	(46.037)	(38.671)	(0,00)
Celgene Corp	USD	(11.444)	50.697	0,00
CenterPoint Energy Inc	USD	(175.049)	(43.762)	(0,00)
Cerner Corp	USD	(67.610)	(2.704)	(0,00)
CF Industries Holdings Inc	USD	(296.220)	(133.299)	(0,01)
Cheniere Energy Inc	USD	(148.292)	99.356	0,01
Chesapeake Energy Corp	USD	(534.322)	352.653	0,02
Chevron Corp	USD	(23.432)	(90.213)	(0,01)
Chicago Bridge & Iron Co NV	USD	(215.787)	(75.525)	(0,00)
Chico's FAS Inc	USD	(116.068)	54.552	0,00
Chipotle Mexican Grill Inc	USD	(27.398)	(447.683)	(0,03)
Choice Hotels International Inc	USD	(16.448)	20.067	0,00
Ciena Corp	USD	(37.761)	2.266	0,00
Cimarex Energy Co	USD	(7.131)	(34.443)	(0,00)
Cincinnati Financial Corp	USD	(18.762)	(3.565)	(0,00)
CIT Group Inc	USD	(36.864)	(27.279)	(0,00)
Clean Harbors Inc	USD	(28.165)	(44.501)	(0,00)
CNO Financial Group Inc	USD	(27.175)	11.957	0,00
Cognex Corp	USD	(119.455)	(370.311)	(0,02)
Colfax Corp	USD	(134.297)	(343.800)	(0,02)
Colgate-Palmolive Co	USD	(125.954)	(216.641)	(0,01)
Comerica Inc	USD	(73.129)	(38.027)	(0,00)
CommScope Holding Co Inc	USD	(87.797)	118.526	0,01
CommVault Systems Inc	USD	(50.814)	(9.655)	(0,00)
Compass Minerals International Inc	USD	(49.927)	(66.902)	(0,00)
comScore Inc	USD	(51.891)	51.372	0,00
Concho Resources Inc	USD	(15.706)	(172.295)	(0,01)
Copart Inc	USD	(23.709)	(61.406)	(0,00)
Core Laboratories NV	USD	(3.821)	(12.647)	(0,00)
CoStar Group Inc	USD	(14.033)	(71.568)	(0,00)
Covanta Holding Corp	USD	(364.507)	(222.349)	(0,01)
Cree Inc	USD	(27.061)	(33.285)	(0,00)
Cullen/Frost Bankers Inc	USD	(13.650)	0	0,00
Cypress Semiconductor Corp	USD	(415.498)	(83.100)	(0,01)
Dana Inc	USD	(87.828)	(4.831)	(0,00)
DaVita Inc	USD	(62.603)	(83.888)	(0,01)
Deere & Co	USD	(25.531)	(61.274)	(0,00)
DexCom Inc	USD	(116.288)	694.299	0,05
Diebold Inc	USD	(98.319)	(15.731)	(0,00)
Discovery Communications Inc	USD	(89.932)	(218.535)	(0,01)
DISH Network Corp	USD	(86.828)	(216.202)	(0,01)
Dolby Laboratories Inc	USD	(14.179)	(39.985)	(0,00)
Dollar General Corp	USD	(17.322)	52.139	0,00
Dollar Tree Inc	USD	(56.576)	165.202	0,01
Dominion Resources Inc	USD	(122.801)	125.257	0,01
Domino's Pizza Inc	USD	(24.316)	(12.158)	(0,00)
Donaldson Co Inc	USD	(120.294)	(44.509)	(0,00)
Dunkin' Brands Group Inc	USD	(158.913)	(565.730)	(0,04)
E*TRADE Financial Corp	USD	(53.355)	(25.610)	(0,00)
East West Bancorp Inc	USD	(24.030)	(3.201)	(0,00)
Eaton Vance Corp	USD	(80.624)	19.350	0,00
Ecolab Inc	USD	(25.118)	(86.406)	(0,01)
Edgewell Personal Care Co	USD	(20.265)	(54.310)	(0,00)
Eli Lilly & Co	USD	(25.447)	(29.148)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Short-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Endo International PLC	USD	(157.780)	(45.756)	(0,00)
Energizer Holdings Inc	USD	(31.449)	(135.231)	(0,01)
Enso PLC	USD	(484.788)	(814.444)	(0,05)
Envision Healthcare Holdings Inc	USD	(300.281)	15.014	0,00
EOG Resources Inc	USD	(15.790)	(75.846)	(0,01)
Esterline Technologies Corp	USD	(25.483)	(33.383)	(0,00)
Eversource Energy	USD	(102.122)	(3.064)	(0,00)
Expedia Inc	USD	(10.507)	(103.013)	(0,01)
Express Scripts Holding Co	USD	(12.962)	8.944	0,00
F5 Networks Inc	USD	(12.123)	(58.554)	(0,00)
Facebook Inc	USD	(19.252)	19.637	0,00
Fastenal Co	USD	(48.399)	(45.839)	(0,00)
FireEye Inc	USD	(224.878)	(206.888)	(0,01)
First Data Corp	USD	(513.221)	292.536	0,02
First Horizon National Corp	USD	(381.480)	30.518	0,00
Fitbit Inc	USD	(22.229)	30.736	0,00
FleetCor Technologies Inc	USD	(30.554)	(93.495)	(0,01)
FLIR Systems Inc	USD	(48.539)	(971)	(0,00)
Flowserve Corp	USD	(60.430)	(39.280)	(0,00)
FMC Corp	USD	(136.884)	(108.138)	(0,01)
FNB Corp	USD	(57.398)	(8.043)	(0,00)
Fortinet Inc	USD	(65.467)	(32.079)	(0,00)
Fossil Group Inc	USD	(52.685)	(15.279)	(0,00)
Franklin Resources Inc	USD	(32.601)	12.062	0,00
Freeport-McMoRan Inc	USD	(298.428)	(286.491)	(0,02)
Frontier Communications Corp	USD	(854.300)	51.258	0,00
Garmin Ltd	USD	(35.373)	(18.040)	(0,00)
Gartner Inc	USD	(30.501)	43.616	0,00
General Electric Co	USD	(101.633)	(18.802)	(0,00)
Genesee & Wyoming Inc	USD	(73.431)	(195.326)	(0,01)
Gentex Corp	USD	(115.958)	(2.319)	(0,00)
Genworth Financial Inc	USD	(638.070)	(3.190)	(0,00)
GoDaddy Inc	USD	(27.055)	(11.363)	(0,00)
Graco Inc	USD	(35.570)	27.389	0,00
Greit Inc	USD	(11.629)	(17.327)	(0,00)
Groupon Inc	USD	(334.449)	5.017	0,00
Guidewire Software Inc	USD	(25.113)	(13.059)	(0,00)
H&R Block Inc	USD	(125.576)	(36.417)	(0,00)
Halliburton Co	USD	(67.065)	(205.890)	(0,01)
Halyard Health Inc	USD	(45.442)	(5.907)	(0,00)
Hanesbrands Inc	USD	(90.301)	87.592	0,01
Harley-Davidson Inc	USD	(33.077)	(7.938)	(0,00)
HEICO Corp	USD	(4.613)	(300)	(0,00)
Henry Schein Inc	USD	(11.041)	9.054	0,00
Hertz Global Holdings Inc	USD	(21.082)	197.117	0,01
Hexcel Corp	USD	(18.850)	(8.011)	(0,00)
Hilton Worldwide Holdings Inc	USD	(107.866)	15.101	0,00
Hologic Inc	USD	(87.239)	(26.172)	(0,00)
Huntington Bancshares Inc	USD	(220.061)	(386)	(0,00)
IDEX Corp	USD	(6.681)	(15.834)	(0,00)
IDEXX Laboratories Inc	USD	(42.079)	(47.970)	(0,00)
Illumina Inc	USD	(63.149)	(289.854)	(0,02)
Incycorp Corp	USD	(56.042)	(432.644)	(0,03)
Intuitive Surgical Inc	USD	(1.790)	(46.737)	(0,00)
Ionis Pharmaceuticals Inc	USD	(37.277)	(156.563)	(0,01)
IPG Photonics Corp	USD	(22.703)	227	0,00
Jazz Pharmaceuticals PLC	USD	(18.122)	68.682	0,00
JB Hunt Transport Services Inc	USD	(22.858)	12.115	0,00
JC Penney Co Inc	USD	(135.056)	121.550	0,01
Kansas City Southern	USD	(46.254)	(144.775)	(0,01)
KAR Auction Services Inc	USD	(14.624)	(13.717)	(0,00)
Kate Spade & Co	USD	(230.232)	375.278	0,02
KBR Inc	USD	(71.064)	(36.953)	(0,00)
Kellogg Co	USD	(55.754)	34.010	0,00
Kennametal Inc	USD	(101.987)	(122.384)	(0,01)
KeyCorp	USD	(191.391)	42.106	0,00
Keysight Technologies Inc	USD	(44.121)	(33.091)	(0,00)
Kinder Morgan Inc	USD	(189.814)	(168.934)	(0,01)
KLX Inc	USD	(82.193)	(108.495)	(0,01)
Knowles Corp	USD	(90.546)	59.760	0,00
Kosmos Energy Ltd	USD	(133.181)	(74.581)	(0,00)
L Brands Inc	USD	(18.871)	53.567	0,00
Laboratory Corp of America Holdings	USD	(11.379)	(2.503)	(0,00)
Landstar System Inc	USD	(29.724)	(31.805)	(0,00)
Laredo Petroleum Inc	USD	(16.586)	(19.896)	(0,00)
Las Vegas Sands Corp	USD	(34.887)	20.234	0,00
Legg Mason Inc	USD	(118.412)	81.704	0,01
Leucadia National Corp	USD	(88.095)	(881)	(0,00)
Liberty Broadband Corp	USD	(46.851)	(51.536)	(0,00)
Lincoln Electric Holdings Inc	USD	(13.792)	(14.620)	(0,00)
Lions Gate Entertainment Corp	USD	(206.660)	30.999	0,00
LivaNova PLC	USD	(55.566)	15.003	0,00
Live Nation Entertainment Inc	USD	(168.231)	(223.747)	(0,01)
Loews Corp	USD	(134.043)	(88.468)	(0,01)
lululemon athletica Inc	USD	(24.063)	125.849	0,01
M&T Bank Corp	USD	(23.506)	5.171	0,00
Macy's Inc	USD	(43.295)	(61.912)	(0,00)
Manitowoc Foodservice Inc	USD	(225.463)	108.222	0,01
Marathon Oil Corp	USD	(94.823)	(156.455)	(0,01)
Markel Corp	USD	(2.994)	24.730	0,00
Marsh & McLennan Cos Inc	USD	(112.581)	(68.674)	(0,00)
MasterCard Inc	USD	(53.548)	(68.541)	(0,00)
Maxim Integrated Products Inc	USD	(18.858)	(22.630)	(0,00)
MAXIMUS Inc	USD	(20.455)	13.909	0,00
McDonald's Corp	USD	(29.563)	(5.321)	(0,00)
MDU Resources Group Inc	USD	(138.024)	(176.671)	(0,01)
Mead Johnson Nutrition Co	USD	(109.872)	(134.044)	(0,01)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Short-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
MEDNAX Inc	USD	(28.539)	(27.112)	(0,00)
Medtronic PLC	USD	(39.362)	11.415	0,00
Mercury General Corp	USD	(33.870)	(34.886)	(0,00)
Mettler-Toledo International Inc	USD	(3.623)	(39.382)	(0,00)
MGM Resorts International	USD	(70.928)	(65.254)	(0,00)
Microchip Technology Inc	USD	(23.944)	(34.479)	(0,00)
Micron Technology Inc	USD	(39.150)	(28.971)	(0,00)
Microsemi Corp	USD	(29.549)	3.546	0,00
Mondelez International Inc	USD	(58.424)	(20.474)	(0,00)
Monster Beverage Corp	USD	(23.652)	45.175	0,00
Moody's Corp	USD	(18.316)	(1.832)	(0,00)
Motorola Solutions Inc	USD	(8.839)	(8.132)	(0,00)
Nabors Industries Ltd	USD	(337.108)	(805.688)	(0,05)
National Fuel Gas Co	USD	(8.029)	7.607	0,00
National Instruments Corp	USD	(100.630)	(84.529)	(0,01)
National Oilwell Varco Inc	USD	(57.111)	(274.704)	(0,02)
NCR Corp	USD	(30.014)	(11.105)	(0,00)
NetApp Inc	USD	(62.149)	20.509	0,00
Netflix Inc	USD	(72.467)	73.916	0,00
NetScout Systems Inc	USD	(163.486)	(11.444)	(0,00)
NetSuite Inc	USD	(2.326)	(1.372)	(0,00)
Neurocrine Biosciences Inc	USD	(86.670)	340.613	0,02
New Jersey Resources Corp	USD	(14.918)	13.634	0,00
Newell Brands Inc	USD	(55.212)	(50.795)	(0,00)
Newmont Mining Corp	USD	(21.257)	(23.170)	(0,00)
Nielsen Holdings PLC	USD	(17.063)	(21.841)	(0,00)
NIKE Inc	USD	(23.499)	62.195	0,00
Noble Energy Inc	USD	(31.767)	(59.087)	(0,00)
Nordson Corp	USD	(34.486)	(66.903)	(0,00)
NorthStar Asset Management Group Inc	USD	(152.556)	(44.241)	(0,00)
Norwegian Cruise Line Holdings Ltd	USD	(15.742)	(29.752)	(0,00)
NOW Inc	USD	(16.606)	(29.813)	(0,00)
Occidental Petroleum Corp	USD	(89.104)	(137.220)	(0,01)
Ocwen Financial Corp	USD	(29.800)	0	0,00
Office Depot Inc	USD	(283.972)	19.878	0,00
OGE Energy Corp	USD	(327.865)	(68.852)	(0,00)
Oil States International Inc	USD	(35.109)	(102.167)	(0,01)
Old Dominion Freight Line Inc	USD	(34.398)	42.654	0,00
Olin Corp	USD	(141.151)	(194.788)	(0,01)
Owens-Illinois Inc	USD	(254.027)	(279.430)	(0,02)
PacWest Bancorp	USD	(68.460)	(5.477)	(0,00)
Palo Alto Networks Inc	USD	(63.418)	(428.706)	(0,03)
Pandora Media Inc	USD	(362.290)	(264.472)	(0,02)
Panera Bread Co	USD	(8.379)	64.016	0,00
Parsley Energy Inc	USD	(6.995)	(1.650)	(0,00)
Patterson Cos Inc	USD	(94.376)	26.425	0,00
Paychex Inc	USD	(27.304)	36.860	0,00
PayPal Holdings Inc	USD	(98.691)	(43.424)	(0,00)
PBF Energy Inc	USD	(35.693)	53.746	0,00
PerkinElmer Inc	USD	(9.246)	(13.961)	(0,00)
Perrigo Co PLC	USD	(39.799)	49.351	0,00
Pitney Bowes Inc	USD	(78.771)	(20.480)	(0,00)
Platform Specialty Products Corp	USD	(454.293)	363.434	0,02
Polaris Industries Inc	USD	(6.433)	(24.478)	(0,00)
PPL Corp	USD	(151.373)	40.871	0,00
Praxair Inc	USD	(50.697)	(79.087)	(0,01)
Premier Inc	USD	(124.427)	(23.641)	(0,00)
Prestige Brands Holdings Inc	USD	(8.690)	(2.350)	(0,00)
Primerica Inc	USD	(28.063)	83.628	0,01
Principal Financial Group Inc	USD	(57.189)	(120.669)	(0,01)
Prosperity Bancshares Inc	USD	(32.815)	(12.798)	(0,00)
PTC Inc	USD	(43.939)	(27.682)	(0,00)
PulteGroup Inc	USD	(74.840)	11.226	0,00
QIAGEN NV	USD	(152.978)	(134.621)	(0,01)
Qorvo Inc	USD	(16.241)	35.243	0,00
Quanta Services Inc	USD	(53.675)	(130.430)	(0,01)
Range Resources Corp	USD	(53.116)	(24.433)	(0,00)
Red Hat Inc	USD	(31.775)	(137.268)	(0,01)
Regeneron Pharmaceuticals Inc	USD	(4.295)	42.177	0,00
ResMed Inc	USD	(18.378)	(23.524)	(0,00)
Restoration Hardware Holdings Inc	USD	(165.368)	62.840	0,00
Rice Energy Inc	USD	(22.439)	35.229	0,00
Robert Half International Inc	USD	(30.970)	(12.388)	(0,00)
Rockwell Collins Inc	USD	(20.413)	(56.340)	(0,00)
Rollins Inc	USD	(70.606)	8.473	0,00
Roper Technologies Inc	USD	(28.721)	(126.660)	(0,01)
Royal Gold Inc	USD	(53.266)	(133.165)	(0,01)
RPC Inc	USD	(24.319)	(41.089)	(0,00)
RR Donnelley & Sons Co	USD	(41.826)	10.875	0,00
Sabre Corp	USD	(29.922)	(34.279)	(0,00)
salesforce.com Inc	USD	(85.898)	143.450	0,01
Sally Beauty Holdings Inc	USD	(87.885)	77.339	0,00
Santander Consumer USA Holdings Inc	USD	(113.455)	(113.455)	(0,01)
SBA Communications Corp	USD	(58.128)	(69.172)	(0,00)
Schlumberger Ltd	USD	(36.374)	(77.477)	(0,01)
Seagate Technology PLC	USD	(70.053)	(155.518)	(0,01)
Sealed Air Corp	USD	(136.820)	65.674	0,00
Seattle Genetics Inc	USD	(61.834)	104.499	0,01
SEI Investments Co	USD	(14.798)	6.675	0,00
Sempra Energy	USD	(122.347)	51.386	0,00
Sensata Technologies Holding NV	USD	(152.408)	50.295	0,00
ServiceMaster Global Holdings Inc	USD	(45.497)	41.402	0,00
ServiceNow Inc	USD	(65.845)	(161.320)	(0,01)
Signature Bank	USD	(15.139)	(25.872)	(0,00)
Signet Jewelers Ltd	USD	(17.288)	77.277	0,00
Silgan Holdings Inc	USD	(20.843)	(26.679)	(0,00)
Silicon Laboratories Inc	USD	(9.756)	(23.219)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (-verlust) in USD	% des Netto- vermögens
Short-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Sirius XM Holdings Inc	USD	(1.424.347)	(35.609)	(0,00)
Six Flags Entertainment Corp	USD	(71.199)	(81.879)	(0,01)
SLM Corp	USD	(650.071)	(52.006)	(0,00)
SM Energy Co	USD	(38.342)	(208.197)	(0,01)
Snyder's-Lance Inc	USD	(57.977)	22.611	0,00
Sotheby's	USD	(86.286)	11.217	0,00
Southwestern Energy Co	USD	(122.243)	48.897	0,00
Spirit Airlines Inc	USD	(41.193)	(168.067)	(0,01)
Splunk Inc	USD	(106.363)	138.272	0,01
Sprouts Farmers Market Inc	USD	(195.813)	5.874	0,00
SPX Corp	USD	(59.969)	(25.187)	(0,00)
Staples Inc	USD	(201.236)	32.198	0,00
Starbucks Corp	USD	(112.614)	(84.560)	(0,01)
Stericycle Inc	USD	(58.980)	(123.858)	(0,01)
Stifel Financial Corp	USD	(60.227)	38.545	0,00
SunPower Corp	USD	(63.753)	(64.391)	(0,00)
Superior Energy Services Inc	USD	(259.763)	(524.721)	(0,03)
SVB Financial Group	USD	(71.532)	(31.474)	(0,00)
Symantec Corp	USD	(34.666)	(9.013)	(0,00)
Synovus Financial Corp	USD	(96.909)	40.702	0,00
T Rowe Price Group Inc	USD	(14.485)	12.674	0,00
Tableau Software Inc	USD	(65.427)	654	0,00
Targa Resources Corp	USD	(81.260)	(114.577)	(0,01)
TCF Financial Corp	USD	(55.400)	10.526	0,00
Tempur Sealy International Inc	USD	(88.847)	1.948.415	0,13
Tenet Healthcare Corp	USD	(179.885)	194.276	0,01
Teradata Corp	USD	(113.221)	(73.594)	(0,00)
TerraForm Power Inc	USD	(7.553)	(3.323)	(0,00)
The Charles Schwab Corp	USD	(133.919)	(20.088)	(0,00)
The Coca-Cola Co	USD	(77.857)	3.114	0,00
The Estee Lauder Cos Inc	USD	(12.814)	(6.151)	(0,00)
The Gap Inc	USD	(66.024)	85.831	0,01
The Hain Celestial Group Inc	USD	(96.907)	(11.629)	(0,00)
The Hershey Co	USD	(34.223)	9.240	0,00
The Madison Square Garden Co	USD	(9.700)	55.290	0,00
The Middleby Corp	USD	(34.785)	19.480	0,00
The Priceline Group Inc	USD	(3.439)	(81.745)	(0,01)
The Wendy's Co	USD	(77.167)	4.630	0,00
The Williams Cos Inc	USD	(192.282)	(99.987)	(0,01)
Thermo Fisher Scientific Inc	USD	(3.666)	(27.348)	(0,00)
Tiffany & Co	USD	(64.345)	(42.468)	(0,00)
Time Inc	USD	(63.157)	12.631	0,00
Toll Brothers Inc	USD	(67.362)	(4.042)	(0,00)
Tractor Supply Co	USD	(28.686)	10.658	0,00
TransDigm Group Inc	USD	(26.861)	(125.172)	(0,01)
TreeHouse Foods Inc	USD	(39.943)	(17.974)	(0,00)
TRI Pointe Group Inc	USD	(37.325)	(15.677)	(0,00)
Trimble Navigation Ltd	USD	(133.444)	(222.851)	(0,01)
TripAdvisor Inc	USD	(50.978)	(165.679)	(0,01)
Triumph Group Inc	USD	(89.576)	51.058	0,00
Twenty-First Century Fox Inc	USD	(91.829)	(19.284)	(0,00)
Twitter Inc	USD	(207.672)	(944.908)	(0,06)
Tyler Technologies Inc	USD	(4.216)	11.899	0,00
Ultimate Software Group Inc	USD	(13.560)	13.424	0,00
Umpqua Holdings Corp	USD	(49.171)	5.409	0,00
Under Armour Inc	USD	(114.698)	2.294	0,00
Union Pacific Corp	USD	(69.597)	(286.044)	(0,02)
United Rentals Inc	USD	(32.020)	60.838	0,00
United Technologies Corp	USD	(34.618)	(24.579)	(0,00)
Urban Outfitters Inc	USD	(53.013)	72.628	0,00
USG Corp	USD	(69.649)	52.237	0,00
Valley National Bancorp	USD	(224.888)	(64.093)	(0,00)
VCA Inc	USD	(24.245)	11.153	0,00
Veeva Systems Inc	USD	(100.561)	(128.718)	(0,01)
VeriFone Systems Inc	USD	(127.878)	43.479	0,00
Verisk Analytics Inc	USD	(7.106)	(4.548)	(0,00)
Vertex Pharmaceuticals Inc	USD	(67.080)	500.417	0,03
VF Corp	USD	(49.794)	27.885	0,00
Viasat Inc	USD	(4.234)	(2.061)	(0,00)
Viavi Solutions Inc	USD	(107.363)	15.568	0,00
Visa Inc	USD	(39.609)	30.889	0,00
Vista Outdoor Inc	USD	(24.612)	(9.211)	(0,00)
Visteon Corp	USD	(3.724)	5.698	0,00
WABCO Holdings Inc	USD	(30.672)	(210.103)	(0,01)
Waddell & Reed Financial Inc	USD	(21.546)	5.602	0,00
Walgreens Boots Alliance Inc	USD	(86.784)	124.969	0,01
Webster Financial Corp	USD	(113.131)	7.752	0,00
WEC Energy Group Inc	USD	(30.116)	(91.854)	(0,01)
WESCO International Inc	USD	(27.349)	(91.893)	(0,01)
Western Digital Corp	USD	(34.278)	(2.057)	(0,00)
WestRock Co	USD	(32.978)	(100.253)	(0,01)
WEX Inc	USD	(516.400)	(877.880)	(0,06)
Whiting Petroleum Corp	USD	(131.478)	77.572	0,00
Whole Foods Market Inc	USD	(22.048)	(14.111)	(0,00)
Williams-Sonoma Inc	USD	(464.805)	404.380	0,03
Wisdom Tree Investments Inc	USD	(65.170)	(155.105)	(0,01)
Workday Inc	USD	(70.415)	(73.232)	(0,00)
WR Grace & Co	USD	(7.350)	(18.669)	(0,00)
WW Grainger Inc	USD	(27.810)	254.461	0,02
Wynn Resorts Ltd	USD	(4.188)	(3.727)	(0,00)
Xilinx Inc	USD	(144.600)	41.934	0,00
Yahoo! Inc	USD	(59.667)	(248.811)	(0,02)
Yelp Inc	USD	(52.743)	(95.465)	(0,01)
Yum! Brands Inc	USD	(115.683)	(13.882)	(0,00)
Zayo Group Holdings Inc	USD	(77.441)	(27.879)	(0,00)
Zebra Technologies Corp	USD	(18.936)	(20.831)	(0,00)

AQR UCITS FUNDS

AQR Style Premia UCITS Fund

Anlagenbestand (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016 in USD angegeben

Referenzwert	Währung	Aktien	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) in USD	% des Nettovermögens
Short-Positionen (Fortsetzung)				
Stammaktien (Fortsetzung)				
Vereinigte Staaten (Fortsetzung)				
Zions Bancorporation	USD	(219.520)	(129.517)	(0,01)
Zoetis Inc	USD	(126.091)	(94.568)	(0,01)
Zynga Inc	USD	(713.900)	21.417	0,00
			(10.541.455)	(0,69)
Total Short-Positionen			(11.179.321)	(0,73)
Total Long- und Short-Positionen				
Nettobarmittel und sonstige Forderungen/(Verbindlichkeiten)				
			(909.063)	(0,06)
			(5.501.793)	(0,36)
Total Total-Return-Basket-Swap - Goldman Sachs International - USD			(6.410.856)	(0,42)

AQR UCITS FUNDS

Veränderung der im Umlauf befindlichen Anteile (ungeprüft)
Zum 30. September 2016

Anteilkategorie	Anzahl Anteile im Umlauf am 31. März 2016	Ausgegebene Anteile	Zurückgenommene Anteile	Umgetauschte Anteile	Anzahl Anteile im Umlauf am 30.09.2016
AQR Emerging Equities UCITS Fund					
Klasse A2	1.234.880	23.779	(232.019)	-	1.026.640
Klasse B2	4.075	16.737	-	-	20.812
Klasse B3	515.100	-	-	-	515.100
Klasse C2	1.955.776	81.697	(43.048)	-	1.994.425
Klasse E	1.949.146	51.002	(80.848)	-	1.919.300
AQR Global Core Equity UCITS Fund					
Klasse B3	785.579	91	-	-	785.670
AQR Global Defensive Equity UCITS Fund					
Klasse A1	1.043	36.720	-	-	37.763
Klasse B3	1.989.269	83	-	-	1.989.352
Klasse C1	-	6.656	(1.021)	-	5.635
AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund					
Klasse A2	200.000	89	-	-	200.089
Klasse C2	-	270.000	-	-	270.000
AQR Global Risk Parity UCITS Fund					
Klasse A1	49.514	7.863	(4.472)	-	52.905
Klasse B1	488.466	157.430	(17.785)	-	628.111
Klasse C1	242.930	-	-	-	242.930
Klasse C2	1.983.970	13.532	-	-	1.997.502
Klasse C3	454.463	-	-	-	454.463
Klasse F	2.208.116	-	-	-	2.208.116
AQR Managed Futures UCITS Fund					
Klasse A	218.405	757.198	(112.267)	-	863.336
Klasse B	648.726	19.847	(71.847)	-	596.726
Klasse C	186.190	71.613	(6.319)	-	251.484
Klasse D	30.000	2.350	-	-	32.350
Klasse E	7.550	481.199	-	-	488.749
Klasse F	673.888	112.579	(9.623)	-	776.844
Klasse H2	97.084	23.720	(4.335)	-	116.469
Klasse J	300	469	-	-	769
Klasse K	455	31	-	-	486
Klasse L	-	500	(500)	-	-
AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund*					
Klasse A1	-	34.720	(79)	-	34.641
Klasse A2	-	2.500	-	-	2.500
Klasse A3	-	1.000.000	-	-	1.000.000

AQR UCITS FUNDS

Veränderung der im Umlauf befindlichen Anteile (ungeprüft) (Fortsetzung)
Zum 30. September 2016

Anteilsklasse	Anzahl Anteile im Umlauf am 31. März 2016	Ausgegebene Anteile	Zurückgenommene Anteile	Umgetauschte Anteile	Anzahl Anteile im Umlauf am 30.09.2016
AQR Style Premia UCITS Fund					
Klasse A	608.187	141.138	(319.426)	-	429.899
Klasse B	2.940.127	1.133.157	(230.977)	-	3.842.307
Klasse C	104.392	64.862	-	-	169.254
Klasse D	4.626	9.267	-	-	13.893
Klasse E	1.702.739	698.993	(570)	-	2.401.162
Klasse F	650.244	248.670	(79.091)	(86)	819.737
Klasse G	1.100.500	350.592	(350.500)	-	1.100.592
Klasse I	64.725	7.450	(6.204)	-	65.971
Klasse J	21.482	2.886	(573)	-	23.795
Klasse K	1.666.692	1.571.158	(93.066)	94	3.144.878
Klasse M	177.773	82.380	-	-	260.153
Klasse N	116.631	6.908	-	-	123.539

*Teilfonds aufgelegt am 2. Juni 2016

AQR UCITS FUNDS

Statistische Informationen (ungeprüft)

	Währung	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
AQR Emerging Equities UCITS Fund				
Gesamtnettovermögen	USD	731.602.685	682.728.818	603.662.312
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse A1	USD	-	-	111,53
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse A1		-	-	316.002
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse A2	USD	96,21	87,99	101,80
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse A2		1.026.640	1.234.880	255.608
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse B2	EUR	113,21	101,76	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse B2		20.812	4.075	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse B3	EUR	116,62	104,80	128,79
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse B3		515.100	515.100	561.352
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse C2	GBP	118,72	98,13	110,32
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse C2		1.994.425	1.955.776	1.044.000
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse E	EUR	118,70	106,30	129,74
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse E		1.919.300	1.949.146	2.115.052
AQR Global Core Equity UCITS Fund				
Gesamtnettovermögen	USD	97.005.696	94.701.531	98.310.544
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse B3	EUR	110,15	105,70	116,60
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse B3		785.670	785.579	785.579
AQR Global Defensive Equity UCITS Fund				
Gesamtnettovermögen	USD	273.208.175	255.562.479	24.227.268
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse A1	USD	107,08	102,03	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse A1		37.763	1.043	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse B3	EUR	120,32	112,60	115,75
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse B3		1.989.352	1.989.269	195.039
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse C1	USD	115,67	-	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse C1		5.635	-	-
AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund				
Gesamtnettovermögen	USD	63.693.583	21.604.401	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse A2	USD	112,92	108,02	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse A2		200.089	200.000	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse C2	USD	117,22	-	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse C2		270.000	-	-
AQR Global Risk Parity UCITS Fund				
Gesamtnettovermögen	USD	736.918.216	706.715.817	750.243.840
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse A1	USD	110,54	101,90	110,84
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse A1		52.905	49.514	61.849
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse B1	EUR	109,75	101,86	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse B1		628.111	488.466	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse C1	GBP	110,88	102,31	111,27
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse C1		242.930	242.930	481.289
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse C2	GBP	111,11	102,50	111,38
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse C2		1.997.502	1.983.970	1.845.375
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse C3	GBP	111,18	102,54	111,37
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse C3		454.463	454.463	454.463
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse E1	EUR	-	-	108,62
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse E1		-	-	292.017
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse F	EUR	107,06	99,31	108,68
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse F		2.208.116	2.208.116	2.154.970
AQR Managed Futures UCITS Fund				
Gesamtnettovermögen	USD	362.203.194	236.627.037	100.765.406
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse A	USD	104,72	104,41	114,65
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse A		863.336	218.405	14.540
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse B	EUR	103,56	103,76	114,56
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse B		596.726	648.726	1.300
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse C	GBP	97,35	96,64	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse C		251.484	186.190	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse D	CHF	95,54	96,00	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse D		32.350	30.000	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse E	EUR	97,95	98,24	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse E		488.749	7.550	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse F	GBP	105,82	104,99	114,78
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse F		776.844	673.888	582.888
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse H2	NOK	479,84	478,08	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse H2		116.469	97.084	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse J	EUR	99,90	100,12	-

AQR UCITS FUNDS

Statistische Informationen (ungeprüft) (Fortsetzung)

	Währung	30. September 2016	31. März 2016	31. März 2015
AQR Managed Futures UCITS Fund (Fortsetzung)				
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse J		769	300	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse K	GBP	100,78	100,03	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse K		486	455	-
AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund*				
Gesamtnettovermögen	USD	109.960.426	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse A1	USD	102,34	-	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse A1		34.641	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse A2	USD	106,87	-	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse A2		2.500	-	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse A3	USD	106,15	-	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse A3		1.000.000	-	-
AQR Style Premia UCITS Fund				
Gesamtnettovermögen	USD	1.535.677.722	1.194.388.708	266.960.748
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse A	USD	108,11	109,78	101,68
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse A		429.899	608.187	74.269
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse B	EUR	107,63	109,96	101,69
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse B		3.842.307	2.940.127	781.070
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse C	GBP	109,46	111,08	102,45
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse C		169.254	104.392	112.653
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse D	CHF	107,70	110,28	102,62
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse D		13.893	4.626	2.839
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse E	EUR	108,41	110,71	102,54
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse E		2.401.162	1.702.739	509.876
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse F	GBP	109,44	111,00	102,42
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse F		819.737	650.244	120.000
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse G	EUR	108,72	111,30	102,14
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse G		1.100.592	1.100.500	750.000
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse I	USD	100,53	102,26	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse I		65.971	64.725	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse J	EUR	96,92	99,19	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse J		23.795	21.482	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse K	GBP	100,73	102,39	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse K		3.144.878	1.666.692	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse M	USD	95,87	97,31	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse M		260.153	177.773	-
Nettoinventarwert pro Anteil - Klasse N	CHF	94,87	97,09	-
Anzahl Anteile im Umlauf - Klasse N		123.539	116.631	-

*Teilfonds aufgelegt am 2. Juni 2016

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft)

1. Allgemeine Informationen

(a) Die „Gesellschaft“

AQR UCITS Funds (die „Gesellschaft“) wurde am 12. Dezember 2011 als Investmentgesellschaft mit variablem Kapital („SICAV“) nach luxemburgischem Recht auf unbestimmte Zeit gegründet. Die Gesellschaft unterliegt den Bestimmungen von Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 (in seiner jeweils gültigen Fassung) über die Organismen für gemeinsame Anlagen. Die Satzung der Gesellschaft wurde im Mémorial C „Recueil des Sociétés et Associations“ des Großherzogtums Luxemburg veröffentlicht und die Gesellschaft ist unter der Nummer B 165881 im Handels- und Gesellschaftsregister in Luxemburg eingetragen.

Die Gesellschaft ist als Umbrella-Fonds mit mehreren Teifonds (die "Teifonds") strukturiert, um den Anlegern verschiedene Anlagestrategien anbieten zu können. Jeder Teifonds gibt eigene Anteilklassen aus und verfügt über ein eigenes Portfolio aus Wertpapieren, Barmitteln und anderen Anlagen. Der Verwaltungsrat ist ermächtigt, die Auflegung zusätzlicher Teifonds und Anteilklassen zu veranlassen.

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft hat FundRock Management Company S.A. zur Verwaltungsgesellschaft bestellt. Die Verwaltungsgesellschaft hat AQR Capital Management, LLC zum Anlageverwalter der Gesellschaft bestimmt (durch Übertragung der Befugnisse). Der Anlageverwalter investiert die Vermögen der aktiven Teifonds gemäß deren individuellen Anlagezielen und Anlagepolitiken.

Der Anlageverwalter hat UBS Global Asset Management (Americas) Inc. zum Unteranlageverwalter folgender Teifonds bestellt: AQR Global Risk Parity UCITS Fund, AQR Managed Futures UCITS Fund und AQR Style Premia UCITS Fund. Der Unteranlageverwalter erbringt dem Anlageverwalter Anlageverwaltungs- und Beratungsdienstleistungen für die Anlage der Barmittel dieser Teifonds und er wird direkt vom Anlageverwalter gemäß dem Vertrag über die Unteranlageverwaltung vergütet. Den Teifonds werden keine Gebühren belastet, die im Zusammenhang mit vom Unteranlageverwalter erbrachten Leistungen stehen.

(b) Die Teifonds

Am 30. September 2016 besteht die Gesellschaft aus acht aktiven Teifonds:

Teifonds	Auflegungsdatum
AQR Emerging Equities UCITS Fund	13. Dezember 2013
AQR Global Core Equity UCITS Fund	2. Dezember 2014
AQR Global Defensive Equity UCITS Fund	2. Dezember 2014
AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund	15. Januar 2016
AQR Global Risk Parity UCITS Fund	28. August 2012
AQR Managed Futures UCITS Fund	1. Oktober 2014
AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund	2. Juni 2016
AQR Style Premia UCITS Fund	1. Oktober 2014

Das Anlageziel des AQR Emerging Equities UCITS Fund ist das Erzielen einer Outperformance gegenüber dem Morgan Stanley Capital International Inc. Emerging Markets Total Return Index with Net Dividends Un-hedged in USD (der „Vergleichsindex“) von durchschnittlich 200 Basispunkten pro Kalenderjahr (nach Gebühren) über einen vollständigen Marktzyklus. Der Teifonds baut sein Anlagenportfolios anhand von Vermögensallokations- und Aktienselektionsmodellen auf und stützt sich dabei auf eine Reihe von verschiedenen Bewertungs-, Kurzmomentum-, wirtschaftlichen und anderen Faktoren. Im Allgemeinen können bei der Verwaltung des Teifondsvermögens die Wertpapiere, Sektoren, Länder und Währungen im Portfolio gegenüber dem Vergleichsindex sowohl unter- als auch übergewichtet werden.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

1. Allgemeine Informationen (Fortsetzung)

(b) Die Teifonds (Fortsetzung)

Das Anlageziel des AQR Global Core Equity UCITS Fund ist das Erwirtschaften eines langfristigen Kapitalzuwachses. Dazu investiert der Teifonds in Aktien und aktienähnliche Wertpapiere von attraktiv bewerteten Unternehmen mit positivem Kursmomentum und einer stabilen Geschäftsentwicklung.

Das Anlageziel des AQR Global Defensive Equity UCITS Fund ist die Erzielung einer Gesamtrendite. Der Teifonds verfolgt eine "defensive" Anlagestrategie und beabsichtigt mit aktiver Aktienauswahl, Risikomanagement und Diversifikation ein Wertsteigerungspotential mit Schutz gegen Kursverluste zu bieten.

Der AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund strebt mit Anlagen in internationalen Aktien und Barmitteln eine Outperformance gegenüber dem MSCI World Total Return Index, (Net), U.S. Dollar Un-hedged an.

Der AQR Global Risk Parity UCITS Fund ist bestrebt, ein breit diversifiziertes Engagement in globalen Risikoprämiens von Aktien, Staatsanleihen und Rohstoffindizes zu schaffen.

Das Anlageziel des AQR Managed Futures UCITS Fund ist die Generierung attraktiver risikobereinigter Renditen mit einer langfristig möglichst geringen Korrelation zu traditionellen Märkten. Der Teifonds beabsichtigt, durch die Anlage in ein diversifiziertes Portfolio aus Aktien, Währungen und festverzinslichen Instrumenten (sowohl Long- als auch Short-Positionen) ein Engagement und eine Performance zu erreichen, die durchschnittlich eine geringe Korrelation zu den Aktienmärkten aufweisen.

Der AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund ist bestrebt, eine risikobereinigte Outperformance gegenüber einer Teilmenge aus liquiden Wertpapieren des Bank of America Merrill Lynch U.S. High Yield Indexes zu erzielen. Der Teifonds versucht, einen gewissen Schutz gegen Kursverluste zu bieten und investiert zu diesem Zweck in Kredittitel und kreditbezogene Wertpapiere von attraktiv bewerteten Unternehmen mit positivem Kursmomentum, attraktivem Carry und stabiler Geschäftsentwicklung.

Das Anlageziel des AQR Style Premia UCITS Fund ist die Generierung hoher risikobereinigter Renditen mit einer geringstmöglichen Korrelation zu traditionellen Märkten. Der Teifonds beabsichtigt, vier verschiedene Anlagestrategien anzuwenden: die Value-, die Momentum-, die Carry- und die Defensive-Strategie. Der Teifonds legt in ein diversifiziertes Portfolio aus Aktien, festverzinslichen Instrumenten, Zinsen und Währungen (sowohl Long- als auch Short-Positionen) an.

(c) Die Anteile

Jeder Teifonds umfasst eine oder mehrere Anteilklassen. Jede Anteilkasse kann bezüglich einer Reihe von Kriterien (z. B. Zeichnung, Rücknahme, Mindestbeteiligung, Gebührenstruktur, Währung und Ausschüttungspolitik) andere Merkmale aufweisen. Die einzelnen Anteilklassen eines Teifonds müssen nicht auf die Referenzwährung des Teifonds lauten. Bei Anteilklassen, deren Währung nicht der Referenzwährung ihres Teifonds entspricht, kann der Anlageverwalter bestimmte Transaktionen zur Absicherung der Vermögenswerte gegen Währungsrisiken tätigen. Die am 30. September 2016 bei den einzelnen Teifonds verfügbaren Anteilklassen sind in der einschlägigen Ergänzung zum Prospekt aufgeführt.

2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze

(a) Darstellung des Abschlusses

Die Abschlüsse werden gemäß den in Luxemburg geltenden rechtlichen und regulatorischen Vorschriften für Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren erstellt.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

(b) Konsolidierter Abschluss

Der Abschluss der Gesellschaft wird in Euro erstellt, während die Abschlüsse der einzelnen Teifonds auf deren jeweilige Referenzwährung lauten. Die konsolidierte Nettovermögensaufstellung, die konsolidierte Erfolgsrechnung und die konsolidierte Veränderung des Nettovermögens geben die Summe des Nettovermögens bzw. der Erfolgsrechnung und Veränderung des Nettovermögens aller Teifonds wieder, umgerechnet in die Rechnungswährung der Gesellschaft zu dem am Ende der Berichtsperiode gültigen Wechselkurs bzw. zu dem für die Berichtsperiode festgelegten Durchschnittskurs.

(c) Bewertung der Anlagen

Der Abschluss wird auf der Grundlage des zum Ende der Berichtsperiode am 30. September 2016 zuletzt berechneten Nettoinventarwerts („NIW“) erstellt. Zur Berechnung des NIW werden die Wertpapiere im Portfolio sowie andere Derivate – wie im Prospekt festgelegt – anhand der zum Zeitpunkt der Berechnung letztbekannten beizulegenden Zeitwerte und Wechselkurse bewertet.

Die Anlagen der Gesellschaft werden wie folgt bewertet:

Die Bewertung der Wertpapiere, die an einer anerkannten Börse notiert sind oder an einem anderen geregelten Markt, der für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist, gehandelt werden, erfolgt zum letztvverfügbaren Schlusskurs an der Hauptbörsse der betreffenden Wertpapiere. Marktbedingt können gewisse Anlagen eines Teifonds an Märkten gehandelt werden, die eine relativ geringe Liquidität und/oder eine relativ starke Volatilität aufweisen. Abhängig von den Marktbedingungen können folglich der bewertete Preis und der beim Verkauf der jeweiligen Wertpapiere erzielbare Preis wesentlich voneinander abweichen.

Wie vom Verwaltungsrat als übliches Verfahren festgelegt und sofern er keine andere Bewertungsmethode bestimmt hat, können auf bestimmte, ausschließlich an einer ausländischen Börse in Asien gehandelte Beteiligungspapiere von einzelnen Teifonds tägliche Zeitwertfaktoren angewendet werden, die von einem unabhängigen Preisanbieter geliefert werden, um die Marktbewegungen in der Zeit zwischen dem Börsenschluss am ausländischen Markt und dem Börsenschluss am lokalen Markt (16 Uhr MEZ) einzuberechnen. Der Preisanbieter verwendet statistische Analysen und quantitative Modelle, um anhand von Faktoren wie spätere Preisbewegungen und Kursänderungen von Indizes, American Depository Receipts, Futures-Kontrakten und Wechselkursen an anderen Märkten die lokalen Marktpreise anzupassen und die beizulegenden Zeitwerte zum Zeitpunkt, an dem die Teifonds ihren NIW berechnen, zu bestimmten.

Die Bewertung von festverzinslichen Wertpapieren (ausgenommen solche mit kurzfristigen Laufzeiten unter 60 Tagen) und anderen Anlagen, die an nicht als aktiv geltenden Märkten gehandelt werden, erfolgt auf Basis von notierten Marktpreisen, Händler-Quotierungen oder alternativen Preisquellen. Zu diesen Wertpapieren gehören bestimmte amerikanische Staats- und Regierungsanleihen, die meisten Wertpapiere staatlicher Behörden, Investment-Grade-Unternehmensanleihen, Geldmarktfonds und weniger liquide notierte Aktien. Die Bewertung der Staats- und Unternehmensanleihen sowie der anderen festverzinslichen Instrumente erfolgt zum geschätzten beizulegenden Zeitwert, der anhand der letzten Geldkurse, anhand von evaluierten Preisen unabhängiger Preisanbieter oder Quotes von Gegenparteien und anderen Marktteilnehmern ermittelt wird. Evaluierte Preise werden anhand einer Matrix ermittelt, die Faktoren wie für identische oder ähnliche Anlagen, Renditen, Laufzeiten und Bewertungen notierte Preise berücksichtigen kann und nicht zwingend auf börsennotierte Preise angewiesen ist. Bestimmte kurzfristige Anlagefonds (darunter Anlagen in registrierten Geldmarktfonds sowie kurzfristige Schuldinstrumente von ausreichender Kreditqualität und mit einer Laufzeit unter 60 Tagen) werden in der Regel zu den fortgeführten Anschaffungskosten bewertet, die annähernd dem beizulegenden Zeitwert entsprechen. Bestimmte andere kurzfristige Anlagefonds (darunter Anlagen in nicht registrierten offenen Fonds von ausreichender Kreditqualität) werden anhand von Notierungen bewertet, die von unabhängigen Preisanbietern oder vom Anlageverwalter, von der Verwaltungs- oder der Transferstelle des betreffenden Fonds ermittelt werden.

Futures, die an nationalen Börsen notiert und frei übertragbar sind, werden zum beizulegenden Zeitwert angesetzt, der anhand des am Tag der Zeitwertbemessung an der Hauptbörsse festgestellten Geldkurses oder anhand des bei Börsenschluss an diesem Tag festgestellten Abrechnungspreises ermittelt wird. Die Bewertung von zentral abgewickelten Swaps, die in einem multilateralen Handelssystem notiert sind oder gehandelt werden (z. B. eine registrierte Börse), erfolgt täglich auf Basis von Notierungen, die von einem unabhängigen Preisanbieter gestellt werden. Bei Derivaten, die über eine Börse gehandelt und abgewickelt werden, wird in der Nettovermögensaufstellung nur die Variation Margin des laufenden Tages ausgewiesen.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

(c) Bewertung von Anlagen (Fortsetzung)

Außerbörslich gehandelte ("OTC") Derivate (einschließlich Forwardkontrakte und Swap-Kontrakte) werden von den Teilfonds anhand beobachtbarer Marktfaktoren (z. B. von unabhängigen Preisanbietern, Gegenparteien, Händlern oder Brokern gelieferte und als zuverlässig erachtete Notierungen) täglich bewertet.

Der Wert der einzelnen Total Return Swap-Kontrakte und Total Return Basket Swap-Kontrakte ergibt sich (soweit jeweils zutreffend) aus einer Kombination aus (i) dem Nettowert der zugrunde liegenden Positionen, die täglich anhand des letzten Verkaufs- oder Schlusskurses an der Hauptbörsse der betreffenden Wertpapiere bewertet werden; (ii) den Finanzierungskosten; (iii) dem Wert der Dividenden oder aufgelaufenen Zinsen; (iv) den Barsalden innerhalb des Swaps; und (v) anderen Faktoren.

Der beizulegende Zeitwert von Devisenterminkontrakten wird anhand aktueller Devisenterminkurse bestimmt, die von einem unabhängigen Preisanbieter geliefert werden.

Kreditausfall-Swaps und Zinsswaps werden anhand von Notierungen, die von einem unabhängigen Preisanbieter geliefert werden, täglich zum Marktwert bewertet. Die unabhängigen Preisanbieter berechnen für jeden einzelnen Kreditausfall-Swap und Zinsswap einen Referenzwert, indem sie von verschiedenen Marktteilnehmern Bewertungsinformationen einholen.

Stehen keine Notierungen zur Verfügung oder gelten die verfügbaren Notierungen als nicht repräsentativ für den beizulegenden Zeitwert, so werden die Wertpapiere und Finanzderivate zu einem beizulegenden Zeitwert angesetzt, der entweder vom Verwaltungsrat sorgfältig und in gutem Glauben geschätzt wird oder von einer kompetenten, vom Verwaltungsrat beauftragten Person gemäß den vom Verwaltungsrat festgelegten Bewertungsverfahren ermittelt wird. Die Verwendung des beizulegenden Zeitwerts zur Bewertung von Wertpapieren kann zu einem Wert führen, der vom letzten Schlusskurs des betreffenden Wertpapieres abweicht und sich auch von den Preisen unterscheidet, die andere offene Investmentgesellschaften zur Berechnung ihres Nettovermögens verwenden. Unter Umständen bestehen wesentliche Differenzen zwischen den geschätzten Werten und den Werten, die verwendet worden wären, wenn für die betreffenden Anlagen ein Markt bestanden hätte, sowie den Werten, die letztlich erzielt werden können.

Der Wert von Wertpapieren, die nicht an einem geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, oder die derart notiert sind, entspricht dem wahrscheinlichen Veräußerungswert, der sorgfältig und in gutem Glauben vom Verwaltungsrat oder von einer kompetenten, vom Verwaltungsrat ausgewählten Person geschätzt wird.

Swing-Pricing-Mechanismus

Bei den Teilfonds kann eine Verwässerung des NIW pro Anteil entstehen, wenn Anleger Fondsanteile zu Preisen kaufen oder verkaufen, in denen die Handelsgebühren und weiteren Kosten, die anfallen, wenn der Anlageverwalter Wertpapiertransaktionen tätigt, um Mittelzu- und -abflüsse zu steuern, nicht berücksichtigt sind.

Um der Verwässerung entgegenzuwirken und die Interessen der Anteilinhaber zu schützen, hat der Verwaltungsrat einen Swing-Pricing-Mechanismus eingeführt: Wenn an einem Bewertungstag der für Anteilstransaktionen anfallende Nettop gesamtbetrag eines Teilfonds einen vorgegebenen Schwellenwert übersteigt, kann der NIW pro Anteil nach oben oder unten angepasst werden, um den Nettozuflüssen bzw. -abflüssen Rechnung zu tragen. Das Ausmaß der Preisadjustierung wird vom Verwaltungsrat festgelegt und entspricht den effektiven Handelsgebühren und sonstigen Kosten, die beim effektiven Kauf oder Verkauf von Vermögenswerten des Teilfonds entstehen. Sofern der Verwaltungsrat im Rahmen der Swing-Pricing-Strategie nichts anderes festgelegt hat, beträgt der Schwellenwert USD 10 Millionen oder 1 % vom NIW des Teilfonds am betreffenden Bewertungstag, je nachdem, welcher Betrag der kleinere ist. Der Schwellenwert wird vom Verwaltungsrat regelmäßig überprüft.

Gemäß Prospekt wurde der Swing-Pricing-Mechanismus in der Berichtsperiode zum 30. September 2016 beim AQR Emerging Equities UCITS Fund angewandt. Swing-Pricing wird im „Nettoerlös aus Anteilstransaktionen“ in der Aufstellung zur Veränderung des Nettovermögens ausgewiesen.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

(d) Bankguthaben

Unter Bankguthaben fallen auf Bankkonten hinterlegte Beträge in US-Dollar und Fremdwährungen, welche die versicherten Beträge überschreiten. Die Teilfonds unterliegen dem Risiko, dass die Bankinstitute ihre Verpflichtungen womöglich nicht erfüllen können.

(e) Forderungen/(Verbindlichkeiten) gegenüber Brokern

Unter Forderungen/(Verbindlichkeiten) gegenüber Brokern fallen die an die Broker oder Gegenparteien der Teilfonds verpfändeten oder von diesen erhaltenen Barbestände (einschließlich der für den Wertpapierhandel gehaltenen Barmittel) und die Barmittel, die als Sicherheiten für OTC-Derivatgeschäfte verpfändet oder entgegengenommen wurden. Für die Teilfonds entsteht ein Kreditrisiko, wenn die Gegenparteien ihre Verpflichtungen gegenüber den Teilfonds nicht erfüllen können.

Der AQR Emerging Equities UCITS Fund hatte am 30. September 2016 die folgenden Forderungen/(Verbindlichkeiten) für Sicherheitsleistungen gegenüber Brokern:

Broker	Total Forderungen/(Verbindlichkeiten) gegenüber Brokern
Bank of America, N.A.	\$8.990.880
Citibank, N.A.	\$(1.093.410)
Goldman Sachs & Co	\$5.990.545
JPMorgan Chase Bank N.A.	\$4.965.738

Der AQR Global Core Equity UCITS Fund hatte am 30. September 2016 die folgenden Forderungen/(Verbindlichkeiten) für Sicherheitsleistungen gegenüber Brokern:

Broker	Total Forderungen/(Verbindlichkeiten) gegenüber Brokern
Citibank, N.A.	\$956

Der AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund hatte am 30. September 2016 die folgenden Forderungen/(Verbindlichkeiten) für Sicherheitsleistungen gegenüber Brokern:

Broker	Total Forderungen/(Verbindlichkeiten) gegenüber Brokern
JPMorgan Chase Bank N.A.	\$24.100

Der AQR Global Risk Parity UCITS Fund hatte am 30. September 2016 die folgenden Forderungen/(Verbindlichkeiten) für Sicherheitsleistungen gegenüber Brokern:

Broker	Total Forderungen/(Verbindlichkeiten) gegenüber Brokern
Bank of America, N.A.	\$829.433
Barclays Capital Inc.	\$18.895.382
Citibank, N.A.	\$14.521.036
Goldman Sachs & Co	\$1.665.789
JPMorgan Chase Bank N.A.	\$23.619.920

Der AQR Managed Futures UCITS Fund hatte am 30. September 2016 die folgenden Forderungen/(Verbindlichkeiten) für Sicherheitsleistungen gegenüber Brokern:

Broker	Total Forderungen/(Verbindlichkeiten) bei Brokern
Bank of America, N.A.	\$1.997.886
Citibank, N.A.	\$5.548.061
Goldman Sachs & Co	\$1.412.198
JPMorgan Chase Bank N.A.	\$16.347.830

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

(e) Forderungen/(Verbindlichkeiten) gegenüber Brokern

Der AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund hatte am 30. September 2016 die folgenden Forderungen/(Verbindlichkeiten) für Sicherheitsleistungen bei Brokern:

Broker	Total Forderungen/(Verbindlichkeiten) gegenüber Brokern
Citibank, N.A.	\$ (5)

Der AQR Style Premia UCITS Fund hatte am 30. September 2016 die folgenden Forderungen/(Verbindlichkeiten) für Sicherheitsleistungen gegenüber Brokern:

Broker	Total Forderungen/(Verbindlichkeiten) gegenüber Brokern
Bank of America, N.A.	\$61.680.586
Citibank, N.A.	\$33.423.620
Goldman Sachs & Co	\$257.125.209
JPMorgan Chase Bank N.A.	\$70.051.660
Merrill Lynch International	\$27.460.000

Der AQR Global Defensive Equity UCITS Fund hatte am 30. September 2016 keine Forderungen/(Verbindlichkeiten) für Sicherheitsleistungen gegenüber Brokern:

(f) Einlagen bei/(von) Brokern für börsengehandelte und zentral abgewickelte Derivate

Ein Teilfonds kann über Clearingmitglieder indirekt Barmittel als Sicherheit für Futures und andere börsengehandelte und zentral abgewickelte Derivate an eine zentrale Clearingstelle verpfänden. Am Ende der Berichtsperiode werden die als Sicherheit an ein Clearingmitglied verpfändeten Barguthaben (ohne etwaige per Ende der Berichtsperiode ausstehende, einzufordernde/(zu entrichtende) Nachschussmargen) und der kumulierte Nettowertzuwachs(/-verlust) der börsengehandelten oder zentral abgewickelten Derivate als Einlage bei/(von) Brokern für börsengehandelte und zentral abgewickelte Derivate in der Nettovermögensaufstellung erfasst. Für die Teilfonds besteht dahingehend ein Kreditrisiko, dass die zentrale Clearingstelle ihre Verpflichtungen gegenüber den Teilfonds womöglich nicht erfüllen kann.

Am 30. September 2016 hielt der AQR Emerging Equities UCITS Fund folgende Einlagen bei/(von) Brokern:

Broker	Einlagen bei/(von) Brokern
Barclays Capital Inc.	\$4.787.612
J.P. Morgan Securities PLC	\$83.528

Am 30. September 2016 hatte der AQR Global Core Equity UCITS Fund folgende Einlagen bei/(von) Brokern:

Broker	Einlagen bei/(von) Brokern
J.P. Morgan Securities PLC	\$80.475

Am 30. September 2016 hatte der AQR Global Defensive Equity UCITS Fund folgende Einlagen bei/(von) Brokern:

Broker	Einlagen bei/(von) Brokern
J.P. Morgan Securities PLC	\$205.026

Am 30. September 2016 hatte der AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund folgende Einlagen bei/(von) Brokern:

Broker	Einlagen bei/(von) Brokern
Goldman Sachs & Co	\$6.310
J.P. Morgan Securities PLC	\$6.526

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

(f) Einlagen bei/(von) Brokern für börsengehandelte und zentral abgewickelte Derivate (Fortsetzung)

Am 30. September 2016 hatte der AQR Global Risk Parity UCITS Fund folgende Einlagen bei/(von) Brokern:

Broker	Einlagen bei/(von) Brokern
Barclays Capital Inc.	\$727.298
Goldman Sachs & Co	\$(594.666)
J.P. Morgan Securities PLC	\$11.280.640

Am 30. September 2016 hatte der AQR Managed Futures UCITS Fund folgende Einlagen bei/(von) Brokern:

Broker	Einlagen bei/(von) Brokern
Barclays Capital Inc.	\$1.659.879
J.P. Morgan Securities PLC	\$10.492.433

Am 30. September 2016 hatte der AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund folgende Einlagen bei/(von) Brokern:

Broker	Einlagen bei/(von) Brokern
Citibank, N.A.	\$1.080.765
J.P. Morgan Securities PLC	\$110.724

Am 30. September 2016 hatte der AQR Style Premia UCITS Fund folgende Einlagen bei/(von) Brokern:

Broker	Einlagen bei/(von) Brokern
Barclays Capital Inc.	\$39.951.461
Citibank, N.A.	\$19.718.435
J.P. Morgan Securities PLC	\$50.368.856

(g) Fremdwährungsumrechnung

Der konsolidierte Abschluss der Gesellschaft wird in Euro, der Referenzwährung der Gesellschaft erstellt. Die Einzelabschlüsse der Teilkosten werden in USD, der Referenzwährung der Teilkosten erstellt.

Alle in einer anderen als der Referenzwährung eines Teilkosten ausgedrückten Werte werden zu dem vom Verwaltungsrat als angemessen erachteten aktuellen Wechselkurs in die Referenzwährung des Teilkosten umgerechnet.

Erträge und Aufwendungen, die nicht in der Referenzwährung des Teilkosten ausgedrückt sind, werden zu den am Transaktionsdatum geltenden Wechselkursen in die Referenzwährung umgerechnet. Die Anschaffungskosten von Wertpapieren, die nicht auf die Referenzwährung des Teilkosten lauten, werden zu den am Kaufdatum geltenden Wechselkursen in die Referenzwährung umgerechnet. Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die nicht auf die Referenzwährung des Teilkosten lauten, werden zu den am Bilanzstichtag geltenden Wechselkursen umgerechnet.

Der Anteil am Geschäftsergebnis eines Teilkosten, welcher sich aus den Auswirkungen von Wechselkurschwankungen auf Anlagen und Derivate ergibt, wird nicht getrennt von den Wertveränderungen ausgewiesen, die durch Marktpreisschwankungen von Anlagen und Derivaten verursacht werden. Dementsprechend sind solche Fremdwährungsgewinne/(-verluste) in der Erfolgsrechnung in den Positionen „realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen und Derivaten“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses / (-verlusts) von Anlagen und Derivaten“ enthalten.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

(g) Fremdwährungsumrechnung (Fortsetzung)

Der in der Erfolgsrechnung ausgewiesene realisierte Nettogewinn/(-verlust) aus Fremdwährungsgeschäften setzt sich aus der Veräußerung von Fremdwährungen und der Differenz zwischen den bei den einzelnen Teifonds zum Transaktionszeitpunkt erfassten Beträgen für Dividenden, Zinsen und ausländische Quellensteuern und dem Gegenwert in USD der tatsächlich erhaltenen oder gezahlten Beträge. Die in der Erfolgsrechnung ausgewiesenen Nettoveränderungen des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus Fremdwährungsumrechnung setzen sich zusammen aus den durch Wechselkursveränderungen verursachten Wertänderungen von (1) den am Ende der Berichtsperiode gehaltenen Fremdwährungen und (2) den auf ausländische Währungen lautenden Vermögenswerten und Verbindlichkeiten (ausgenommen Anlagen).

Zur Umrechnung in USD der in anderen Währungen geführten Anlagen wurden folgende Wechselkurse verwendet:

Am 30. September 2016 wurden von den Teifonds die folgenden Wechselkurse angewandt:

1 USD =	1,305995 AUD	- Australischer Dollar
	3,250700 BRL	- Brasilianischer Real
	1,311000 CAD	- Kanadischer Dollar
	0,970850 CHF	- Schweizer Franken
	657,295000 CLP	- Chilenischer Peso
	6,670000 CNY	- Chinesischer Renminbi
	24,105000 CZK	- Tschechische Krone
	6,643800 DKK	- Dänische Krone
	0,892100 EUR	- Euro
	0,770060 GBP	- Pfund Sterling
	7,754100 HKD	- Hongkong-Dollar
	276,328100 HUF	- Ungarischer Forint
	13.051,000000 IDR	- Indische Rupie
	3,757900 ILS	- Israelischer Schekel
	101,265000 JPY	- Japanischer Yen
	1.101,350000 KRW	- Südkoreanischer Won
	19,420000 MXN	- Mexikanischer Peso
	4,135500 MYR	- Malaysischer Ringgit
	7,996700 NOK	- Norwegische Krone
	1,373626 NZD	- Neuseeland-Dollar
	48,495000 PHP	- Philippinischer Peso
	3,839350 PLN	- Polnischer Zloty
	8,592050 SEK	- Schwedische Krone
	1,363350 SGD	- Singapur-Dollar
	34,650000 THB	- Thailändischer Baht
	3,001600 TRY	- Türkische Lira
	31,345500 TWD	- Neuer Taiwan-Dollar
	13,805000 ZAR	- Südafrikanischer Rand

Das in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesene Gesamttotal aller Teifonds wurde zum folgenden Wechselkurs (gegenüber dem Euro) umgerechnet:

1 EUR = 1,120950 USD

Das in der Erfolgsrechnung sowie in der Veränderung des Nettovermögens ausgewiesene Gesamttotal aller Teifonds wurde zum folgenden Wechselkurs (gegenüber dem Euro) umgerechnet:

1 EUR = 1,242383 USD

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

(h) Anlagetransaktionen und damit zusammenhängende Erträge und Aufwendungen

Anlagetransaktionen werden am Handelstag (d.h. am Datum, an dem der Kauf-/Verkaufsauftrag ausgeführt wird) erfasst. Wertschriftenerträge und -verluste werden nach der Durchschnittskostenmethode ermittelt und enthalten die Transaktionskosten. Die Berechnung der Zinserträge erfolgt auf Basis der aufgelaufenen Kuponzinsen nach der Effektivzinsmethode unter Bereinigung um die Agio-Abschreibungen und Disagio-Zuschreibungen. Zinsaufwendungen werden täglich abgegrenzt und enthalten etwaige Agio-Abschreibungen und Disagio-Zuschreibungen. Die Dividendenerträge/(-aufwendungen) abzüglich allfälliger ausländischer Steuern werden am Ex-Dividendendatum oder zum Zeitpunkt, an dem der Teilfonds erstmals über das Ex-Dividendendatum informiert wird, erfasst. Auf Anleihen erworbene und ausgegebene Zinsen sind in der Nettovermögensaufstellung in den Posten Zinsverbindlichkeiten bzw. Zinsforderungen enthalten. Bei inflationsgeschützten Anleihen werden die auf den Nominalwert berechneten Zinserträge/(-aufwendungen) um Veränderungen des entsprechenden Verbraucherpreis-indexes bereinigt.

(i) Zuordnung von Erträgen und Aufwendungen

Bei der Berechnung des NIW pro Anteil der verschiedenen Anteilsklassen werden Erträge, nicht klassenspezifische Aufwendungen sowie realisierte und nicht realisierte Gewinne und Verluste täglich jeder Anteilsklasse im Verhältnis zu ihrem Anteil am Nettovermögen zu Tagesbeginn zugeordnet. Jedem Teifonds werden die ihm direkt zuzuschreibenden Aufwendungen verrechnet (z. B. Anlageverwaltungsgebühren, Registrierungskosten). Auf Gesellschaftsebene verursachte Aufwendungen werden auf die Teifonds im Verhältnis ihres Anteils am Gesamtnettovermögen oder nach einer anderen angemessenen Methode aufgeteilt.

Die erhaltenen Ausschüttungen, die über die Erträge der zugrunde liegenden Anlagen hinausgehen, werden von den Teifonds als Verringerung der Anlagekosten bzw. der realisierten Gewinne erfasst. Sind die effektiven Erträge nicht bekannt, werden solche Beträge geschätzt und die Schätzungen können von den tatsächlich Erträgen, den realisierten Wertzuwachsen und den Kapitalerträgen abweichen. Sobald die Emittenten über die effektive Zusammensetzung der Ausschüttungen informieren, passen die Teifonds die geschätzten Beträge der Ertragskomponenten (und folglich die Nettoanlageerträge) entsprechend an.

Die Teifonds unterliegen gegebenenfalls ausländischen Steuern auf Erträge, Kapitalgewinne aus Anlagen und Währungsrückführungen, von denen ein Teil womöglich rückerstattet wird. Die Teifonds berücksichtigen die an den von ihnen genutzten Märkten geltenden steuerrechtlichen Vorschriften, um die ihnen anfallenden sowie allfällig rückforderbare Steuern einzuschätzen.

Am Ende der Berichtsperiode zum 30. September 2016 fielen den einzelnen Teifonds folgende auf Wertpapiere erhobene ausländische Quellensteuern an:

Teifonds	Ausländische Quellensteuern
AQR Emerging Equities UCITS Fund	\$1.410.685
AQR Global Core Equity UCITS Fund	\$261.754
AQR Global Defensive Equity UCITS Fund	\$637.105
AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund	\$124.685

(j) Wertpapierleihgeschäfte

Zur Generierung zusätzlicher Einnahmen und zur Reduzierung von Kosten und Risiken kann der AQR Emerging Equities UCITS Fund im Ausmaß und unter Berücksichtigung der nachfolgend festgelegten Grenzen Wertpapierleihgeschäfte tätigen. Ausgeliehene Wertpapiere werden zu 102 %-105 % ihres Marktwertes durch Barmittel oder Wertpapiere besichert. Darlehen werden fortwährend durch eine den Besicherungsanforderungen entsprechende Sicherheit abgesichert. Der Teifonds kann ausgewählte Portfolio-Wertpapiere an namhafte spezialisierte Banken, Kreditinstitute und andere Finanzinstitute oder über anerkannte Clearingstellen verleihen.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

2. Wesentliche Rechnungslegungsgrundsätze (Fortsetzung)

(j) Wertpapierleihgeschäfte (Fortsetzung)

Der Teilfonds hält das Volumen der Wertpapierleihgeschäfte auf einem angemessenen Niveau und ist dazu berechtigt, die Rückgabe der ausgeliehenen Wertpapiere zu verlangen, um seinen Rücknahmeverpflichtungen jederzeit nachzukommen. Der Teilfonds stellt sicher, dass Wertpapierleihgeschäfte die Verwaltung seines Vermögens nach Maßgabe der Anlagepolitik nicht beeinträchtigen. Ein wesentlicher Teil der Erträge aus dem Wertpapierleihprogramm wird den teilnehmenden Teilfonds gutgeschrieben, der andere Teil wird an JP Morgan Chase Bank N.A. gezahlt, die von der Gesellschaft zum Ausführungsbeauftragten für Wertpapierleihgeschäfte bestellt wurde. Die Erträge aus Wertpapierleihgeschäften werden in der Erfolgsrechnung im Posten „Nettoertrag aus Wertpapierleihgeschäften“ ausgewiesen.

Am 30. September 2016 hatten die beim Ausführungsbeauftragten offenen Wertpapierleihgeschäfte folgenden Marktwert:

Teilfonds	Total Marktwert Wertpapierleihgeschäft	Erhaltene Sicherheiten	Art der Sicherheit
AQR Emerging Equities UCITS Fund	\$10.222.906	\$10.869.393	Wertpapiere*

* Gemäß den zwischen der Gesellschaft und dem Ausführungsbeauftragten vereinbarten Bedingungen für Wertpapierleihgeschäfte sind folgende Wertpapiere als Sicherheiten zulässig: US-Staatspapiere, Staatspapiere des Vereinigten Königreichs, Staatspapiere aus dem Euroraum und andere Staatspapiere. Zu den anderen Staatspapieren gehören Schatzwechsel, Anleihen und Schuldverschreibungen, die von einer Regierung der folgenden Länder ausgegeben oder deren Rückzahlung und Zinszahlungen von einer Regierung der folgenden Länder garantiert werden: Australien, Kanada, Dänemark, Japan, Neuseeland, Norwegen, Schweden und die Schweiz.

Für die Berichtsperiode zum 30. September 2016 wurden folgende Erträge/(Aufwendungen) aus Wertpapierleihgeschäften erzielt:

Teilfonds	Total Bruttoerträge/ (-aufwendungen) Wertpapierleihgeschäfte	Von den Bruttoerträgen/ (-aufwendungen) aus Wertpapierleihgeschäften abgezogene Kosten und Gebühren	Total Nettoerträge/ (-aufwendungen) aus Wertpapierleihgeschäften
AQR Emerging Equities UCITS Fund	\$30.363	\$(5.796)	\$24.567

3. Wertpapiere und andere Anlagen

(a) Inflationsgeschützte Anleihen

Bestimmte Teilfonds können in inflationsgeschützte Anleihen investieren, die regelmäßig um die Inflation angepasst werden, indem die Zinsabgrenzungen, der Nominalwert oder die Kapitalrückzahlungssumme entsprechend der durch einen Index gemessenen Inflationsrate erhöht oder gesenkt werden.

(b) Futures

Als Teil ihrer primären Anlagestrategie und zur Anlage überschüssiger Liquidität investieren bestimmte Teilfonds in Futures. Durch das Anlegen in Futures kann das Engagement in einem bestimmten Markt erhöht oder verringert werden. Sollte ein Terminbörsenmakler, der von Teilfonds geleistete Sicherheiten hält, in Konkurs gehen oder Insolvenz anmelden, können die Teilfonds womöglich keinen Anspruch auf vollständige Rückerstattung der von ihnen geleisteten Sicherheiten geltend machen, wodurch Verluste entstehen können. Eine Veränderung des Marktwertes eines offenen Futures-Kontrakts wird in der Erfolgsrechnung im Posten „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) auf Futures“ ausgewiesen. Wenn Futures glattgestellt oder fällig werden, wird die Differenz zwischen dem Wert der Kontrakte bei Abschluss und dem Wert zum Zeitpunkt ihrer Glattstellung oder Fälligkeit in der Erfolgsrechnung im Posten „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Futures“ erfasst.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

3. Wertpapiere und andere Anlagen (Fortsetzung)

(b) Futures (Fortsetzung)

Das Halten von Long-Positionen in Futures setzt die Teilfonds einem Verlustrisiko aus, das über die in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesenen Nachschüsse hinausgeht. Das Halten von Short-Positionen in Futures setzt die Teilfonds einem unbegrenzten Verlustrisiko aus. Allfällige am Ende der Berichtsperiode offene Futures-Kontrakte werden im Anlagenbestand jedes Teilfonds ausgewiesen.

(c) Devisenforwards

Devisenforwards sind Vereinbarungen zwischen zwei Parteien zum Kauf oder Verkauf von Fremdwährungen zu einem vereinbarten Preis und zu einem bestimmten zukünftigen Datum. Bestimmte Teilfonds können Devisenforwards kaufen oder verkaufen. Devisenforwards werden zur Absicherung gegen die Abwertung der Nennwährung von Wertpapieren im Anlagenportfolio im Verhältnis zum USD (oder gegen die Aufwertung der Nennwährung von Wertpapieren, die ein Teilfonds zu erwerben beabsichtigt, wenn ein Teilfonds Barmittelreserven und kurzfristige Anlagen hält) oder für andere Anlagezwecke eingesetzt. Der Wert der Devisenforwards in USD wird anhand aktueller Devisenterminkurse bestimmt, die von einem unabhängigen Preisanbieter ermittelt werden. Der Marktwert eines Forwardkontrakts schwankt mit den Wechselkursänderungen. Die Devisenforwards werden täglich zu Marktwerten neubewertet und die Marktwertveränderung wird als nicht realisierter Wertzuwachs oder Wertverlust erfasst. Bei Glattstellung des Kontrakts erfassen die Teilfonds einen realisierten Wertzuwachs oder Wertverlust in Höhe der Differenz zwischen dem Wert des Kontrakts bei Abschlusses und dem Wert des Kontrakts bei der Glattstellung.

Die Teilfonds können einem Risiko ausgesetzt sein, wenn sich die Währung ungünstig verändert, wenn die Gegenparteien die Vertragsbedingungen nicht erfüllen können oder wenn die Teilfonds den Kontrakt nicht glattstellen können. Die Risiken können die in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesenen Beträge übersteigen. Nicht lieferbare Devisenforwards werden in USD, ohne die Lieferung von Fremdwährung mit der Gegenpartei glattgestellt. Allfällige am Ende der Berichtsperiode offene Devisenforwards werden im Anlagenbestand jedes Teilfonds ausgewiesen.

(d) Swaps

Bestimmte Teilfonds können zur Risikoverwaltung im Portfolio oder als Alternative zu Direktanlagen Swapgeschäfte tätigen. Swapgeschäfte können am OTC-Markt, in dem Zahlungen direkt zwischen dem Teilfonds und der Gegenpartei erfolgen, privat ausgehandelt werden. Im Gegensatz dazu läuft bei anderen Swapgeschäften die Abwicklung zwingend über zentrale Clearingstellen („zentral abgewickelte Swaps“). Solche Swapgeschäfte werden durch eine Derivate-Clearingstelle, die in treuhänderischer Eigenschaft handelt, über eine zentrale Gegenpartei abgewickelt, wobei alle Zahlungen über diese beiden Stellen erfolgen.

Durch das Tätigen von Swapgeschäften können Risiken entstehen, die zusätzlich zu jenen anfallen, die bei der Direktanlage in die zugrunde liegenden Positionen auftreten. Dazu gehören: Marktrisiken hinsichtlich ungünstiger Zins- oder Preisänderungen der zugrunde liegenden Sicherheit(en); Kreditrisiken hinsichtlich Nichteinhaltung der Vertragsbedingungen durch die Gegenpartei; sowie Liquiditätsrisiken hinsichtlich des Fehlens eines liquiden Marktes für Swapgeschäfte, was dem Teilfonds die Glattstellung von Positionen erschweren kann.

(e) Total-Return-Swaps

Bestimmte Teilfonds setzen Total-Return-Swaps ein, um ihr Portfolio zu hebeln oder um sich an den Renditen der zugrunde liegenden Finanzinstrumente zu beteiligen, ohne diese zu besitzen. Total-Return-Swaps sind Kontrakte zwischen zwei Parteien, bei denen sich üblicherweise eine Partei zur Zahlung der positiven Renditen und die andere Partei zur Zahlung der negativen Renditen auf ein bestimmtes Wertpapier, einen bestimmten Index oder eine Indexkomponente während der vereinbarten Swap-Laufzeit verpflichten. Total-Return-Swaps werden täglich zum Marktwert des zugrunde liegenden Referenzwertes neu bewertet und eine allfällige Wertänderung wird in der Erfolgsrechnung im Posten „Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust) aus Swapkontrakten“ ausgewiesen. Bei Total-Return-Swaps findet in der Regel keine Lieferung von Wertpapieren oder anderen zugrunde liegenden Vermögenswerten statt. Wird die Gegenpartei des Total-Return-Swaps zahlungsunfähig, entsteht dem Teilfonds ein Verlustrisiko hinsichtlich der allfällig vertraglich vereinbarten Nettozahlungen. Das Halten von Long-Positionen in Total-Return-Swaps setzt die Teilfonds einem Verlustrisiko aus, das über die in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesenen Beträge hinausgeht.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

3. Wertpapiere und andere Anlagen (Fortsetzung)

(e) Total-Return-Swaps (Fortsetzung)

Das Halten von Short-Positionen in Total-Return-Swaps setzt die Teilfonds einem unbegrenzten Verlustrisiko aus. Die periodischen Zahlungseingänge oder -ausgänge der Teilfonds werden als realisierter Gewinn oder Verlust erfasst. Allfällige am Ende der Berichtsperiode offene Total-Return-Swaps werden im Anlagenbestand jedes Teilfonds ausgewiesen.

(f) Total-Return-Basket-Swaps

Bestimmte Teilfonds können Total-Return-Basket-Swapgeschäfte tätigen, um in ein Portfolio aus Long- und Short-Positionen in Wertpapieren zu investieren. Solche Swaps funktionieren wie ein Portfolio aus Direktanlagen in Long- und Short-Positionen in Aktien oder festverzinslichen Wertpapieren gemäß den festgelegten Bedingungen. Der Teilfonds kann im Rahmen des Swaps Long- und Short-Positionen eingehen und glattstellen und zieht daraus denselben Nutzen und geht dieselben Risiken ein, wie bei einer Direktanlage in den gewählten Positionen (z. B. Wertzuwachs/(-verlust), Kapitalmaßnahmen, Zins- und Dividendeneinnahmen und -aufwendungen), die sich im Wert des Swap-Kontrakts widerspiegeln. Der Swap-Wert beinhaltet auch Zinsaufwendungen und -gutschriften im Zusammenhang mit den Nominalwerten der Long- und Short-Positionen sowie der Barguthaben im Swap. Diese Zinsaufwendungen und -gutschriften basieren auf festgelegten Marktkursen zu- oder abzüglich eines bestimmten Spreads und werden im Folgenden als „Finanzierungskosten“ bezeichnet. Die Positionen im Swap werden periodisch und die Finanzierungskosten monatlich zurückgesetzt.

Während der Rücksetzung können allfällige auf Positionen realisierte Gewinne/(Verluste) und aufgelaufene Finanzierungskosten zwischen dem Teilfonds und der Swap-Gegenpartei bar ausgeglichen werden. Barausgleichszahlungen in und aus dem Swap können nach Ermessen des Teilfonds und der Gegenpartei am Tag der Rücksetzung oder an einem anderen Datum während der Kontraktlaufzeit stattfinden und werden üblicherweise auf Basis der im Rahmenvertrag zwischen dem Teilfonds und der Gegenpartei festgelegten Schwellen und Grenzen vereinbart. Barausgleichszahlungen zwischen einem Teilfonds und der Gegenpartei werden in der Erfolgsrechnung im Posten „Realisierter Nettoertrag/(-verlust) aus Swaps“ ausgewiesen. Eine Veränderung des Marktwerts eines Total-Return-Basket-Swaps wird in der Erfolgsrechnung im Posten „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) auf Swaps“ ausgewiesen. Allfällige am Ende der Berichtsperiode offene Total-Return-Basket-Swap-Kontrakte werden im Anlagenbestand jedes Teilfonds ausgewiesen.

(g) Kreditausfall-Swaps

Bestimmte Teilfonds tätigen Kreditausfall-Swapgeschäfte, um sich vor dem Verlustrisiko nach einem Zahlungsverzug oder vor anderen Kreditereignissen in Verbindung mit den Emittenten in einem dem Swap zugrunde liegenden Index oder eines einzelnen Emittenten zur schützen oder um in einen dem Swap zugrunde liegenden Index oder Emittenten zu investieren. In einem Kreditausfall-Swap leistet der Sicherungsnehmer üblicherweise eine Vorauszahlung und regelmäßige Nachfolgezahlungen an eine Gegenpartei (der Sicherungsgeber) im Austausch gegen das Recht auf Erhalt einer bedingten Zahlung bei Eintritt eines Kreditereignisses bei der Referenzposition oder bei den anderen identisch eingestuften Obligationen der Referenzwerten. Kreditereignisse sind kontraktsspezifisch, können aber Insolvenz, Zahlungsausfall, Umstrukturierung der Verbindlichkeit und vorzeitige Fälligkeit der Verbindlichkeit umfassen. Die Kreditausfall-Swaps werden täglich zu Marktpreisen neu bewertet und eine allfällige Wertveränderung wird in der Erfolgsrechnung im Posten „nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) aus Swaps“ ausgewiesen. Bei Eintreten eines Kreditereignisses wird die Differenz zwischen Nominalwert und Marktwert der Referenzverbindlichkeit, abzüglich des anteiligen Betrags der Vorauszahlung, in der Erfolgsrechnung im Posten „realisierter Gewinn/(Verlust) aus Swaps“ ausgewiesen.

Zur Bewertung von Kreditausfall-Swaps werden implizite Kreditspreads herbeigezogen, welche die Kosten für den Erwerb bzw. die Bereitstellung der Sicherung widerspiegeln, wie beispielsweise beim Abschluss des Swap-Kontrakts geleistete Vorauszahlungen. Aus diesem Grund deuten höhere Spreads auf eine größere Wahrscheinlichkeit hin, dass der Sicherungsgeber zur Leistungserfüllung gemäß Swap-Kontrakt verpflichtet ist (sprich die Zahlung ausführen muss). Die impliziten Kreditspreads für die auf Kreditindizes abgeschlossenen Kreditausfall-Swaps sind an den gewichteten Durchschnittsspread der zugrunde liegenden Referenzverbindlichkeiten in einem bestimmten Index gebunden.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

3. Wertpapiere und andere Anlagen (Fortsetzung)

(g) Kreditausfall-Swaps (Fortsetzung)

Die Verlustrisiken können die in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesenen Beträge übersteigen. Das maximale Verlustrisiko eines Teifonds in Bezug auf eine Gegenpartei (als Sicherungsgeber oder -nehmer) entspricht dem beizulegenden Zeitwert des Swap-Kontrakts. Durch eine Aufrechnungs-Rahmenvereinbarung zwischen dem Teifonds und der Gegenpartei kann dieses Risiko verringert werden. Die zentrale Gegenpartei agiert als Gegenpartei für jedes zentral abgewickelte Swapgeschäft und das Kreditrisiko beschränkt sich deshalb auf den Ausfall der Clearingstelle.

Ist der Teifonds Sicherungsgeber, entspricht der höchstmögliche Betrag an zukünftigen Zahlungen, zu deren Leistung der Teifonds verpflichtet sein kann, dem Nominalwert des Kreditausfall-Swaps. Das dem Teifonds durch solche Finanzinstrumente anfallende Verlustrisiko kann deren in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesenen Wert übersteigen. Unter bestimmten Voraussetzungen kann ein Teifonds gegenläufige Kreditausfall-Swaps abschließen, wodurch sich das Verlustrisiko verringern würde. Allfällige am Ende der Berichtsperiode ausstehende Kreditausfall-Swaps werden im Anlagenbestand jedes Teifonds ausgewiesen.

(h) Zinsswaps

Bestimmte Teifonds tätigen Zinsswapgeschäfte als Teil ihrer Anlagestrategie. Zinsswaps bestehen in der Regel aus Vereinbarungen zum Austausch von fixen und variablen Zinsverpflichtungen, ohne dass dabei die zugrunde liegenden Nominalwerte übertragen werden. Zinsswapgeschäfte werden am OTC-Markt privat ausgehandelt oder über ein multilaterales oder ein anderes Handelssystem wie z. B. eine registrierte Börse zentral abgewickelt (zentral abgewickelte Swaps). Die periodischen Zahlungseingänge/(-ausgänge) der Teifonds werden als realisierte Gewinne/(Verluste) erfasst. Die Zinsswaps werden täglich zu Marktwerten neu bewertet und die Wertveränderung wird in der Erfolgsrechnung im Posten „nicht realisierter Wertzuwachs/(-verlust) aus Swaps“ ausgewiesen. Das den Teifonds durch solche Finanzinstrumente anfallende Verlustrisiko kann deren in der Nettovermögensaufstellung ausgewiesenen Wert übersteigen. Nicht lieferbare Zinsswaps werden in USD, ohne die Lieferung von Fremdwährung mit der Gegenpartei glattgestellt. Bei zentral abgewickelten Zinsswaps kann der Zeitpunkt für deren Inkrafttreten in der Zukunft liegen. Die Amortisierung allfälliger Upfront-Prämien (falls zutreffend) und Zahlungen im Zusammenhang mit diesen Swapgeschäften beginnen ab dem Datum des Vertragsbeginns. Allfällige am Ende der Berichtsperiode ausstehende Zinsswaps werden im Anlagenbestand jedes Teifonds ausgewiesen.

(i) Rahmenvereinbarungen

Einige Teifonds haben mit Gegenparteien Aufrechnungs-Rahmenvereinbarungen abgeschlossen. Solche Rahmenvereinbarungen legen die Bedingungen für bestimmte ähnliche Finanzgeschäfte fest und standardisieren deren Aufrechnungsverfahren. Dadurch wird das mit diesen Geschäften verbundene Gegenparteirisiko verringert und die Rechtssicherheit verbessert. Da die verschiedenen Finanzgeschäfte nicht dieselben Mechanismen aufweisen und manchmal von verschiedenen Rechtsträgern aus der Organisation der Gegenpartei gehandelt werden, und da jedes Geschäft oder jede Anlageklasse in einer anderen Rahmenvereinbarung geregelt werden kann, müssen mehrere Rahmenvereinbarungen mit einer Gegenpartei und ihren verbundenen Rechtsträgern abgeschlossen werden. Da die einzelnen Rahmenvereinbarungen spezifisch für besondere Geschäfte in einzelnen Anlageklassen gelten, können die Teifonds bei Ausfall der Gegenpartei die gesamten mit ihr eingegangenen Geschäfte, die in einer einzigen Rahmenvereinbarung geregelt sind, miteinander verrechnen und glattstellen.

Kundenkontovereinbarungen regeln zentral abgewickelte Derivate und börsengehandelte Futures, die über eine zentrale Clearingstelle abgewickelt werden. Die zentrale Clearingstelle wickelt täglich die von Terminbörsenbrokern, die zu ihren Clearing-Mitgliedern zählen und bei der US-Aufsichtsbehörde für den Warenterminhandel (CFTC) oder einer anderen zuständigen Regulierungsbehörde als Swap- oder Futureshändler registriert sind, erhaltenen Handelsgeschäfte ab. Zur Durchführung von zentral abgewickelten Derivaten und börsengehandelten Futures müssen sich die Teifonds deshalb an Broker wenden. Bei Abschluss eines börsengehandelten oder zentral abgewickelten Derivatekontrakts ist der Teifonds verpflichtet, eine Einschussmarge in Form von Barmitteln auf sein Handelskonto beim Broker zu überweisen oder Wertpapiere als Sicherheitsleistung zu verpfänden. Bei Abschluss des Kontrakts stellt die Summe der auf dem Handelskonto beim Broker als Sicherheitsmarge hinterlegten Barmittel und des Werts der als Sicherheitsleistung verpfändeten Wertpapiere das Gesamtguthaben auf dem Handelskonto dar und muss der vom Broker für jeden Teifonds geforderten Einschussmarge entsprechen, welche mit der von der zentralen Clearingstelle dem Broker auferlegten Sicherheitsmarge identisch ist. Folglich wird die von den einzelnen Teifonds beim Broker zu hinterlegende Einschussmarge indirekt durch die zentrale Clearingstelle festgelegt und muss über die gesamte Kontraktlaufzeit beibehalten werden.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

3. Wertpapiere und andere Anlagen (Fortsetzung)

(i) Rahmenvereinbarungen (Fortsetzung)

Verzeichnen die in einem Handelskonto gehaltenen börsengehandelten oder zentral abgewickelten Derivate einen Wertzuwachs/(-verlust), wird das Gesamtguthaben des Kontos aktualisiert, sodass es sich aus (i) dem kumulierten Nettowertzuwachs/(-verlust) der im Konto gehaltenen offenen Derivate; (ii) dem Saldo der als Einschussmarge hinterlegten Barmittel; und (iii) dem Wert der als Sicherheitsleistung verpfändeten Wertpapiere zusammensetzt.

Alle zentral abgewickelten Derivate und börsengehandelten Futures werden mindestens einmal pro Tag neubewertet. Deshalb führt der tägliche Wertzuwachs/(-verlust) der einzelnen Derivate dazu, dass das Gesamtguthaben auf dem entsprechenden Handelskonto über oder unter der erforderlichen Einschussmarge liegt. Gemäß den Kundenkontovereinbarungen werden den einzelnen Teilfonds täglich überschüssige Barmittel ausgezahlt oder fehlende Beträge eingefordert, so dass das Guthaben ihres Handelskontos der erforderlichen Sicherheitsleistung entspricht. Diese Aus- und Einzahlungen auf dem Handelskonto werden als Nachschussmargen bezeichnet. Die Nachschussmargen für börsengehandelte Futures und zentral abgewickelte Swaps werden separat berechnet und können nicht gegeneinander aufgerechnet werden. Die Nachschusszahlungen zwischen den einzelnen Teilfonds und ihren Brokern erfolgen üblicherweise am Morgen nach Handelsschluss. Die am Ende jedes Tages bestehende Differenz zwischen dem Gesamtguthaben eines Handelskontos und der erforderlichen Sicherheitsleistung entspricht in der Regel dem Betrag der Veränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) auf Derivaten des jeweiligen Tages.

Am Ende der Berichtsperiode werden der Saldo der als Sicherheiten verpfändeten Barmittel und der kumulierte Nettowertzuwachs/(-verlust) auf offenen Derivaten in der Nettovermögensaufstellung als „Einlagen bei Brokern für börsengehandelte oder zentral abgewickelte Derivate“ erfasst und allfällige Forderungen oder Verbindlichkeiten für Nachschussmargen werden im Posten „Forderungen/ Verbindlichkeiten für Nachschussmargen“ ausgewiesen. Wertpapiere, die gemäß einer Kundenkontovereinbarung als Sicherheiten verpfändet und von der Verwahrstelle der einzelnen Teilfonds abgesondert wurden, werden in der Nettovermögensaufstellung als Aktiva erfasst und im Posten „Marktwert der Anlagen“ ausgewiesen. Übersteigt der Marktwert der an ein Clearingmitglied als Sicherheiten verpfändeten Wertpapiere das Sicherheitserfordernis, kann das Clearingmitglied Barmittel an den Teilfonds zurücküberweisen, damit das Gesamtguthaben des Kontos wieder dem Sicherheitserfordernis entspricht. In solchen Fällen werden die an den Teilfonds zurückgegebenen Barmittel in der Nettovermögensaufstellung als Einlagen von Brokern für börsengehandelte und zentral abgewickelte Derivate ausgewiesen.

Am Ende der Berichtsperiode waren keine Anlagen als Sicherheitsmarge im Sinne einer Kundenkontovereinbarung verpfändet.

Rahmenverträge und Besicherungsanhänge der International Swaps and Derivatives Association, Inc. („ISDA-Rahmenverträge“) regeln zwischen einem Teilfonds und einer Gegenpartei ausgehandelte OTC-Derivate. ISDA-Rahmenverträge enthalten Vorschriften bezüglich allgemeinen Pflichten, Zusicherungen, Verrechnung von Ausgleichszahlungen, Vereinbarungen zur Lieferung von Begleitdokumenten, Sicherheitenübertragung, Ausfall und Auflösung. ISDA-Rahmenverträge enthalten die für die einzelnen Teilfonds und deren Gegenparteien relevanten Auflösungsgründe. Ein Auflösungsgrund kann gegeben sein, wenn das Nettovermögen eines Teilfonds einen bestimmten Schwellenwert während einer festgelegten Zeitdauer unterschreitet oder wenn die Bonität einer Gegenpartei unter einem vorgegebenen Niveau eingestuft wird. Bei Eintreten einer der beiden Fälle kann die andere Partei die vorzeitige Auflösung und Verrechnung aller offenen OTC-Swaps und OTC-Derivate erwirken (einschließlich der Zahlung allfälliger durch die vorzeitige Auflösung entstehenden Verluste und Kosten, die von der kündigenden Partei in angemessener Höhe festgelegt werden). Ein allfälliger Entscheid zur vorzeitigen Kontraktauflösung kann, unabhängig von welcher Partei er ausgeht, einen Einfluss auf die zukünftige Derivatetätigkeit des betroffenen Teilfonds haben. Die von den einzelnen Teilfonds für OTC-Derivate gemäß Rahmenvereinbarung verpfändeten Sicherheiten werden von der Verwahrstelle der einzelnen Teilfonds abgesondert und in der Nettovermögensaufstellung als Aktiva erfasst und dort entweder als Bestandteil des Postens „Marktwert der Anlagen (Wertpapiere)“ oder als Bestandteil des Postens „Forderungen gegenüber Brokern (Barmittel)“ ausgewiesen. Die Absonderung der von den einzelnen Teilfonds geleisteten Sicherheiten im Konto der Verwahrstelle trägt zur Verringerung des Gegenparteirisikos bei. Die gemäß Rahmenvereinbarung zugunsten der einzelnen Teilfonds geleisteten Sicherheiten für OTC-Derivate sind bei einer Verwahrstelle des jeweiligen Teilfonds hinterlegt. Erhaltene Barsicherheiten werden in der Nettovermögensaufstellung als Verbindlichkeit im Posten „Verbindlichkeiten gegenüber Brokern“ ausgewiesen.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

3. Wertpapiere und andere Anlagen (Fortsetzung)

(i) Rahmenvereinbarungen (Fortsetzung)

Zu Zwecken der Rechnungslegung verrechnen die Teilfonds in der Nettovermögensaufstellung ihre finanziellen Vermögenswerte und finanziellen Verbindlichkeiten, die Gegenstand von Rahmenvereinbarungen oder ähnlichen Vereinbarungen sind, nicht.

4. Bestimmung des Nettoinventarwerts der Anteile

Der NIW pro Anteil einer Anteilsklasse von einem Teilfonds errechnet sich durch Division des aktuellen Anteils der Anteilsklasse am Gesamtnettovermögen des Teilfonds abzüglich der auf die Anteilsklasse entfallenden Verbindlichkeiten durch die Gesamtzahl der zum Zeitpunkt der Berechnung im Umlauf befindlichen Anteile der Anteilsklasse des entsprechenden Teilfonds. Die Berechnung des NIW pro Anteil einer Anteilsklasse von einem Teilfonds erfolgt an jedem Tag, an dem die Banken in Luxemburg geöffnet sind, oder wie gegebenenfalls vom Verwaltungsrat bestimmt und den Anteilinhabern im Voraus mitgeteilt.

5. Kosten und Gebühren

(a) Kostenregelungen

Alle Auslagen werden periodengerecht in der Erfolgsrechnung erfasst. Für jede Anteilsklasse eines Teilfonds besteht entweder eine Gesamtkostenquote („TER“) oder eine Kostenobergrenze.

Gesamtkostenquote

Die TER enthält die Anlageverwaltungsgebühren („Anlageverwaltungsgebühren“) und bestimmte Bearbeitungs- und Betriebsgebühren in Verbindung mit der Gründung, der Verwaltung und dem Betrieb der Gesellschaft („Bearbeitungs- und Betriebsgebühren“). Bei den Anteilsklassen, für die eine TER besteht, wird für die Bearbeitungs- und Betriebsgebühren ein fixer Satz festgelegt (der „Bearbeitungs- und Betriebsgebührensatz“). Liegen die einer bestimmten Anteilsklasse eines Teilfonds anfallenden Bearbeitungs- und Betriebsgebühren über ihrem festgelegten Satz, wird die Differenz vom Anlageverwalter getragen und er kürzt seine Gebühr um den übersteigenden Betrag. Liegen die tatsächlichen Bearbeitungs- und Betriebsgebühren hingegen unter ihrem festgelegten Satz, wird die Differenz dem Anlageverwalter gutgeschrieben und in der Erfolgsrechnung im Posten „Anlageverwaltungsgebühren“ erfasst. Falls die Bearbeitungs- und Betriebsgebühren die TER übersteigen, wird der dem Anlageverwalter zu belastende Betrag separat im Posten „Kostenrückerstattung“ ausgewiesen.

Kostenobergrenze

Bei allen Anteilsklassen eines Teilfonds, für die keine TER besteht, unterliegen die Bearbeitungs- und Betriebsgebühren einer Kostenobergrenze. In diesem Fall entsprechen die einer Anteilsklasse eines Teilfonds zu belastenden Bearbeitungs- und Betriebsgebühren dem tieferen Betrag von entweder den effektiv entstandenen Kosten oder dem im Prospekt festgelegten maximalen Kostensatz.

Kostenrückerstattung

Die durch den Anlageverwalter rückerstatteten Kosten, für die in der Berichtsperiode zum 30. September 2016 eine TER und/oder Kostenobergrenze bestand, werden in der Erfolgsrechnung von den Anlageverwaltungsgebühren abgezogen. Sind die zu erstattenden Kosten höher als die Anlageverwaltungsgebühren, werden sie in der Erfolgsrechnung im Posten „Kostenrückerstattung“ ausgewiesen.

(b) Anlageverwaltungsgebühren und Bearbeitungs- und Betriebsgebühren

Bearbeitungs- und Betriebsgebühren

Die Bearbeitungs- und Betriebsgebühren enthalten die Verwaltungsgesellschaftsgebühr, die Gründungskosten sowie die an Verwaltungsratsmitglieder, Buchhalter und Wirtschaftsprüfer, Rechtsberater, die Verwaltungsstelle und die Verwahrstelle gezahlten Kosten und Gebühren. Nicht enthalten sind Kosten, die direkt mit den Anlageverwaltungsgebühren, Performancegebühren und der Zeichnungssteuer (taxe d'abonnement) zusammenhängen und alle Kosten in Verbindung mit dem Handelsprogramm eines Teilfonds (einschließlich Brokerprovisionen, Quellensteuern und Kapitalverkehrssteuern). Die Bearbeitungs- und Betriebsgebühren für die einzelnen Anteilsklassen jedes Teilfonds sind in der Ergänzung zum Prospekt ausgewiesen.

**Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft)
(Fortsetzung)**

5. Kosten und Gebühren (Fortsetzung)

(b) Anlageverwaltungsgebühren und Bearbeitungs- und Betriebsgebühren (Fortsetzung)

Anlageverwaltungsgebühren

Sofern in der Ergänzung zum Prospekt nicht anderweitig bestimmt, hat der Anlageverwalter für jede Anteilkategorie vorbehaltlich einer allfälligen TER Anspruch auf eine monatliche Anlageverwaltungsgebühr zu dem in der Ergänzung zum Prospekt festgelegten jährlichen Satz. Die berechneten Anlageverwaltungsgebühren werden täglich abgegrenzt und sind monatlich im Nachhinein zu zahlen.

AQR Emerging Equities UCITS Fund

Beim AQR Emerging Equities UCITS Fund bestehen die folgenden jährlichen Sätze für die Anlageverwaltungsgebühren und die Bearbeitungs- und Betriebsgebühren:

	Nettogenamtzeichnungen (Zeichnungen abzüglich Rücknahmen)	Anlageverwaltungsgebührensatz	Bearbeitungs- und Betriebsgebührensatz
ANTEILSKLASSE A (USD thesaurierend)			
Klasse A1	Unter 50 Millionen USD	0,85 %	0,14 %
Klasse A2	Ab 50 Millionen USD bis 200 Millionen USD	0,75 %	0,14 %
Klasse A3	Ab 200 Millionen USD	0,70 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE B (EUR thesaurierend)			
Klasse B1	Unter 40 Millionen EUR	0,85 %	0,14 %
Klasse B2	Ab 40 Millionen EUR bis 160 Millionen EUR	0,75 %	0,14 %
Klasse B3	Ab 160 Millionen EUR	0,70 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE C (GBP thesaurierend)			
Klasse C1	Unter 33 Millionen GBP	0,85 %	0,14 %
Klasse C2	Ab 33 Millionen GBP bis 133 Millionen GBP	0,75 %	0,14 %
Klasse C3	Ab 133 Millionen GBP	0,70 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE D (CHF thesaurierend)			
Klasse D1	Unter 50 Millionen CHF	0,85 %	0,14 %
Klasse D2	Ab 50 Millionen CHF bis 200 Millionen CHF	0,75 %	0,14 %
Klasse D3	Ab 200 Millionen CHF	0,70 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE E (EUR thesaurierend)		Ab 50 Millionen EUR bis 100 Millionen EUR	Ab 100 Millionen EUR bis 150 Millionen EUR
Zusatzgebühr*	0,20%	0,10 %	0,00 %
Bearbeitungs- und Betriebsgebühr	0,14%	0,14 %	0,14 %

* Anteilinhabern der Anteilkategorie E wird eine jährliche Zusatzgebühr belastet. Diese Zusatzgebühr wird dem Anlageverwalter entrichtet. Davon abgesehen bestehen bei der Anteilkategorie E keine weiteren Anlageverwaltungsgebühren.

In der Berichtsperiode zum 30. September 2016 wurden effektiv folgende Anlageverwaltungsgebührensätze verwendet: 0,70 % bei der Klasse A2, 0,69 % bei der Klasse B2, 0,65 % bei der Klasse B3, 0,70 % bei der Klasse C2 und 0,00 % für die Anteilkategorie E.

**Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft)
(Fortsetzung)**

5. Kosten und Gebühren (Fortsetzung)

(b) Anlageverwaltungsgebühren und Bearbeitungs- und Betriebsgebühren (Fortsetzung)

AQR Global Core Equity UCITS Fund

Beim AQR Global Core Equity UCITS Fund gelten die folgenden jährlichen Sätze für die Anlageverwaltungsgebühren und die Bearbeitungs- und Betriebsgebühren:

	Nettогесamtzeichnungen (Zeichnungen abzüglich Rücknahmen)	Anlage- verwaltungs- geböhrensatz	Bearbeitungs- und Betriebs- geböhrensatz
ANTEILSKLASSE A (USD thesaurierend)			
Klasse A1	Unter 50 Millionen USD	0,40 %	0,14 %
Klasse A2	Ab 50 Millionen USD bis 200 Millionen USD	0,30 %	0,14 %
Klasse A3	Ab 200 Millionen USD	0,25 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE B (EUR thesaurierend)			
Klasse B1	Unter 40 Millionen EUR	0,40 %	0,14 %
Klasse B2	Ab 40 Millionen EUR bis 160 Millionen EUR	0,30 %	0,14 %
Klasse B3	Ab 160 Millionen EUR	0,25 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE C (GBP thesaurierend)			
Klasse C1	Unter 33 Millionen GBP	0,40 %	0,14 %
Klasse C2	Ab 33 Millionen GBP bis 133 Millionen GBP	0,30 %	0,14 %
Klasse C3	Ab 133 Millionen GBP	0,25 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE D (CHF thesaurierend)			
Klasse D1	Unter 50 Millionen CHF	0,40 %	0,14 %
Klasse D2	Ab 50 Millionen CHF bis CHF 200 Millionen	0,30 %	0,14 %
Klasse D3	Ab 200 Millionen CHF	0,25 %	0,14 %

Der in der Berichtsperiode zum 30. September 2016 bei der Klasse B3 effektiv verwendete Anlageverwaltungsgeböhrensatz betrug 0,22 %.

**Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft)
(Fortsetzung)**

5. Kosten und Gebühren (Fortsetzung)

(b) Anlageverwaltungsgebühren und Bearbeitungs- und Betriebsgebühren (Fortsetzung)

AQR Global Defensive Equity UCITS Fund

Beim AQR Global Defensive Equity UCITS Fund gelten die folgenden jährlichen Sätze für die Anlageverwaltungsgebühren und die Bearbeitungs- und Betriebsgebühren:

	Nettogenamtzeichnungen (Zeichnungen abzüglich Rücknahmen)	Anlage- verwaltungs- gebührensatz	Bearbeitungs- und Betriebsgebührensatz
ANTEILSKLASSE A (USD thesaurierend)			
Klasse A1	Unter 50 Millionen USD	0,40 %	0,14 %
Klasse A2	Ab 50 Millionen USD bis 200 Millionen USD	0,30 %	0,14 %
Klasse A3	Ab 200 Millionen USD	0,25 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE B (EUR thesaurierend)			
Klasse B1	Unter 40 Millionen EUR	0,40 %	0,14 %
Klasse B2	Ab 40 Millionen EUR bis 160 Millionen EUR	0,30 %	0,14 %
Klasse B3	Ab 160 Millionen EUR	0,25 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE C (GBP thesaurierend)			
Klasse C1	Unter 33 Millionen GBP	0,40 %	0,14 %
Klasse C2	Ab 33 Millionen GBP bis 133 Millionen GBP	0,30 %	0,14 %
Klasse C3	Ab 133 Millionen GBP	0,25 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE D (CHF thesaurierend)			
Klasse D1	Unter 50 Millionen CHF	0,40 %	0,14 %
Klasse D2	Ab 50 Millionen CHF bis 200 Millionen CHF	0,30 %	0,14 %
Klasse D3	Ab 200 Millionen CHF	0,25 %	0,14 %

In der Berichtsperiode zum 30. September 2016 wurden effektiv folgende Anlageverwaltungsgebührensätze verwendet: 0,41 % bei der Klasse A1, 0,26 % bei der Klasse B3 und 0,41 % bei der Klasse C1.

**Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft)
(Fortsetzung)**

5. Kosten und Gebühren (Fortsetzung)

(b) Anlageverwaltungsgebühren und Bearbeitungs- und Betriebsgebühren (Fortsetzung)

AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund

Beim AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund gelten die folgenden jährlichen Sätze für die Anlageverwaltungsgebühren und die Bearbeitungs- und Betriebsgebühren:

	Nettогesamtzeichnungen (Zeichnungen abzüglich Rücknahmen)	Anlage- verwaltungs- geböhrensatz	Bearbeitungs- und Betriebs- geböhrensatz
ANTEILSKLASSE A (USD thesaurierend)			
Klasse A1	Unter 50 Millionen USD	0,45 %	0,14 %
Klasse A2	Ab USD 50 Millionen bis 200 Millionen USD	0,35 %	0,14 %
Klasse A3	Ab 200 Millionen USD	0,30 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE B (EUR thesaurierend)			
Klasse B1	Unter EUR 40 Millionen	0,45 %	0,14 %
Klasse B2	Ab 40 Millionen EUR bis 160 Millionen EUR	0,35 %	0,14 %
Klasse B3	Ab 160 Millionen EUR	0,30 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE C (GBP thesaurierend)			
Klasse C1	Unter 33 Millionen GBP	0,45 %	0,14 %
Klasse C2	Ab 33 Millionen GBP bis 133 Millionen GBP	0,35 %	0,14 %
Klasse C3	Ab 133 Millionen GBP	0,30 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE D (CHF thesaurierend)			
Klasse D1	Unter 50 Millionen CHF	0,45 %	0,14 %
Klasse D2	Ab 50 Millionen CHF bis 200 Millionen CHF	0,35 %	0,14 %
Klasse D3	Ab 200 Millionen CHF	0,30 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE E (CAD thesaurierend)			
Klasse E1	Unter 50 Millionen CAD	0,45 %	0,14 %
Klasse E2	Ab 50 Millionen CAD bis 200 Millionen CAD	0,35 %	0,14 %
Klasse E3	Ab 200 Millionen CAD	0,30 %	0,14 %

In der Berichtsperiode zum 30. September 2016 wurden effektiv folgende Anlageverwaltungsgebühren-
sätze verwendet: 0,14 % bei der Klasse A2 und 0,25 % bei der Klasse C2.

**Anhang zum Halbjahresabschluß per 30. September 2016 (ungeprüft)
(Fortsetzung)**

5. Kosten und Gebühren (Fortsetzung)

(b) Anlageverwaltungsgebühren und Bearbeitungs- und Betriebsgebühren (Fortsetzung)

AQR Global Risk Parity UCITS Fund

Beim AQR Global Risk Parity UCITS Fund gelten die folgenden jährlichen Sätze für die Anlageverwaltungsgebühren und die Bearbeitungs- und Betriebsgebühren:

	Nettогесamtzeichnungen (Zeichnungen abzüglich Rücknahmen)	Anlage- verwaltungs- geböhrensatz	Bearbeitungs- und Betriebs- geböhrensatz
ANTEILSKLASSE A (USD thesaurierend)			
Klasse A1	Unter 50 Millionen USD	0,40 %	0,14 %
Klasse A2	Ab 50 Millionen USD bis 300 Millionen USD	0,35 %	0,14 %
Klasse A3	Ab 300 Millionen USD	0,32 %	0,12 %
ANTEILSKLASSE B (EUR thesaurierend)			
Klasse B1	Unter 120 Millionen EUR	0,40 %	0,14 %
Klasse B2	Ab 120 Millionen EUR bis 240 Millionen EUR	0,35 %	0,14 %
Klasse B3	Ab 240 Millionen EUR	0,32 %	0,12 %
ANTEILSKLASSE C (GBP thesaurierend)			
Klasse C1	Unter 100 Millionen GBP	0,40 %	0,14 %
Klasse C2	Ab 100 Millionen GBP bis 200 Millionen GBP	0,35 %	0,14 %
Klasse C3	Ab 200 Millionen GBP	0,32 %	0,12 %
ANTEILSKLASSE D (CHF thesaurierend)			
Klasse D1	Unter CHF 150 Millionen	0,40 %	0,14 %
Klasse D2	Ab 150 Millionen CHF bis 300 Millionen CHF	0,35 %	0,14 %
Klasse D3	Ab 300 Millionen CHF	0,32 %	0,12 %
ANTEILSKLASSE E (EUR ausschüttend)			
Klasse E1	Unter 120 Millionen EUR	0,40 %	0,14 %
Klasse E2	Ab 120 Millionen EUR bis 240 Millionen EUR	0,35 %	0,14 %
Klasse E3	Ab 240 Millionen EUR	0,32 %	0,12 %
ANTEILSKLASSE F (EUR ausschüttend)			Kostenobergrenze*
Für alle Vermögenswerte		0,32%	0,45 %

* Die Kostenobergrenze gilt für Anteile der Klasse F und enthält die Kosten für die Verwaltungsgesellschaft, den Anlageverwalter (einschließlich der für Anteile der Klasse F festgelegten Anlageverwaltungsgebühr von 0,32 %), den Verwaltungsrat, die Buchhalter und Wirtschaftsprüfer, die Rechtsberater, die Verwaltungsstelle, die Verwahrstelle, die Aufsichtsbehörden (einschließlich der Zeichnungssteuer) und die Gründungskosten. Nicht enthalten sind direkt mit dem Handelsprogramm des Teifonds verbundene Kosten, einschließlich Brokerprovisionen, Gebühren für unabhängige Unterberater, Quellensteuern und Kapitalverkehrssteuern.

In der Berichtsperiode zum 30. September 2016 wurden effektiv folgende Anlageverwaltungsgebührensätze verwendet: 0,41 % bei der Klasse A1, 0,41 % bei der Klasse B1, 0,41 % bei der Klasse C1, 0,36 % bei der Klasse C2, 0,31 % bei der Klasse C3 und 0,31 % für die Anteilsklasse F.

**Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft)
(Fortsetzung)**

5. Kosten und Gebühren (Fortsetzung)

(b) Anlageverwaltungsgebühren und Bearbeitungs- und Betriebsgebühren (Fortsetzung)

AQR Managed Futures UCITS Fund

Beim AQR Managed Futures UCITS Fund gelten die folgenden jährlichen Sätze für die Anlageverwaltungsgebühren und die Bearbeitungs- und Betriebsgebühren:

	Nettogenamtzeichnungen (Zeichnungen abzüglich Rücknahmen)	Anlage- verwaltungs- gebührensatz	Bearbeitungs- und Betriebs- gebührensatz
ANTEILSKLASSE A (USD thesaurierend)			
Klasse A	Ab 100.000 USD	0,60 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE B (EUR thesaurierend)			
Klasse B	Ab 100.000 EUR	0,60 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE C (GBP thesaurierend)			
Klasse C	Ab 100.000 GBP	0,60 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE D (CHF thesaurierend)			
Klasse D	Ab 100.000 CHF	0,60 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE E (EUR ausschüttend)			
Klasse E	Ab 100.000 EUR	0,50 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE F (GBP ausschüttend)			
Klasse F	Ab 100.000 GBP	0,50 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE G (USD ausschüttend)			
Klasse G	Ab 100.000 USD	0,50 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE H (NOK ausschüttend)			
Klasse H1	Ab 100.000.000 NOK	1,00 %	0,14 %
Klasse H2	Ab 100.000.000 NOK	0,90 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE I (CHF ausschüttend)			
Klasse I	Ab 100.000 CHF	0,50 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE J (EUR ausschüttend)			
Klasse J	Ab 100.000 EUR	0,60 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE K (GBP ausschüttend)			
Klasse K	Ab 100.000 GBP	0,60 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE L (USD ausschüttend)			
Klasse L	Ab 100.000 USD	0,60 %	0,14 %

In der Berichtsperiode zum 30. September 2016 wurden effektiv folgende Anlageverwaltungsgebührensätze verwendet: 0,60% bei der Klasse A, 0,60 % bei der Klasse B, 0,59 % bei der Klasse C, 0,60 % bei der Klasse D, 0,49 % bei der Klasse E, 0,49 % bei der Klasse F, 0,90 % bei der Klasse H2, 0,59 % bei der Klasse J, 0,60 % bei der Klasse K und 0,59 % bei der Klasse L.

**Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft)
(Fortsetzung)**

5. Kosten und Gebühren (Fortsetzung)

(b) Anlageverwaltungsgebühren und Bearbeitungs- und Betriebsgebühren (Fortsetzung)

AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund

Beim AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund gelten die folgenden jährlichen Sätze für die Anlageverwaltungsgebühren und die Bearbeitungs- und Betriebsgebühren:

	Nettогесamtzeichnungen (Zeichnungen abzüglich Rücknahmen)	Anlage- verwaltungs- gebührensatz	Bearbeitungs- und Betriebs- gebührensatz
ANTEILSKLASSE A (USD thesaurierend)			
Klasse A1	Unter 50 Millionen USD	0,55 %	0,14 %
Klasse A2	Ab 50 Millionen USD bis 200 Millionen USD	0,50 %	0,14 %
Klasse A3	Ab 200 Millionen USD	0,45 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE B (EUR thesaurierend)			
Klasse B1	Unter 40 Millionen EUR	0,55 %	0,14 %
Klasse B2	Ab 40 Millionen bis 160 Millionen EUR	0,50 %	0,14 %
Klasse B3	Ab 160 Millionen EUR	0,45 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE C (GBP thesaurierend)			
Klasse C1	Unter 33 Millionen GBP	0,55 %	0,14 %
Klasse C2	Ab 33 Millionen GBP bis 133 Millionen GBP	0,50 %	0,14 %
Klasse C3	Ab 133 Millionen GBP	0,45 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE D (CHF thesaurierend)			
Klasse D1	Unter 50 Millionen CHF	0,55 %	0,14 %
Klasse D2	Ab 50 Millionen CHF bis 200 Millionen CHF	0,50 %	0,14 %
Klasse D3	Ab 200 Millionen CHF	0,45 %	0,14 %

In der Berichtsperiode zum 30. September 2016 wurden effektiv folgende Anlageverwaltungsgebühren-
sätze verwendet: 0,51 % bei der Klasse A1, 0,00 % bei der Klasse A2 und 0,44 % bei der Klasse A3.

**Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft)
(Fortsetzung)**

5. Kosten und Gebühren (Fortsetzung)

(b) Anlageverwaltungsgebühren und Bearbeitungs- und Betriebsgebühren (Fortsetzung)

AQR Style Premia UCITS Fund

Beim AQR Style Premia UCITS Fund bestehen die folgenden jährlichen Raten für die Anlageverwaltungsgebühren und die Bearbeitungs- und Betriebsgebühren:

	Nettogenamtzeichnungen (Zeichnungen abzüglich Rücknahmen)	Anlage- verwaltungs- gebührensatz	Bearbeitungs- und Betriebs- gebührensatz
ANTEILSKLASSE A (USD thesaurierend)			
Klasse A	Ab 100.000 USD	0,60 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE B (EUR thesaurierend)			
Klasse B	Ab 100.000 EUR	0,60 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE C (GBP thesaurierend)			
Klasse C	Ab 100.000 GBP	0,60 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE D (CHF thesaurierend)			
Klasse D	Ab 100.000 CHF	0,60 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE E (EUR thesaurierend)			
Klasse E	Ab 100.000 EUR	0,50 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE F (GBP thesaurierend)			
Klasse F	Ab 100.000 GBP	0,50 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE G (EUR thesaurierend)			
Klasse G	Ab 100.000 EUR	1,00 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE H (EUR ausschüttend)			
Klasse H	Ab 100.000 EUR	0,50 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE I (USD ausschüttend)			
Klasse I	Ab 100.000 USD	0,95 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE J (EUR ausschüttend)			
Klasse J	Ab 100.000 EUR	0,95 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE K (GBP ausschüttend)			
Klasse K	Ab 100.000 GBP	0,95 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE M (USD thesaurierend)			
Klasse M	Ab 100.000 USD	0,50 %	0,14 %
ANTEILSKLASSE N (CHF thesaurierend)			
Klasse N	Ab 100.000 CHF	0,50 %	0,14 %

In der Berichtsperiode zum 30. September 2016 wurden effektiv folgende Anlageverwaltungsgebührensätze verwendet: 0,62 % bei der Klasse A, 0,62 % bei der Klasse B, 0,62 % bei der Klasse C, 0,62 % bei der Klasse D, 0,52 % bei der Klasse E, 0,52 % bei der Klasse F, 1,02 % bei der Klasse G, 0,97 % bei der Klasse I, 0,97 % bei der Klasse J, 0,97 % bei der Klasse K, 0,52 % bei der Klasse M und 0,52 % bei der Klasse N.

Gemäß dem Unteranlageverwaltungsvertrag zwischen dem Unteranlageverwalter und dem Anlageverwalter bezahlt der Anlageverwalter dem Unteranlageverwalter eine jährliche Gebühr. Der Teilfonds trägt keine Unteranlageverwaltungsgebühren.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

5. Kosten und Gebühren (Fortsetzung)

(c) Performancegebühren

AQR Emerging Equities UCITS Fund

Beim AQR Emerging Equities UCITS Fund können unter Umständen Performancegebühren anfallen. Allfällige Performancegebühren werden an den Anlageverwalter entrichtet. Performancegebühren können ausschließlich in Verbindung mit Anteilen der Klasse E anfallen und werden jeweils für die zwölfmonatige, zum 31. März endende Berichtsperiode („Berechnungszeitraum“) wie nachfolgend aufgeführt berechnet.

ANTEILSKLASSE E (EUR thesaurierend) Nettogenamtzeichnungen (Zeichnungen abzüglich Rücknahmen)	Ab 50 Mio. EUR bis 100 Mio. EUR	Ab 100 Mio. EUR bis 150 Mio. EUR	Ab 150 Mio. EUR
Tier 1 Hurdle Rate (vor Abzug allfälliger Zusatzgebühr oder Bearbeitungs- und Betriebsgebühren)	0,35 %	0,25 %	0,15 %
Tier 1 Performancegebühr (über Tier 1 Hurdle Rate)	15 %	15 %	15 %
Tier 2 Hurdle Rate	2 %	2 %	2 %
Tier 2 Performancegebühr	30 %	30 %	30 %

Für die Anteilklassen A, B, C und D fallen keine Performancegebühren an.

Die Performancegebühr basiert auf dem NIW pro Anteil am Ende des Berechnungszeitraums. Da im NIW pro Anteil realisierte und nicht realisierte Gewinne und Verluste (sowohl auf Kapital als auch Ertrag) einberechnet sind, ist es möglich, dass Performancegebühren für nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge nicht realisiert werden.

Die Performancegebühr berechnet sich aus folgender Summe am letzten Bewertungstag des Berechnungszeitraums:

- (A) 15 % des im Berechnungszeitraum verzeichneten NIW-Zuwachs ab Erreichen der oben festgelegten Tier 1 Hurdle Rate und bis unter die Tier 2 Hurdle Rate (wie oben festgelegt); und
- (B) 30 % des im Berechnungszeitraum verzeichneten NIW-Zuwachs ab Erreichen der Tier 2 Hurdle Rate.

Liegt der im Berechnungszeitraum verzeichnete NIW-Zuwachs unter der Tier 1 Hurdle Rate oder unter dem Erstausgabepreis pro Anteil, fällt im Berechnungszeitraum keine Performancegebühr in Verbindung mit den Anteilen an.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

5. Kosten und Gebühren (Fortsetzung)

(c) Performancegebühren (Fortsetzung)

AQR Emerging Equities UCITS Fund (Fortsetzung)

Die Tier 1 und Tier 2 Hurdle Rates werden mit Bezug auf die am Morgan Stanley Capital International Inc. Emerging Markets Total Return Index with Net Dividends Un-hedged in Euro („Vergleichsindex“) gemessenen Überschussrenditen berechnet.

AQR Managed Futures UCITS Fund

Beim AQR Managed Futures UCITS Fund können Performancegebühren anfallen. Allfällige Performancegebühren werden an den Anlageverwalter entrichtet und werden pro Berechnungszeitraum berechnet.

Die Performancegebühr basiert auf dem NIW pro Anteil am Ende des Berechnungszeitraums. Da im NIW pro Anteil realisierte und nicht realisierte Gewinne und Verluste (sowohl auf Kapital als auch Ertrag) einberechnet sind, ist es möglich, dass Performancegebühren für nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge nicht realisiert werden.

Die fällige Performancegebühr entspricht am letzten Bewertungstag jedes Berechnungszeitraums 10 % des im Berechnungszeitraum verzeichneten NIW-Zuwachses (netto), sofern dieser die nachfolgend festgelegte Benchmark Hurdle erreicht oder übersteigt.

Teilfonds	Anteilkasse	Benchmark Hurdle
AQR Managed Futures UCITS Fund	Klasse A	ML 3 Month T Bill Index
	Klasse B	European Overnight Index Average
	Klasse C	Sterling Overnight Index Average
	Klasse D	Tom Next Offered Index Swaps Index
	Klasse E	European Overnight Index Average
	Klasse F	Sterling Overnight Index Average
	Klasse G	ML 3 Month T Bill Index
	Klasse I	Sterling Overnight Index Average
	Klasse J	European Overnight Index Average
	Klasse K	Sterling Overnight Index Average
	Klasse L	ML 3 Month T Bill Index

Liegt der im Berechnungszeitraum verzeichnete NIW-Zuwachs unter der Benchmark Hurdle, fällt während des Berechnungszeitraums keine Performancegebühr in Verbindung mit den Anteilen an.

Für die Anteilkasse H werden keine Performancegebühren erhoben.

AQR Style Premia UCITS Fund

Beim AQR Style Premia UCITS Fund können Performancegebühren anfallen. Allfällige Performancegebühren werden an den Anlageverwalter entrichtet und werden pro Berechnungszeitraum berechnet.

Die Performancegebühr basiert auf dem NIW pro Anteil am Ende des Berechnungszeitraums. Da im NIW pro Anteil realisierte und nicht realisierte Gewinne und Verluste (sowohl auf Kapital als auch Ertrag) einberechnet sind, ist es möglich, dass Performancegebühren für nicht realisierte Gewinne gezahlt werden, die in der Folge nicht realisiert werden.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

5. Kosten und Gebühren (Fortsetzung)

(c) Performancegebühren (Fortsetzung)

AQR Style Premia UCITS Fund (Fortsetzung)

Die fälligen Performancegebühren entsprechen am letzten Bewertungstag jedes Berechnungszeitraums 10 % des im Berechnungszeitraum verzeichneten NIW-Zuwachses (netto), sofern dieser die nachfolgend festgelegte Benchmark Hurdle erreicht oder übersteigt.

Teilfonds	Anteilklassen	Benchmark Hurdle
AQR Style Premia UCITS Fund	Klasse A	ML 3 Month T Bill Index
	Klasse B	European Overnight Index Average
	Klasse C	Sterling Overnight Index Average
	Klasse D	Tom Next Offered Index Swaps Index
	Klasse E	European Overnight Index Average
	Klasse F	Sterling Overnight Index Average
	Klasse H	European Overnight Index Average
	Klasse M	ML 3 Month T Bill Index
	Klasse N	Tom Next Offered Index Swaps Index

Für die Anteilklassen G, I, J und K werden keine Performancegebühren erhoben.

Liegt der im Berechnungszeitraum verzeichnete NIW-Zuwachs unter der Benchmark Hurdle, fällt im Berechnungszeitraum keine Performancegebühr in Verbindung mit den Anteilen an.

AQR Global Core Equity UCITS Fund, AQR Global Defensive Equity UCITS Fund, AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund, AQR Global Risk Parity UCITS Fund und AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund.

Es werden keine Performancegebühren erhoben.

Festschreibung von Performancegebühren

Erfolgt in der betreffenden Anteilkasse eine Rücknahme an einem anderen Datum als dem 31. März, wird die Performancegebühr (falls zum Datum der Rücknahme abgegrenzt) für die zurückgenommenen Anteile festgeschrieben und innerhalb von 14 Tagen nach dem Handelstag (oder, bei Beendigung des Vermögensverwaltungsvertrags früher) an den Anlageverwalter gezahlt. Außerdem wird zur Berechnung der Performancegebühr, sofern vom Verwaltungsrat nicht anderweitig bestimmt, eine Übertragung von Anteilen als Rücknahme der Anteile der übertragenden Person und Zeichnung (zum letzten geltenden Nettoinventarwert je Anteil der betreffenden Klasse) dieser Anteile durch den Übertragungsempfänger am Übertragungsdatum betrachtet. Eine Übertragung wird jedoch nicht als Rücknahme und Zeichnung betrachtet, wenn sich der wirtschaftliche Eigentümer nicht ändert. Festgeschriebene Performancegebühren verbleiben bei der betreffenden Klasse (beteiligen sich jedoch nicht an in der Folge erzielten Gewinnen und Verlusten dieser Klasse), bis sie an den Anlageverwalter ausgezahlt werden, und dürfen nicht zur Abwicklung von Rücknahmen oder zur Zahlung von Gebühren und Kosten der betreffenden Klasse verwendet bzw. zur Verfügung gestellt werden.

Der Anlageverwalter kann gelegentlich nach seinem alleinigen Ermessen beschließen, einigen oder allen Anteilinhabern (oder deren Beauftragten einschließlich Verwaltungsratsmitgliedern) oder Intermediären die gesamte oder einen Teil der Anlageverwaltungsgebühr aus eigenen Mitteln rückzuerstatten.

Wird der Anlageverwaltungsvertrag innerhalb eines Berechnungszeitraums aufgelöst, so wird die Performancegebühr für den laufenden Berechnungszeitraum ermittelt und gezahlt, als ob der Vertrag auf das Ende des betreffenden Berechnungszeitraumes gekündigt worden wäre.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

5. Kosten und Gebühren (Fortsetzung)

(c) Performancegebühren (Fortsetzung)

Verwaltungsgesellschaftsgebühr

Die jährliche Verwaltungsgesellschaftsgebühr beträgt maximal 0,025 % des am letzten Geschäftstag des Monats bestimmten Nettovermögens des Teifonds. Die zu zahlende Mindestgebühr beträgt 2.500 EUR pro Monat.

(d) Verwaltungsstellen- und Depotbankgebühren

Die Gesellschaft hat J.P. Morgan Bank Luxembourg S.A. (die „Verwahrstelle“) zur Verwahrstelle des gesamten Gesellschaftsvermögens einschließlich der Barmittel und Wertpapiere bestellt. Die Depotwerte werden entweder direkt von der Verwahrstelle oder von anderen Finanzinstituten wie Korrespondenzbanken, Tochtergesellschaften oder verbundenen Unternehmen der Verwahrstelle verwahrt.

Die Gesellschaft hat HedgeServ Luxembourg S.à r.l. (die „Verwaltungsstelle“) zur Verwaltungs-, Register- und Transferstelle der einzelnen Teifonds bestellt und ihr die Verantwortung zur Abwicklung der täglichen Verwaltungsaktivitäten übertragen, einschließlich der Berechnung von NIW und NIW pro Anteil der einzelnen Teifonds.

(e) Gründungskosten

Die gesamten Kosten für die Gründung eines neuen Teifonds werden von diesem Teifonds getragen und gezahlt. Die Gründungskosten werden nach Ermessen des Verwaltungsrats über eine Laufzeit von bis zu fünf Jahren ab dem Tag der Auflegung des Teifonds linear abgeschrieben. Der Verwaltungsrat kann den Zeitraum für die Abschreibung der Gründungskosten nach eigenem Ermessen verkürzen. Diese Verbuchungsweise wird die Abschlüsse der Teifonds voraussichtlich nicht wesentlich beeinflussen.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

5. Kosten und Gebühren (Fortsetzung)

(f) Netto-Gesamtkostenquote

In der untenstehenden Tabelle ist die Netto-Gesamtkostenquote („TNER“) für jede Anteilsklasse der einzelnen Teilfonds am 30. September 2016 aufgeführt. Bei Anteilsklassen, die während der Berichtsperiode aufgelegt wurden, ist die TNER auf Jahresbasis umgerechnet. Die TNER eines Teilfonds bezieht sich auf die von diesem Teilfonds zu tragenden Kosten und Gebühren einschließlich der Kostenerstattungen, die Gegenstand der in der Ergänzung 5(a) beschriebenen Kostenregelungen sind. Allfällige Performancegebühren sind in der TNER nicht enthalten.

Teilfonds	Anteilsklasse	TNER am 30. September 2016
AQR Emerging Equities UCITS Fund	Klasse A2	0,90 %
	Klasse B2	0,90 %
	Klasse B3	0,85 %
	Klasse C2	0,90 %
	Klasse E	0,15 %
AQR Global Core Equity UCITS Fund	Klasse B3	0,40 %
AQR Global Defensive Equity UCITS Fund	Klasse A1	0,55 %
	Klasse B3	0,40 %
	Klasse C1	0,55 %
AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund	Klasse A2	0,50 %
	Klasse C2	0,50 %
AQR Global Risk Parity	Klasse A1	0,55 %
	Klasse B1	0,55 %
	Klasse C1	0,55 %
	Klasse C2	0,50 %
	Klasse C3	0,45 %
	Klasse F*	0,45 %
AQR Managed Futures UCITS Fund	Klasse A	0,75 %
	Klasse B	0,75 %
	Klasse C	0,75 %
	Klasse D	0,75 %
	Klasse E	0,65 %
	Klasse F	0,65 %
	Klasse H2	1,05 %
	Klasse J	0,75 %
	Klasse K	0,75 %
	Klasse L	0,75 %
AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund	Klasse A1	0,70 %
	Klasse A2	0,66 %
	Klasse A3	0,61 %
AQR Style Premia UCITS Fund	Klasse A	0,75 %
	Klasse B	0,75 %
	Klasse C	0,75 %
	Klasse D	0,75 %
	Klasse E	0,65 %
	Klasse F	0,65 %
	Klasse G	1,15 %
	Klasse I	1,10 %
	Klasse J	1,10 %
	Klasse K	1,10 %

* Für die Anteile der Klasse F wurde für die Berichtsperiode eine Kostenobergrenze von 0,45 % festgelegt.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

6. Besteuerung

Nach derzeitigem luxemburgischen Recht unterliegt die Gesellschaft in Luxemburg weder Steuern auf Erträge oder Kapitalgewinne, noch fallen ihr in Luxemburg Quellensteuern auf ausgeschüttete Dividenden an. Die Gesellschaft unterliegt hingegen einer vierteljährlich berechneten und zahlbaren Steuer auf das Fondsvermögen („Taxe d'Abonnement“), die pro Jahr bis zu 0,05 % des NIW der einzelnen Anteilklassen am Ende des betreffenden Quartals betragen kann. Folgende Teilfonds sind institutionellen Anlegern vorbehalten und werden zu einem ermäßigten Satz von 0,01 % pro Jahr besteuert: AQR Global Risk Parity UCITS Fund, AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund, AQR Emerging Equities UCITS Fund und AQR Style Premia: High Yield Credit UCITS Fund.

Die einzelnen Teilfonds können innerhalb der Gerichtsbarkeiten, in denen sie tätig sind, Steuern auf Kapitalgewinne, Zinsen, Dividenden und Währungsrückführungen unterliegen. Gemäß ihrer Anlagepolitik bilden die einzelnen Teilfonds Rückstellungen für Steuern auf Dividenden und Zinsen, sobald Dividenden angekündigt, Zinserträge erzielt oder Kapitalgewinne realisiert werden. Die Teilfonds bilden diese Rückstellungen bei Bedarf auf der Grundlage ihrer aktuellen Auslegung der geltenden Steuerregeln und -vorschriften.

In Luxemburg ist keine Steuer auf realisierte und nicht realisierte Wertsteigerungen der Anlagen der Gesellschaft zu zahlen. Regelmäßige Erträge der Gesellschaft aus einigen ihrer Wertpapiere sowie Zinsen auf Bareinlagen unterliegen in bestimmten Ländern unter Umständen Quellensteuern zu unterschiedlichen Sätzen, die normalerweise nicht zurückgefordert werden können.

7. Ausschüttungspolitik

Die für die ausschüttenden Anteile eines bestimmten Teilfonds maßgebliche Ausschüttungspolitik ist in der entsprechenden Ergänzung zum Prospekt festgehalten.

Der Verwaltungsrat behält sich das Recht vor, die Ausschüttungspolitik für die einzelnen Teilfonds und die verschiedenen aufgelegten Anteilklassen unterschiedlich auszugestalten.

Gemäß der entsprechenden Prospektergänzung wird der auf thesaurierende Fondsanteile fallende Anteil am Nettoertrag nicht an die Anteilinhaber ausgezahlt, sondern in den betreffenden Teilfonds zugunsten der thesaurierenden Anteile angelegt.

Es ist vorgesehen, dass alle ausschüttenden Anteilklassen als „berichtende Fonds“ gemäß dem für Offshore-Fonds geltenden Steuerrecht des Vereinigten Königreichs qualifiziert sind und dass sie, wenn angemessen, Dividendenausschüttungen vornehmen, deren Höhe mindestens dem größeren folgender beiden Beträge entspricht: den nach UK-Gesetzgebung meldepflichtigen Erträgen oder den nach deutschem Investmentsteuergesetz steuerbaren Gewinnen aus Anlagen. Zudem ist vorgesehen, dass alle ausschüttenden Anteilklassen, wenn angemessen, Dividendenausschüttungen vornehmen, deren Höhe mindestens den nach deutschem Investmentsteuergesetz steuerbaren Gewinnen aus Anlagen entsprechen. Die Auszahlung der Dividenden aus diesen Anteilklassen erfolgt üblicherweise jährlich im Juni.

Die Anteilinhaber werden darauf hingewiesen, dass Dividendenzahlungen aus dem Kapital der Anteilkasse sowie aus den realisierten und nicht realisierten Kapitalgewinnen vorgenommen werden können, falls die Ausschüttungsquote den Anlagenertrag der Anteilkasse übersteigt. Das kann für Anleger in gewissen Ländern steuerlich nachteilig sein. Anleger sind angehalten, ihre lokalen Steuerberater hinsichtlich ihrer steuerlichen Situation zu konsultieren.

In der Berichtsperiode zum 30. September 2016 wurden keine Ausschüttungen fällig bzw. gezahlt.

Anhang zum Halbjahresabschluss per 30. September 2016 (ungeprüft) (Fortsetzung)

8. Transaktionskosten

Am 30. September 2016 wiesen die Teilfonds folgende durch den Erwerb und die Veräußerung von übertragbaren Wertpapieren (ohne OTC- und börsengehandelte Derivate) entstandene Transaktionskosten aus:

Teilfonds	Transaktionskosten
AQR Emerging Equities UCITS Fund	\$377.891
AQR Global Core Equity UCITS Fund	\$23.734
AQR Global Defensive Equity UCITS Fund	\$15.128
AQR Global Enhanced Equity UCITS Fund	\$28.545

Die Transaktionskosten umfassen Brokerprovisionen, Abwicklungskosten und sonstige Abgaben. Diese Kosten sind in den Aufwendungen für Wertpapiere enthalten und werden in der Erfolgsrechnung in den Posten „Realisierter Nettogewinn/(-verlust) aus Anlagen“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(-verlusts) aus Anlagen“ ausgewiesen.

Wie an Anleihenmärkten üblich, kommt beim Erwerb und Verkauf von solchen Wertpapieren eine Geld-Brief-Spanne zur Anwendung. Deshalb besteht bei allen Geschäften eine Differenz zwischen den vom Broker angegebenen Kauf- und Verkaufspreisen, welche die in den Kosten dieser Wertpapiere enthaltene Brokergebühr darstellt.

9. Veränderungen im Anlageportfolio

Die Zusammenstellung für die Berichtsperiode zum 30. September 2016 über die stattgefundenen Veränderungen im Anlageportfolio der einzelnen Teilfonds steht am Sitz der Gesellschaft kostenlos zur Verfügung.

10. Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Nach dem Bilanzstichtag sind keine Ereignisse eingetreten, die im vorliegenden Bericht hätten offengelegt werden müssen oder für die das Erfassen transitorischer Posten erforderlich gewesen wäre.