





**Schroder GAIA**

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

# Geprüfter Jahresbericht

**30. September 2023**

Es werden keine Zeichnungen auf der Grundlage periodischer Berichte entgegengenommen. Zeichnungen sind nur dann gültig, wenn sie auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospekts, der aktuellen wesentlichen Anlegerinformationen zusammen mit dem letzten verfügbaren Jahresbericht oder ungeprüften Halbjahresbericht erfolgen, sofern dieser später veröffentlicht wurde. Dieser Bericht basiert auf dem aktuellen Verkaufsprospekt.

Die geprüften Jahres- und ungeprüften Halbjahresberichte, der aktuelle Verkaufsprospekt und die Satzung der Gesellschaft sind kostenlos am eingetragenen Sitz der Gesellschaft, 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg, Grossherzogtum Luxemburg, erhältlich.

Dieses Material darf nicht in Ländern ausgegeben werden, in denen dies gesetzlich verboten ist, und es darf nicht in einer Weise verwendet werden, die gegen lokale Gesetze oder Vorschriften verstößt.

## Inhalt

<b>Informationen für Investoren in der Schweiz</b>	<b>5</b>
<b>Verwaltungsrat</b>	<b>6</b>
<b>Verwaltung</b>	<b>7</b>
<b>Bericht des Verwaltungsrats</b>	<b>8</b>
<b>Bericht des Anlageverwalters</b>	<b>11</b>
<b>Prüfbericht</b>	<b>13</b>
<b>Bericht des Anlageverwalters</b>	<b>16</b>
<b>Nettovermögensaufstellung</b>	<b>30</b>
<b>Ertrags- und Aufwandsrechnung</b>	<b>32</b>
<b>Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens</b>	<b>34</b>
<b>Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen</b>	<b>36</b>
<b>Anlageportfolio</b>	<b>40</b>
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	40
Schroder GAIA BlueTrend	41
Schroder GAIA Cat Bond	42
Schroder GAIA Contour Tech Equity	48
Schroder GAIA Egerton Equity	48
Schroder GAIA Helix	49
Schroder GAIA Oaktree Credit	53
Schroder GAIA SEG US Equity*	60
Schroder GAIA Sirius US Equity	61
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	62
Schroder GAIA Wellington Pagosa	63
<b>Anmerkungen zum Abschluss</b>	<b>69</b>
<b>Gesamtkostenquote (die «TER»)</b>	<b>145</b>
<b>Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)</b>	<b>148</b>
<b>Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)</b>	<b>150</b>
<b>Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft)</b>	<b>161</b>
<b>Anhang IV – Wertentwicklung des Fonds (ungeprüft)</b>	<b>189</b>

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Informationen für Investoren in der Schweiz

## Vertreter in der Schweiz:

Schroder Investment Management (Switzerland) AG  
Central 2  
8001 Zürich  
Schweiz

## Hauptzahlstelle in der Schweiz:

Schroder & Co Bank AG  
Central 2  
8001 Zürich  
Schweiz

## Ort, an dem die erforderlichen Dokumente erhältlich sind

Der Prospekt für die Schweiz, die wichtigsten Informationsdokumente, die Satzung, die Jahres- und Halbjahresberichte sowie die Liste der Käufe und Verkäufe während des Berichtszeitraums sind kostenlos beim Vertreter in der Schweiz erhältlich.

# Verwaltungsrat

## Verwaltungsratsvorsitzender

- **Eric Bertrand**

**Non-Executive Director**

Vaults 13-16  
Valletta Waterfront  
FRN 1914  
Malta

## Weitere Verwaltungsratsmitglieder

- **Carla Bergareche Garcia-Minaur**

**Global Head of Wealth, Client Group**

Schroder Investment Management (Europe) S.A., Spanish Branch  
C/ Pinar, 7 – 4ª planta, 28006 Madrid  
Spanien

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

**Independent Director**

12, rue de la Sapinière  
L-8150 Bridel  
Grossherzogtum Luxemburg

- **Bernard Herman**

**Independent Director**

BH Consulting S.à r.l.  
26, rue Glesener  
L-1630 Luxemburg  
Grossherzogtum Luxemburg

- **Hugh Mullan**

**Independent Director**

5, rue Höhenhof  
L-1736 Senningerberg  
Grossherzogtum Luxemburg

- **Alexander Prawitz<sup>1</sup>**

**Country Head Germany, Austria & CEEMED Region**

Schroder Investment Management (Europe) S.A., German Branch  
Taunustor 1 (TaunusTurm)  
60310 Frankfurt am Main  
Deutschland

- **Neil Walton<sup>2</sup>**

**Head of OCIO and Client Specialist Solutions**

Schroder Investment Management Limited  
1 London Wall Place  
London EC2Y 5AU  
Vereinigtes Königreich

- **Ross Leach<sup>3</sup>**

**Specialist Solutions**

Schroder Investment Management Limited  
1 London Wall Place  
London EC2Y 5AU  
Vereinigtes Königreich

- **Tim Boole<sup>4</sup>**

**Head of Product Management Private Equity**

Schroders Capital Management (Switzerland) AG  
Affolternstrasse 56  
8050 Zürich  
Schweiz

<sup>1</sup> Das Verwaltungsratsmandat von Alexander Prawitz endete während des Geschäftsjahres am 15. September 2023.

<sup>2</sup> Das Verwaltungsratsmandat von Neil Walton endete während des Geschäftsjahres am 1. September 2023.

<sup>3</sup> Ross Leach wurde am 1. September 2023 in den Verwaltungsrat berufen.

<sup>4</sup> Tim Boole wurde am 30. März 2023 in den Verwaltungsrat berufen.

# Verwaltung

## Eingetragener Sitz

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg  
Grossherzogtum Luxemburg

## Verwaltungsgesellschaft, Register- und Domizilstelle

### Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg  
Grossherzogtum Luxemburg

## Hauptbuchstelle, Register- und Transferstelle

### HSBC Continental Europe, Luxembourg<sup>1</sup>

18, boulevard de Kockelscheuer, L-1821 Luxemburg  
Grossherzogtum Luxemburg

## Verwahrstelle und Verwaltungsstelle

### Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

80, route d'Esch, 1470 Luxemburg  
Grossherzogtum Luxemburg

## Hauptrechtsberater

### Arendt & Medernach S.A.

41A, avenue J.F. Kennedy, 2082 Luxemburg  
Grossherzogtum Luxemburg

## Unabhängiger Abschlussprüfer

### KPMG Audit S.à r.l.

39, avenue J.F. Kennedy, 1855 Luxemburg  
Grossherzogtum Luxemburg

## Anlageverwalter

### Contour Asset Management, LLC

99 Park Avenue, Suite 1540, New York, NY 10016  
USA  
Schroder GAIA Contour Tech Equity

### Egerton Capital (UK) LLP

Stratton House, 5 Stratton Street, London W1J 8LA  
Vereinigtes Königreich  
Schroder GAIA Egerton Equity

Egerton Capital (UK) LLP hat den folgenden Untereinlageverwalter für den Schroder GAIA Egerton Equity bestellt:

- Egerton Capital (US), LP.

### Oaktree Capital Management, L.P.

333 S Grand Ave, 28th Floor, Los Angeles, CA 90071  
USA  
Schroder GAIA Oaktree Credit

Oaktree Capital Management, L.P. hat den folgenden Untereinlageverwalter für den Schroder GAIA Oaktree Credit bestellt:

- Oaktree Capital Management (UK) LLP

## Schroder Investment Management Limited

1 London Wall Place, London EC2Y 5AU  
Vereinigtes Königreich  
Schroder GAIA Helix

Schroder Investment Management Limited hat die folgenden Untereinlageverwalter für den Schroder GAIA Helix bestellt:

- Tellworth Investments LLP<sup>2</sup>
- Schroder Investment Management North America Inc.
- Schroder Investment Management (Singapore) Ltd.
- Schroder Investment Management (Japan) Ltd.

## Schroder Investment Management (Singapore) Ltd

138 Market Street, #23-01 CapitaGreen, Singapore 048946  
Schroder GAIA Asian Equity Long Short\*

## Schroder Investment Management (Switzerland) AG

Central 2, 8001 Zürich, Schweiz  
Schroder GAIA Cat Bond

## Select Equity Group LP

380 Lafayette Street, New York, NY 10003, USA  
Schroder GAIA SEG US Equity\*

## Sirios Capital Management LP

One International Place, Boston, MA 02110, USA  
Schroder GAIA Sirios US Equity

## Systematica Investments Limited

29 Esplanade, St. Helier JE2 3QA, Jersey  
Schroder GAIA BlueTrend

Systematica Investments Limited hat die folgenden Untereinlageverwalter für den Schroder GAIA BlueTrend bestellt:

- Systematica Investments UK LLP,
- Systematica Investments GP Limited, Niederlassung Genf, und
- Systematica Investments Singapore PTE.

## Tellworth Investments LLP<sup>2</sup>

Eagle House, 3rd Floor, 108-110 Jermyn Street, London, SW1Y 6EE,  
Vereinigtes Königreich

Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund\*

## Two Sigma Advisers LP

100 Avenue of the Americas, 16th Floor, New York, NY 10013  
USA  
Schroder GAIA Two Sigma Diversified

## Wellington Management International Limited

Cardinal Place, 80 Victoria Street, London SW1E 5JL  
Vereinigtes Königreich  
Schroder GAIA Wellington Pagosa

Wellington Management International Limited hat den folgenden Untereinlageverwalter für den Schroder GAIA Wellington Pagosa bestellt:

- Wellington Management Company LLP.

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

<sup>1</sup> Am 1. November 2022 hat sich die Anschrift der HSBC Continental Europe, Luxembourg, in 18, boulevard de Kockelscheuer, L-1821 Luxemburg, Grossherzogtum Luxemburg geändert.

<sup>2</sup> Der Anlageverwalter für den Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund\* und ein Untereinlageverwalter für den Schroder GAIA Helix wurden mit Wirkung zum 5. Dezember 2022 von «BennBridge Ltd» an «Tellworth Investments LLP» übergeben.



# Bericht des Verwaltungsrats

## Die Gesellschaft

Schroder GAIA (die «Gesellschaft») ist eine offene Investmentgesellschaft mit Umbrella-Struktur und beschränkter Haftung, die als «Société anonyme» gegründet wurde und nach Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung als «Société d'Investissement à Capital Variable» (SICAV) anerkannt ist. Die Gesellschaft wurde am 21. Oktober 2009 gegründet, und ihre Satzung in ihrer geltenden Fassung wurde am 12. November 2009 im Mémorial veröffentlicht.

Schroders ist eine FATCA-konforme Organisation. Die FATCA-Klassifizierung dieser Gesellschaft und ihre GIIN lauten wie folgt: FATCA-Klassifizierung dieser Gesellschaft: FFI; Sponsoring-Gesellschaft: Schroder Investment Management (Europe) S.A. (die «Verwaltungsgesellschaft»); GIIN der Sponsoring-Gesellschaft: 4RIMT7.00000.SP.442.

## Abschluss

Der Verwaltungsrat (der «Verwaltungsrat») der Gesellschaft legt hiermit seinen Bericht und den geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 vor.

Zum Zeitpunkt dieses Berichts stehen elf Teilfonds innerhalb der Gesellschaft für Investitionen zur Verfügung (die «Teilfonds»). Die Anlageziele der Teilfonds sowie Angaben zu Anlagebeschränkungen finden Sie im aktuellen Verkaufsprospekt. Den Bericht des Anlageverwalters für den jeweiligen Teilfonds finden Sie in den vierteljährlichen Anlageberichten, die am Sitz der Gesellschaft und auf der Website der Verwaltungsgesellschaft erhältlich sind (<http://www.schroders.lu>).

Dieser Bericht bezieht sich auf den Berichtszeitraum vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023. Der letzte Termin, an dem die Anteilkurse berechnet wurden, war der 29. September 2023, der letzte Arbeitstag im Berichtszeitraum. Der Abschluss wurde im Einklang mit den Luxemburger Verordnungen in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen erstellt.

Zum 30. September 2023 belief sich das Nettovermögen der Gesellschaft insgesamt auf 4 930 545 415 EUR, was im Vergleich zu 5 333 186 258 EUR zum 30. September 2022 einem Rückgang um 7,55% entspricht.

## Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats

Die Verantwortung des Verwaltungsrats richtet sich nach luxemburgischem Recht. In Bezug auf den Abschluss der Gesellschaft ist der Verwaltungsrat verpflichtet, für jedes Geschäftsjahr einen Abschluss zu erstellen, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der Gesellschaft und jedes ihrer Teilfonds zum Ende des Geschäftsjahres sowie des Ergebnisses der Gesellschaft und jedes ihrer Teilfonds für das Geschäftsjahr vermittelt.

Der Verwaltungsrat hat folgende Pflichten:

- Auswahl zweckdienlicher Rechnungslegungsmethoden und deren einheitliche Anwendung;
- Vornahme angemessener und umsichtiger Beurteilungen und Schätzungen;
- Angabe, ob diese in Übereinstimmung mit den anwendbaren Rechnungslegungsstandards erstellt wurden, Identifizierung dieser Standards und Erläuterung der Auswirkung und der Gründe für etwaige wesentliche Abweichungen von diesen Standards; und
- Erstellung des Abschlusses auf der Grundlage der Unternehmensfortführung, es sei denn, es ist unangemessen anzunehmen, dass die Fonds ihre Geschäftstätigkeit fortsetzen werden.

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, sicherzustellen, dass angemessene Buchhaltungsunterlagen geführt werden. In diesem Zusammenhang hat er die Vermögenswerte der Fonds Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. (die «Verwahrstelle») zur Verwahrung anvertraut. Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, Massnahmen zu ergreifen, die ihm vernünftigerweise zur Verfügung stehen, um Betrug und andere Unregelmässigkeiten zu verhindern und aufzudecken.

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, Massnahmen zu ergreifen, die ihm vernünftigerweise zur Verfügung stehen, um Betrug und andere Unregelmässigkeiten zu verhindern und aufzudecken.

## Verwaltungsratssitzungen

Während des Geschäftsjahres zum 30. September 2023 fanden acht Verwaltungsratssitzungen statt.

## Corporate Governance

Die Gesellschaft unterliegt der Corporate Governance beruhend auf:

1. Ihren Verpflichtungen gemäss der OGAW-Richtlinie 2009/65/EG vom 13. Juli 2009, die in luxemburgisches Recht umgesetzt wurde und am Geschäftssitz der Gesellschaft in 5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg, Grossherzogtum Luxemburg, zur Einsichtnahme verfügbar ist.
2. Ihrer Satzung, die am Geschäftssitz der Gesellschaft sowie im luxemburgischen Handelsregister, dem Registre de Commerce et des Sociétés («RCSL»), zur Einsichtnahme verfügbar ist.
3. Den Verpflichtungen bezüglich der Verwaltung der Gesellschaft, wofür die Gesellschaft Schroder Investment Management (Europe) S.A. bestellt hat, die wiederum den Bestimmungen der Richtlinie 2010/43/EG über Verwaltungsgesellschaften und der Richtlinie 2011/61/EU über die Verwalter alternativer Investmentfonds unterliegt, die in luxemburgisches Recht umgesetzt wurden.
4. Dem vom Luxemburger Fondsverband (Association of the Luxembourg Fund Industry, «ALFI») veröffentlichten Verhaltenskodex für luxemburgische Investmentfonds, dessen Grundsätze die Gesellschaft freiwillig übernommen hat.

## Interne Kontroll- und Risikomanagementsysteme

Der Verwaltungsrat ist für die Einrichtung und Aufrechterhaltung angemessener interner Kontroll- und Risikomanagementsysteme der Gesellschaft in Bezug auf den Prozess der Finanzberichterstattung verantwortlich. Solche Systeme sind darauf ausgerichtet, das Risiko von Fehlern oder Betrug bei der Verfolgung der Finanzberichterstattungsziele der Gesellschaft zu kontrollieren und nicht darauf, dieses Risiko völlig auszuschliessen. Sie können somit nur eine angemessene, nicht jedoch eine absolute Sicherheit gegen wesentliche falsche Darstellungen oder Verluste bieten.

Der Verwaltungsrat hat vertraglich mit der Verwaltungsgesellschaft geregelt, dass diese Verfahren eingeführt werden, um sicherzustellen, dass alle massgeblichen Aufzeichnungen einschliesslich der Erstellung von Jahresberichten ordnungsgemäss geführt werden und ohne Weiteres zugänglich sind. Die Jahresberichte der Gesellschaft müssen vom Verwaltungsrat der Gesellschaft genehmigt und bei der Commission de Surveillance du Secteur Financier («CSSF») sowie, im Fall von Jahresberichten, dem Registre de Commerce et des Sociétés (RCSL) eingereicht werden. Die gesetzlich vorgeschriebenen Jahresabschlüsse müssen von unabhängigen Abschlussprüfern geprüft werden, die dem Verwaltungsrat ihre Feststellungen melden.

Der Verwaltungsrat kommt mindestens viermal jährlich zusammen und stellt sicher, dass die Gesellschaft in ihren operativen Abläufen hohe Integritäts- und Kontrollstandards wahrt und über angemessene Steuerungs- und Kontrollmechanismen verfügt, um die Anforderungen des Gesetzes und der massgeblichen Vorschriften zu erfüllen.



# Bericht des Verwaltungsrats (Forts.)

## Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

Informationen über die ökologischen oder sozialen Merkmale und das Ziel nachhaltiger Investitionen, soweit zutreffend, sind in Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (ungeprüft) enthalten.

## Aktivitäten während des Geschäftsjahres

### 1. Neue Teilfonds

Während des Berichtsjahres wurden neue Teilfonds für Anlagen innerhalb der Gesellschaft zur Verfügung gestellt:

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	USD	21. Dezember 2022
Schroder GAIA SEG US Equity*	USD	30. Juni 2023

### 2. Neue Anteilklassen

Während des Berichtszeitjahres wurden die folgenden Anteilklassen aufgelegt:

Teilfonds und Anteilklasse	Währung der Anteilklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
<b>Schroder GAIA Asian Equity Long Short</b>			
Klasse A Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Klasse C Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Klasse I Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Klasse IZ Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
<b>Schroder GAIA Cat Bond</b>			
Klasse Y2 Thes.	USD	USD	11. November 2022
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	11. November 2022
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	11. November 2022
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	11. November 2022
<b>Schroder GAIA SEG US Equity</b>			
Klasse C Thes.	USD	USD	30. Juni 2023
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	30. Juni 2023
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	30. Juni 2023
Klasse IZ Thes.	USD	USD	30. Juni 2023
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	30. Juni 2023
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	30. Juni 2023
Klasse K Thes.	USD	USD	30. Juni 2023
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	30. Juni 2023
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	30. Juni 2023
Klasse R1 Thes.	USD	USD	30. Juni 2023
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023
Klasse R2 Thes.	USD	USD	30. Juni 2023
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	30. Juni 2023
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	30. Juni 2023
Klasse R3 Thes.	USD	USD	30. Juni 2023
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	30. Juni 2023
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	30. Juni 2023
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	30. Juni 2023
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023

\* Der Schroder GAIA SEG US Equity wurde im Rahmen einer Fondsverschmelzung mit dem Select Equity/Short UCITS Fund aufgelegt. Der Select Equity/Short UCITS Fund wurde zum Zeitpunkt der Verschmelzung am 30. Juni 2023 effektiv geschlossen, wobei alle Anleger und Vermögenswerte an den GAIA SEG US Equity Fund übertragen wurden.

# Bericht des Verwaltungsrats (Forts.)

## 3. Auflösungen von Teilfonds

Während des Berichtsjahres wurde ein Teilfonds aufgelöst:

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Auflösungsdatum
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund	GBP	19. September 2023

Darüber hinaus ändert sich mit Wirkung zum 5. Dezember 2022 der Name «Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund» in «Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return».

## Wesentliche Ereignisse während des Jahres

Der anhaltende Konflikt zwischen Russland und der Ukraine wirkt sich weiterhin auf die Bewertung der von der Gesellschaft gehaltenen russischen Wertpapiere aus. Der Verwaltungsrat hat weiterhin angemessene Bewertungsgrundsätze in Übereinstimmung mit unseren Preisbildungsprozessen angewandt. Zum Ende des Geschäftsjahres hielt der Schroder GAIA Helix 38.000.000 russische Aktien, die mit 116.803 USD bewertet wurden.

Nach finanziellen Schwierigkeiten und einer Reihe von Medienskandalen brach die Credit Suisse im März 2023 zusammen und wurde von der ebenfalls schweizerischen UBS übernommen. Zum Ende des Geschäftsjahres hielt der Schroder GAIA Wellington Pagosa Fund 2.392.000 Nominalanleihen in USD der Credit Suisse, die mit null bewertet wurden.

Der folgende Teilfonds ist in russischen und ukrainischen Wertpapieren engagiert:

Schroder GAIA Helix

Für das am 30. September 2023 abgelaufene Geschäftsjahr wurde der bisherige unabhängige Abschlussprüfer der Gesellschaft, PricewaterhouseCoopers Société coopérative, durch KPMG Audit S.à r.l. ersetzt.

### Der Verwaltungsrat

Schroder GAIA

30. September 2023

# Bericht des Anlageverwalters

Die Fonds der Schroder GAIA-Palette sind in der Lage, über ihre Long- oder Short-Positionen sowohl von positiven als auch von widrigen Marktbedingungen zu profitieren. Dieser Ansatz kann gelegentlich dazu führen, dass die Wertentwicklung der Fonds kurzfristig erheblich von der Entwicklung der Märkte, in welche die Teilfonds investieren, abweicht.

## Wirtschaftlicher Rückblick

Im zwölfmonatigen Berichtszeitraum standen vor allem die steigende Inflation und die politischen Reaktionen der grossen Zentralbanken im Fokus der Anleger. Die Befürchtung, dass steigende Zinsen zu einer Rezession führen könnten, nahm zu.

In Europa war der anhaltende Krieg in der Ukraine ein weiterer Negativfaktor, und vor dem Winter 2022 wuchs die Sorge, dass es in der Region zu einer Gasknappheit kommen könnte. Die Wirtschaftstätigkeit und die Aktienmarktrenditen wurden Ende 2022 auch durch die anhaltenden COVID-19-bedingten Lockdowns in China belastet.

Im Vereinigten Königreich begann der Berichtszeitraum unter der kurzlebigen Regierung von Liz Truss, die im September 2022 Premierministerin wurde, turbulent. Die neue Regierung kündigte ein Haushaltspaket an, das von den Märkten negativ aufgenommen wurde. Die Renditen britischer Anleihen stiegen sprunghaft an, und das Pfund Sterling fiel gegenüber dem US-Dollar auf ein Allzeittief. Nach dem Rücktritt von Liz Truss im Oktober 2022 und der Bildung einer neuen Regierung unter Rishi Sunak stabilisierten sich die Märkte jedoch.

Zu Beginn des Jahres 2023 wurden die Aussichten für die Märkte positiver. Das Weltwirtschaftswachstum blieb trotz weiterer Zinserhöhungen der grossen Zentralbanken insgesamt robust. In Europa trug das wärmere Wetter dazu bei, die Auswirkungen der hohen Gaspreise zu begrenzen.

Die Entscheidung Chinas, seine strikten Lockdown-Massnahmen Ende 2022 aufzuheben, führte ebenfalls zu einer Belebung der Mobilität und der Wirtschaftstätigkeit. Im weiteren Verlauf des Jahres 2023 zeigten die Daten aus China jedoch, dass die wirtschaftliche Erholung schwächer ausfiel als von vielen erhofft, während der Immobiliensektor unter Druck geriet.

Die Volatilität nahm im März 2023 zu, als mehrere US-Regionalbanken, darunter die Silicon Valley Bank, aufgrund mangelnder Liquidität zusammenbrachen. In Europa folgte kurz darauf die Übernahme der Credit Suisse durch die UBS.

Befürchtungen, dass die USA ihre Schuldenobergrenze überschreiten könnten, sorgten für zusätzliche Unsicherheit. Anfang Juni 2023 wurde jedoch eine Einigung über die Anhebung der Schuldenobergrenze erzielt.

Gegen Ende des Berichtszeitraums begannen die Inflationsraten in den grossen Volkswirtschaften zu sinken. Das robuste Wachstum liess jedoch Befürchtungen aufkommen, dass dies noch nicht das Ende des Zinserhöhungszyklus bedeuten könnte.

## Überblick über die Entwicklung am Aktienmarkt

Vor diesem Hintergrund konnten globale Aktien aber immer noch Gewinne erzielen. Gemessen am MSCI World Index erzielten Aktien aus Industrieländern eine Rendite von 22,0% (in US-Dollar).

Der wachstumsorientierte Anlagestil schnitt überdurchschnittlich ab: Der MSCI World Growth erzielte eine Rendite von 26,6% gegenüber 17,1% für den MSCI World Value (jeweils in US-Dollar). Die sogenannten «glorreichen Sieben» (Apple, Microsoft, Meta, Amazon, Alphabet, Nvidia und Tesla) waren für einen Grossteil der Outperformance der Wachstumswerte verantwortlich. Ihre Kursgewinne wurden zum Teil von einer Welle der Begeisterung der Anleger für das Potenzial der künstlichen Intelligenz getragen. Während diese grossen Unternehmen weiterhin von den Anlegern bevorzugt wurden, blieben kleinere Unternehmen zurück, obwohl sie insgesamt immer noch positive Renditen erzielten.

Aktien aus Schwellenländern (EM) schnitten schlechter ab, und der MSCI EM Index erzielte eine Rendite von 11,7% (in US-Dollar). Einige der europäischen Schwellenländer entwickelten sich sehr stark, nachdem sie zu Beginn des Jahres 2022 bei Ausbruch des Kriegs zwischen Russland und der Ukraine zurückgeblieben waren. China blieb aufgrund der schwachen Konjunkturerholung und der Probleme im Immobiliensektor hinter dem MSCI EM Index zurück.

## Überblick über die Entwicklung am Anleihemarkt

Die US-Wirtschaft überraschte weiterhin durch ihre Widerstandsfähigkeit. Der Arbeitsmarkt blieb relativ robust, und Anzeichen einer Verbesserung im verarbeitenden Gewerbe trugen zu einem optimistischeren Ausblick bei. Sorgen über die zunehmende Emission von US-Schuldtiteln belasteten den Markt für US-Staatsanleihen. Im August stuft die Ratingagentur Fitch das Rating der USA von AAA auf AA+ herab und begründete dies mit der wachsenden Schuldenlast und einer «Erosion der Governance».

Trotz des starken Ölpreisanstiegs gab es im Jahresverlauf bessere Nachrichten von der Inflationsfront: Die Kerninflationsraten gingen in den meisten Wirtschaftsräumen gegen Ende des Berichtszeitraums im Jahresvergleich zurück. Dies ermöglichte es vielen grossen Zentralbanken, eine Pause in Bezug auf weitere Zinserhöhungen zu signalisieren. Nach früheren Zinserhöhungen belassen sowohl die US-Notenbank (Fed) als auch die Bank of England (BoE) die Zinssätze im September unverändert. Die Europäische Zentralbank (EZB) erhöhte die Leitzinsen, wies jedoch darauf hin, dass die derzeitigen Zinssätze restriktiv genug sein könnten, um die Inflation wieder auf ihr Zielniveau zurückzuführen.

Da die Inflation jedoch nach wie vor hoch war, ging der Markt davon aus, dass die Zinsen noch für eine längere Zeit auf hohem Niveau bleiben würden. Dies war der Hauptgrund für die Marktschwäche im Quartalsverlauf. Die Renditen von Staatsanleihen stiegen stark an, und die Kurven wurden an den meisten wichtigen Märkten steiler, da sich Anleihen mit längeren Laufzeiten schlechter entwickelten.

Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen sind historischer Natur und als solche nicht notwendigerweise Indikatoren für die zukünftige Wertentwicklung.

# Bericht des Anlageverwalters (Forts.)

Die Rendite zehnjähriger US-Staatsanleihen stieg von 3,80% auf 4,57%, die Rendite zehnjähriger britischer Staatsanleihen von 4,09% auf 4,44% und die Rendite zehnjähriger deutscher Staatsanleihen von 2,11% auf 2,84%.

Die Märkte für Unternehmensanleihen entwickelten sich besser als die Märkte für Staatsanleihen. Trotz eines schwächeren Wachstumspfads übertrafen europäische Kreditwerte ihre Pendanten aus den USA.

## Ausblick

Während sich die Inflation in die richtige Richtung bewegt, hat das robuste Wachstum Befürchtungen geweckt, dass der Zinserhöhungszyklus noch nicht abgeschlossen sein könnte.

Die Wirtschaftsexperten von Schroders haben ihre Wachstumsprognose für die USA in diesem Jahr auf 2,3% (zuvor 1,5%) angehoben, die Prognose für China hingegen auf 4,8% (zuvor 6,5%) gesenkt. Diese Veränderungen heben sich weitgehend gegenseitig auf, so dass die Prognose für das globale BIP-Wachstum mit 2,5% nahezu unverändert bleibt. Es wird erwartet, dass sich das globale Wachstum im Jahr 2024 weiter auf 2,1% verlangsamen wird, da die Geldpolitik die Wirtschaftstätigkeit weiterhin dämpft.

Die globale Inflation wird sich voraussichtlich von 7,2% im vergangenen Jahr auf 4,4% in diesem und 3,1% im nächsten Jahr abschwächen. Zwischen den Industrieländern und den Schwellenländern ist eine deutliche Divergenz festzustellen, wobei die Inflation in den Industrieländern sinkt und in den Schwellenländern steigt, während sich China aus der Deflation befreit.

Die Leitzinsen befinden sich in der Nähe ihrer Höchststände und werden im nächsten Jahr sinken, wengleich sich der Lockerungszyklus verzögert, was die Herausforderung der Inflationsbekämpfung widerspiegelt.

## Die Anlageverwalter

Schroder GAIA

Die in diesem Bericht enthaltenen Informationen sind historischer Natur und als solche nicht notwendigerweise Indikatoren für die zukünftige Wertentwicklung.



**KPMG Audit S.à r.l.**  
39, avenue John F. Kennedy  
L-1855 Luxemburg

Tel.: +352 22 51 51 1  
Fax: +352 22 51 71  
E-Mail: [info@kpmg.lu](mailto:info@kpmg.lu)  
Internet: [www.kpmg.lu](http://www.kpmg.lu)

An die Anteilhaber von  
Schroder GAIA  
5, rue Höhenhof  
1736 Senningerberg  
Grossherzogtum Luxemburg

## BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE

### Bericht über die Prüfung des Abschlusses

#### Bestätigungsvermerk

Wir haben den Jahresabschluss von Schroder GAIA und die Jahresabschlüsse aller seiner Teilfonds («der Fonds») geprüft. Diese beinhalten die Nettovermögensaufstellung und die Aufstellung der Anlagebestände zum 30. September 2023 sowie die Ertrags- und Aufwandsrechnung und die Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr und die Anmerkungen zum Abschluss, einschliesslich einer Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden.

Unseres Erachtens zeigt der beiliegende Jahresabschluss ein wahrheitsgetreues und angemessenes Bild der Finanzlage von Schroder GAIA und seiner jeweiligen Teilfonds zum 30. September 2023 sowie ihrer Betriebsergebnisse und Veränderungen des Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr im Einklang mit den in Luxemburg geltenden rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen in Bezug auf die Erstellung und Darstellung des Jahresabschlusses.

#### Grundlage des Bestätigungsvermerks

Wir haben unsere Prüfung im Einklang mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über das Prüfungswesen («Gesetz vom 23. Juli 2016») und den internationalen Prüfungsstandards (International Standards on Auditing, «ISAs»), die von der Commission de Surveillance du Secteur Financier («CSSF») für Luxemburg übernommen wurden, durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten im Rahmen des Gesetzes vom 23. Juli 2016 und der von der CSSF für Luxemburg übernommenen ISAs sind im Abschnitt «Verantwortung des «Réviseur d'entreprises agréé» für die Prüfung des Abschlusses» unseres Berichts näher ausgeführt. Wir sind auch im Einklang mit dem von der CSSF für Luxemburg übernommenen International Code of Ethics for Professional Accountants, einschliesslich der International Independence Standards des International Ethics Standards Board for Accountants («IESBA Code»), zusammen mit den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Abschlusses gelten, unabhängig vom Fonds und haben unsere sonstigen ethischen Verantwortlichkeiten im Rahmen dieser ethischen Anforderungen erfüllt. Unseres Erachtens sind die Ergebnisse aus unserer Prüfung ausreichend und geeignet, um als Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk zu dienen.

# Prüfbericht (Forts.)



## Sonstige Angaben

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die sonstigen Angaben verantwortlich. Die sonstigen Angaben umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Angaben, jedoch nicht den Jahresabschluss und unseren Bericht des «réviseur d'entreprises agréé» zu diesem Jahresabschluss.

Unser Bestätigungsvermerk zum Abschluss bezieht sich nicht auf die sonstigen Angaben, und wir geben keinerlei diesbezügliche Zusicherung ab.

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Abschlusses besteht unsere Zuständigkeit darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei abzuwägen, ob die sonstigen Informationen in wesentlicher Hinsicht mit dem Abschluss oder den Kenntnissen unvereinbar sind, die wir bei der Prüfung erlangt haben, oder ob auf sonstige Weise erhebliche Falschaussagen vorzuliegen scheinen. Wenn wir auf der Grundlage unserer durchgeführten Arbeit feststellen, dass diese sonstigen Angaben wesentliche Falschaussagen enthalten, sind wir verpflichtet, dies zu berichten. Wir haben in dieser Hinsicht nichts zu berichten.

## Verantwortung des Verwaltungsrats des Fonds für den Abschluss

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die Erstellung und angemessene Darstellung dieses Abschlusses gemäss den gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Bestimmungen Luxemburgs für die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen und für entsprechende interne Kontrollmassnahmen verantwortlich, die der Verwaltungsrat des Fonds für die Erstellung von Abschlüssen für notwendig erachtet, die frei von wesentlichen Falschaussagen aufgrund von Betrug oder Irrtum sind.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat des Fonds dafür verantwortlich, die Fähigkeit des Fonds und jedes seiner Teilfonds zur Unternehmensfortführung zu beurteilen, wobei er gegebenenfalls Angelegenheiten in Bezug auf die Unternehmensfortführung oder die Annahme der Unternehmensfortführung offenlegen muss, sofern der Verwaltungsrat des Fonds nicht die Auflösung des Fonds oder eines seiner Teilfonds oder die Einstellung des Betriebs beabsichtigt oder keine realistische Alternative dazu hat.

## Verantwortung des «réviseur d'entreprises agréé» für die Prüfung des Abschlusses

Das Ziel unserer Prüfung ist das Erreichen einer angemessenen Überzeugung davon, ob der Abschluss als Ganzes frei von erheblichen Falschaussagen aufgrund von Betrug oder Irrtum ist, und das Ausstellen eines Berichts des «réviseur d'entreprises agréé», der unseren Bestätigungsvermerk enthält. Eine angemessene Überzeugung ist ein hohes Mass an Überzeugung, es besteht jedoch keine Garantie dafür, dass eine im Einklang mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg übernommenen ISAs durchgeführte Prüfung alle eventuell bestehenden erheblichen Falschaussagen aufdeckt. Falschaussagen können aufgrund von Betrug oder Irrtum entstehen und werden als erheblich angesehen, wenn angemessenerweise davon ausgegangen werden könnte, dass sie einzeln oder insgesamt die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Benutzern beeinflussen könnten.

Im Rahmen einer Prüfung im Einklang mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg übernommenen ISAs lassen wir bei der gesamten Prüfung unser professionelles Urteilsvermögen und eine professionelle Skepsis walten. Darüber hinaus:

# Prüfbericht (Forts.)



- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher Falschaussagen im Abschluss aufgrund von Betrug oder Irrtum, wir konzipieren auf diese Risiken ausgerichtete Prüfungsverfahren und führen diese durch und wir verschaffen uns Prüfungsnachweise, die als Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk ausreichend und geeignet sind. Das Risiko, dass eine auf Betrug zurückzuführende wesentliche Falschaussage nicht aufgedeckt wird, ist höher als im Fall von Irrtümern, da im Betrugsfall Absprachen, Fälschungen, absichtliche Auslassungen, Falschdarstellungen oder das Ausschalten interner Kontrollmassnahmen vorliegen können;
- verschaffen wir uns ein Verständnis der für die Prüfung relevanten internen Kontrollmassnahmen, um Prüfverfahren zu konzipieren, die für die jeweilige Situation geeignet sind, jedoch nicht zum Zweck der Äusserung einer Ansicht darüber, ob die internen Kontrollmassnahmen des Fonds wirksam sind oder nicht;
- beurteilen wir die Eignung der verwendeten Rechnungslegungsmethoden und die Angemessenheit der rechnungslegungsbezogenen Schätzungen und der diesbezüglichen Angaben des Verwaltungsrats des Fonds;
- äussern wir uns zur Angemessenheit der Anwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung durch den Verwaltungsrat des Fonds und dazu, ob auf der Grundlage der Ergebnisse der Prüfung eine erhebliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen besteht, die die Fortführung des Fonds oder eines seiner Teilfonds erheblich in Zweifel stellen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine erhebliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Bericht des «réviseur d'entreprises agréé» auf die entsprechenden Angaben im Abschluss aufmerksam zu machen oder unseren Bestätigungsvermerk zu ändern, wenn diese Angaben unzulänglich sind. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den Ergebnissen aus unserer Prüfung bis zum Datum unseres Berichts des «réviseur d'entreprises agréé». Zukünftige Ereignisse oder Bedingungen können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds nicht fortgeführt wird.
- beurteilen wir die allgemeine Darstellung, die Struktur und den Inhalt des Abschlusses einschliesslich der Offenlegungen, und wir beurteilen, ob der Abschluss die zugrunde liegenden Transaktionen und Ereignisse angemessen darstellt.

Wir kommunizieren mit den für die Governance zuständigen Personen unter anderem in Bezug auf den geplanten Umfang und Zeitplan der Prüfung und erhebliche Prüfungsergebnisse einschliesslich erheblicher Mängel der internen Kontrollmassnahmen, die wir während unserer Prüfung identifizieren.

Luxemburg, 25. Januar 2024

KPMG Audit S.à r.l.  
Cabinet de révision agréé

Ravi Beegun  
Partner

Bitte beachten Sie, dass der Prüfbericht nur für die im Rahmen der gesetzlichen Prüfung unterzeichnete und bei der luxemburgischen Aufsichtsbehörde hinterlegte Fassung des Jahresabschlusses gilt, die zum 25. Januar 2023 unterzeichnet wurde.



# Statistische Informationen

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short* USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
<b>Nettoinventarwert</b>						
zum 30. September 2023	10 603 804	400 977 339	2 479 858 286	153 926 693	410 569 595	296 663 280
zum 30. September 2022	-	371 451 166	1 976 853 711	219 535 032	588 597 772	490 363 715
zum 30. September 2021	-	206 090 340	2 363 039 525	441 703 360	949 465 017	731 532 901
<b>Im Umlauf befindliche Anteile**</b>						
zum 30. September 2023						
Klasse A Thes.	15	105 371	2 279	136 044	235 198	4 657
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	1 121	-	2 838	-	100
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	352 383	33 624	29 455	-	154 695
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	7 915	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	100	-	-	111
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	4 291	-	140
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	292 734	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	813	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	8 275	8 135	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	90 260	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	15	383 056	6 433	483 525	568 931	13 494
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	292 798	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	14 716	1 678	15 533	-	949
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	302 150	20 846	307 549	-	22 066
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	1 092 824	10 039	116 298	85 684	36 023
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	65 827	-	11
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	140
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	463 016	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	5 044	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	3 210	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	31 965	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	1
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	-	33 418	-	3 838	24	363 550
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	2 509	-	5 298
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	5 000	-	22 181	-	1 193 246
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	71 859
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	193	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	120 008	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	10 972	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 252	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	7 046	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	200	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	290	-	-	-
Klasse I Thes.	100 015	-	161 520	-	-	138 428
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	27 737	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	9 572	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	120	-	-	103
Klasse IF Thes.	-	-	157 068	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	84 353	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	463 479	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	7 462 415	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	11 689	-	-	-
Klasse IZ Thes.	15	-	-	-	-	-

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt «Anteilklassen» der Anmerkungen zum Abschluss.

# Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short* USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
<b>Im Umlauf befindliche Anteile** (Forts.)</b>						
zum 30. September 2023						
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	92
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	273 000	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	100	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	56 014	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	15 750	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	28 066	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	35 573	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	51 218	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-	126
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	96
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	2 253
Klasse X Thes.	-	-	-	-	62 985	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	582 309
Klasse Y Thes.	-	-	8 454	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	413	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	109	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	31	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	10	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	10	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	16 423	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	54 115	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	29 280	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	100	-	-	-

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt «Anteilklassen» der Anmerkungen zum Abschluss.

# Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
<b>Nettoinventarwert</b>					
zum 30. September 2023	69 593 042	331 125 967	171 437 016	378 919 128	483 606 159
zum 30. September 2022	47 516 413	-	188 469 066	694 846 015	615 538 573
zum 30. September 2021	28 626 911	-	338 622 600	908 388 830	411 679 496
<b>Im Umlauf befindliche Anteile**</b>					
zum 30. September 2023					
Klasse A Thes.	-	-	525 344	-	137 785
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	-	2 261	-	7 236
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	-	65 247	-	185 806
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	16 758
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	15	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	100	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	100	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	16	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	105	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	105	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	105	-	-	-	-
Klasse C Thes.	13 959	15	316 200	1 230 890	1 300 142
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	140 648
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	620	800	12 843	20 168	91 052
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1 151	4 418	78 933	535 532	1 203 500
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	100	15 224	24 683	571 944	866 897
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	16	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	106	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	105	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	106	-	398	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	55
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	258
Klasse E Thes.	317 678	-	170	-	42 886
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	100	-	-	-	8 332
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	125 832	-	5 632	-	98 472
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	100	-	-	-	58 965
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	16	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	106	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	105	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	18 395	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	200 015	-	-	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes.	-	59 994	-	-	-
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	901	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	31 624	-	-	-

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt «Anteilklassen» der Anmerkungen zum Abschluss.

# Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
<b>Im Umlauf befindliche Anteile** (Forts.)</b>					
zum 30. September 2023					
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	100	-	-	-
Klasse K Thes.	-	15	-	391 237	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	100	-	590	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	100	-	49 364	-
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	100	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	53 934	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	61 515	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	271 772	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	15 803	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	631 343	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	23 595	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	383 767	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	31 141	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	325 220	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	39 773	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	2 631	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	2 809	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	15	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	68	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt «Anteilklassen» der Anmerkungen zum Abschluss.

# Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short* USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
<b>Nettoinventarwert je Anteil**</b>						
zum 30. September 2023						
Klasse A Thes.	103,42	119,50	1 603,53	128,56	213,37	108,15
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	110,05	-	111,54	-	96,67
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	111,25	1 052,51	115,71	-	99,01
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	204,70	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	970,81	-	-	822,56
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	173,74	-	106,07
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	221,32	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	205,50	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	127,11	198,09	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	211,16	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	103,91	124,02	1 626,39	134,79	233,29	113,34
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	152,99	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	114,62	1 204,97	118,45	-	101,84
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	114,89	1 295,31	121,00	-	103,92
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	144,59	114,81	102,38	222,04	109,45
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	1 010,09	-	845,57
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	110,91
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	242,23	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	232,04	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	224,88	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	142,20	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	5 612,20
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	-	127,37	-	136,88	231,50	116,33
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	119,50	-	104,06
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	117,65	-	122,68	-	106,93
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	112,36
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	1 015,76	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	146,01	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	1 604,26	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 192,37	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 277,91	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	1 141,02	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	1 507,64	-	-	-
Klasse I Thes.	105,98	-	1 877,29	-	-	123,47
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 498,81	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 613,95	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	11 257,04	-	-	11 882,66
Klasse IF Thes.	-	-	1 669,58	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 332,56	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 434,17	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	989,64	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	1 359,16	-	-	-
Klasse IZ Thes.	104,07	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	110,07
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen.

# Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short* USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
<b>Nettoinventarwert je Anteil** (Forts.)</b>						
zum 30. September 2023						
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	114,00	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	148,34	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	76,69	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 053,34	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 072,86	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	1 005,10	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	99,98	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-	104,97
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	95,76
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	100,68
Klasse X Thes.	-	-	-	-	232,34	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	106,69
Klasse Y Thes.	-	-	1 106,78	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 053,14	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 074,49	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	1 101,70	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 047,77	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 068,64	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	1 158,82	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 117,51	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 135,43	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	115,10	-	-	-

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen.

# Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
<b>Nettoinventarwert je Anteil**</b>					
zum 30. September 2023					
Klasse A Thes.	-	-	163,29	-	115,02
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	-	183,69	-	100,39
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	-	140,61	-	103,17
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	156,51
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	100,32	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	93,61	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	95,41	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	97,92	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	93,07	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	100,58	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	96,76	-	-	-	-
Klasse C Thes.	101,02	95,45	172,50	133,25	119,01
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	154,49
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	94,69	94,37	192,37	114,57	104,18
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	96,54	94,97	148,62	119,12	106,80
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	99,59	95,33	158,68	126,47	90,62
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	97,91	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	93,09	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	100,63	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	96,78	-	158,63	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5 197,72
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5 358,13
Klasse E Thes.	101,24	-	186,03	-	122,89
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	95,04	-	-	-	107,25
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	96,93	-	160,39	-	110,14
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	99,94	-	-	-	93,45
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	97,95	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	93,09	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	100,62	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	96,81	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	103,10	-	-	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes.	-	95,49	-	-	-
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	94,43	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	94,98	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	95,37	-	-	-
Klasse K Thes.	-	95,34	-	129,35	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	94,27	-	110,78	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	94,82	-	115,04	-

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen.



# Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
<b>Nettoinventarwert je Anteil** (Forts.)</b>					
zum 30. September 2023					
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	95,18	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	141,59	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	120,85	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	138,62	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	109,29	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	143,16	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	114,81	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	221,10	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	82,65	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	193,41	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	147,04	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	101,64	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	1 427,75	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	114,39	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	157,58	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen.

# Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
<b>Nettoinventarwert je Anteil*</b>					
zum 30. September 2022					
Klasse A Thes.	136,68	1 345,81	106,59	186,47	104,38
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	119,31	-	96,44	-	97,10
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	122,62	904,45	98,41	-	97,81
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	176,34	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	831,74	-	-	809,88
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	145,99	-	103,53
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	188,49	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	181,92	-
Klasse A1 Thes.	-	-	105,91	173,99	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	180,74	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	140,99	1 359,56	110,92	202,35	108,26
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	153,00	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	123,52	1 050,27	101,64	-	101,24
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	125,89	1 108,69	102,15	-	101,65
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	134,97	96,60	85,13	189,75	105,29
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	851,28	-	819,62
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	107,12
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	204,77	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	201,28	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	197,59	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	133,88	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5 347,70
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	144,80	-	112,34	200,89	110,69
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	102,28	-	102,97
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	128,89	-	103,33	-	104,09
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	107,65
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	853,79	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	137,42	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	1 345,70	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	1 042,57	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	1 097,83	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	1 036,53	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	1 385,00	-	-	-
Klasse I Thes.	-	1 550,19	-	-	116,49
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	1 290,22	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	1 364,30	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	9 771,53	-	-	11 782,70
Klasse IF Thes.	-	1 394,92	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	1 160,68	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	1 227,01	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	843,83	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	1 233,72	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	105,58
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-

\* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Wahrung der Anteilsklasse ausgewiesen.

# Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
<b>Nettoinventarwert je Anteil* (Forts.)</b>					
zum 30. September 2022					
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	124,86	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	138,79	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	965,02	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	915,99	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	918,09	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	910,70	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	91,11	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	106,99
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	100,39
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	103,83
Klasse X Thes.	-	-	-	201,33	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	103,66
Klasse Y Thes.	-	922,43	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	915,33	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	917,00	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	921,51	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	914,32	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	915,99	-	-	-

\* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilsklassen wird in der Wahrung der Anteilsklasse ausgewiesen.

# Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund* GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
<b>Nettoinventarwert je Anteil**</b>					
zum 30. September 2022					
Klasse A Thes.	-	144,25	-	-	114,68
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	168,47	-	-	104,17
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	126,87	-	-	105,30
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	157,82
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	89,68	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	87,46	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	87,63	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	92,55	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	91,62	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	97,33	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	92,17	-	-	-	-
Klasse C Thes.	90,12	151,65	126,72	112,77	117,77
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	134,17
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	88,03	175,63	112,05	139,93	107,30
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	88,24	133,59	114,57	125,50	108,20
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	89,59	140,66	120,55	-	90,30
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	150,77	-
Klasse C Aussch.	92,55	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	91,61	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	97,33	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	92,15	140,47	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5 352,35
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5 426,56
Klasse E Thes.	90,17	162,79	-	-	121,01
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	88,22	-	-	-	109,90
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	88,45	143,73	-	-	111,01
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	89,78	-	-	-	92,66
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	92,54	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	91,60	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	97,33	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	92,15	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	91,14	-	-	121,56	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	123,20	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	108,88	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	111,19	121,97	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	147,12	-

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen.

# Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund* GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
<b>Nettoinventarwert je Anteil** (Forts.)</b>					
zum 30. September 2022					
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	112,71	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	125,53	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	150,74	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	100,54	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	141,45	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen.

# Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
<b>Nettoinventarwert je Anteil*</b>					
zum 30. September 2021					
Klasse A Thes.	104,27	1 467,46	132,18	220,80	115,45
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	90,88	-	121,95	-	109,23
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	93,88	-	124,41	-	110,04
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	206,94	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	913,91	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	142,43	-	181,62	-	114,68
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	218,87	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	210,98	-
Klasse A1 Thes.	-	-	131,99	207,06	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	210,90	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	107,08	1 476,56	136,52	237,81	118,46
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	105,88	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	93,82	1 160,58	127,56	-	112,83
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	96,05	1 221,98	128,16	-	113,22
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	102,06	104,90	105,55	221,12	115,81
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	1 065,45	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	188,93	-	117,41
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	236,05	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	237,14	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	227,65	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	101,08	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5 851,33
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5 641,43
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5 671,85
Klasse E Thes.	110,23	-	137,92	236,00	120,71
Klasse E Thes. CHF	96,45	-	-	-	-
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	94,54	-	128,05	-	114,22
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	98,76	-	129,31	-	115,35
Klasse E Thes. GBP	108,56	-	-	-	-
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	105,36	-	105,52	-	117,81
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	1 065,91	-	-
Klasse E Thes., in SGD abgesichert	-	-	190,34	-	119,58
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	104,12	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	1 466,48	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	1 155,70	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	1 214,16	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	1 173,41	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	1 569,30	-	-	-
Klasse I Thes.	121,74	1 662,84	157,11	341,27	125,92
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	1 407,79	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	1 484,33	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	10 608,63	-	-	12 903,29
Klasse I Thes., in USD abgesichert	-	-	-	275,98	-
Klasse IF Thes.	-	1 514,07	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	1 281,57	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	1 351,44	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	922,66	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	1 396,47	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	95,01	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	105,16	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	-	236,36	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	114,60

\* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Wahrung der Anteilsklasse ausgewiesen.

# Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund* GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
<b>Nettoinventarwert je Anteil**</b>					
zum 30. September 2021					
Klasse A Thes.	-	151,88	-	-	110,83
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	181,00	-	-	102,32
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	136,50	-	-	103,28
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	152,54
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	109,29
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	101,37	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	100,89	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	101,01	-	-	-	-
Klasse C Thes.	101,56	158,46	114,81	116,22	113,26
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	116,73
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	101,09	187,13	103,24	146,22	104,63
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	101,21	142,29	105,29	131,06	105,57
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	101,46	148,13	109,54	-	86,96
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	155,95
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	154,88	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	148,04	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5 666,93
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5 228,86
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5 284,23
Klasse E Thes.	101,53	169,60	-	-	115,46
Klasse E Thes. CHF	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	101,08	-	-	-	106,46
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	101,26	152,59	-	-	107,49
Klasse E Thes. GBP	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	101,52	-	-	-	88,64
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	159,01
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	101,84	205,53	133,89	123,90	121,92
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	112,18	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	100,80	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	102,70	128,06	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	151,95	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	116,14	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	131,08	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	154,92	-
Klasse X Thes.	-	104,86	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	151,00	-	-	-

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen.



# Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2023

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short* USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
<b>VERMÖGENSWERTE</b>						
<b>Anlagen</b>						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	9 706 301	310 817 756	2 459 088 034	122 058 181	283 368 041	257 782 776
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	102 103	(24 082 685)	(74 233 570)	10 390 302	42 100 088	(7 112 602)
<b>Wertpapiere zum Marktwert</b>	<b>9 808 404</b>	<b>286 735 071</b>	<b>2 384 854 464</b>	<b>132 448 483</b>	<b>325 468 129</b>	<b>250 670 174</b>
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	(126 011)	(1 466 806)	6 420 347	(306 441)	(2 699 657)	(2 989 323)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	7 535 496	-	-	-	2 354 606
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	5 760 685	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	9 220 465	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	9 000 344	9 087 736
aus Differenzkontrakten	175 559	150 181	-	2 202 594	-	(7 168 577)
	<b>49 548</b>	<b>21 200 021</b>	<b>6 420 347</b>	<b>1 896 153</b>	<b>6 300 687</b>	<b>1 284 442</b>
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	297 694	37 119 434	3 600 791	3 856 723	15 296 638
Bankguthaben	675 373	45 170 278	48 817 222	21 113 677	63 689 452	41 258 800
Termineinlagen	-	-	-	-	-	-
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	3 313 396	-	-	-	1 868 849
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	36 445	54 527 985	40 540 000	7 020 411	21 644 379	-
Forderungen aus Zeichnungen	-	579 712	-	613 389	1 147 989	500 897
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	-	-	445 334
Dividenden und Zinsforderungen	47 788	409 784	35 600 239	235 671	838 243	4 439 158
Erstattungsforderung des Fonds	-	246 495	15 390	-	-	2 484
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	880 000	5 430 000	160 000	-	820 000
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	1 000 000	-	220 000	1 260 000	700 000
Sonstige Forderungen**	-	-	-	-	3 577 098	-
<b>SUMME VERMÖGENSWERTE</b>	<b>10 617 558</b>	<b>414 360 436</b>	<b>2 558 797 096</b>	<b>167 308 575</b>	<b>427 782 700</b>	<b>317 286 776</b>
<b>VERBINDLICHKEITEN</b>						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	-	324 707	27 130 873	9 436 173	14 022 396	6 611 827
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	-	1 079 537	-	459 866	849 856	2 679 559
Fällige Managementgebühren	5	347 087	1 739 722	167 107	491 108	179 892
Fällige Performancegebühren	43	465	927 912	-	-	-
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	10 490	662	-	59 191	162 621	1 038 626
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	-	-	-	3 042 408
Optionen zum Marktwert	-	-	-	1 008 030	-	-
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	730 000	-
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	1 880 000	5 430 000	380 000	530 000	1 520 000
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen***	3 216	9 750 639	43 710 303	1 871 515	427 124	5 551 184
<b>SUMME VERBINDLICHKEITEN</b>	<b>13 754</b>	<b>13 383 097</b>	<b>78 938 810</b>	<b>13 381 882</b>	<b>17 213 105</b>	<b>20 623 496</b>
<b>SUMME NETTOVERMÖGEN</b>	<b>10 603 804</b>	<b>400 977 339</b>	<b>2 479 858 286</b>	<b>153 926 693</b>	<b>410 569 595</b>	<b>296 663 280</b>

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Die sonstigen Forderungen umfassen Forderungen aus Devisenkassageschäften und verschiedene andere Forderungen.

\*\*\* Die sonstigen Verbindlichkeiten und Rückstellungen beinhalten Verbindlichkeiten aus Devisenkassageschäften sowie Verbindlichkeiten aus Verwaltungs-, Depot- und sonstigen Gebühren.

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity* USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe** EUR
<b>VERMÖGENSWERTE</b>						
<b>Anlagen</b>						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	65 958 465	282 697 440	147 944 688	5 164 828	446 437 468	4 168 594 827
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	(2 887 926)	(10 810 845)	11 659 646	(59 644)	7 520 386	(42 567 528)
<b>Wertpapiere zum Marktwert</b>	<b>63 070 539</b>	<b>271 886 595</b>	<b>159 604 334</b>	<b>5 105 184</b>	<b>453 957 854</b>	<b>4 126 027 299</b>
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	1 250 708	(1 441 701)	129 844	(370 562)	664 397	(1 030 750)
aus Kassageschäften	-	-	-	17 487	-	16 540
aus Terminkontrakten	-	-	-	3 214 574	388 804	12 762 810
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	(854 319)	(808 058)
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	(107 628)	(252 884)	5 107 754
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	19 444	18 391
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	190 759	180 429
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	(614 430)	8 140 020
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	2 203 320	4 846 767	1 357 944	25 548 717
aus Differenzkontrakten	-	1 767 521	-	-	-	(2 717 164)
	<b>1 250 708</b>	<b>325 820</b>	<b>2 333 164</b>	<b>7 600 638</b>	<b>899 715</b>	<b>47 218 689</b>
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	556 335	39 105 303	857 574	52 701 611	19 733 681	163 959 882
Bankguthaben	4 713 345	29 990 225	16 636 217	310 472 763	33 069 022	585 720 130
Termineinlagen	-	-	-	221 977 000	-	209 956 968
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	15 730 630	18 588 446	37 362 329
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	330 000	7 106 984	-	11 556 637	373 186	136 557 267
Forderungen aus Zeichnungen	430 747	471 614	-	233 895	231 349	4 043 807
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	3 302 975	-	-	2 041 963	5 476 729
Dividenden und Zinsforderungen	983 265	668 921	236 290	85 409	1 616 455	42 761 138
Erstattungsforderung des Fonds	-	12 296	-	-	-	261 684
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	50 000	690 000	110 000	420 000	960 000	9 004 493
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	50 000	600 000	90 000	540 000	900 000	5 137 985
Sonstige Forderungen***	-	-	-	-	86 170	3 658 600
<b>SUMME VERMÖGENSWERTE</b>	<b>71 434 939</b>	<b>354 160 733</b>	<b>179 867 579</b>	<b>626 423 767</b>	<b>532 457 841</b>	<b>5 377 147 000</b>
<b>VERBINDLICHKEITEN</b>						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	1 290 181	315 885	3 542 688	221 977 000	28 802 766	297 240 278
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	628	15 728 906	751 534	14 855 563	8 066 893	42 110 189
Fällige Managementgebühren	22 960	372 388	232 701	459 580	508 153	4 302 501
Fällige Performancegebühren	-	32	1 089 270	3 238 119	19 773	4 989 940
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	-	319 245	162 766	714 728	1 250 719	3 526 468
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	1 520 000	-	-	4 315 354
Optionen zum Marktwert	-	-	-	-	-	953 445
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	-	730 000
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	100 000	1 290 000	200 000	960 000	1 860 000	13 412 478
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen****	428 128	5 008 310	931 604	5 299 649	8 343 378	76 944 436
<b>SUMME VERBINDLICHKEITEN</b>	<b>1 841 897</b>	<b>23 034 766</b>	<b>8 430 563</b>	<b>247 504 639</b>	<b>48 851 682</b>	<b>448 525 089</b>
<b>SUMME NETTOVERMÖGEN</b>	<b>69 593 042</b>	<b>331 125 967</b>	<b>171 437 016</b>	<b>378 919 128</b>	<b>483 606 159</b>	<b>4 928 621 911</b>

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Für die in Euro angegebene Summe der Nettovermögensaufstellung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit dem folgenden Wechselkurs vom 30. September 2023 umgerechnet: 1 Euro = 0,94585 US-Dollar.

\*\*\* Die sonstigen Forderungen umfassen Forderungen aus Devisenkassageschäften und verschiedene andere Forderungen.

\*\*\*\* Die sonstigen Verbindlichkeiten und Rückstellungen beinhalten Verbindlichkeiten aus Devisenkassageschäften sowie Verbindlichkeiten aus Verwaltungs-, Depot- und sonstigen Gebühren.

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short* USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD	Schroder GAIA Oaktree Credit USD
<b>ERTRÄGE</b>							
Nettodividenden <sup>^</sup>	287 822	66 998	-	-	3 280 407	16 618 660	36 709
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	-	879 882	122 127 724	-	-	700 942	4 119 559
Nettoertrag aus Swaps	179 372	5 600 485	-	5 467 461	1 780 931	4 449 152	-
Bankzinsen	34 413	3 692 912	7 468 158	1 239 536	1 394 712	1 884 296	137 548
Sonstige Erträge	-	4	37 500	-	40 427	16 399	1 289
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>501 607</b>	<b>10 240 281</b>	<b>129 633 382</b>	<b>6 706 997</b>	<b>6 496 477</b>	<b>23 669 449</b>	<b>4 295 105</b>
<b>AUFWAND</b>							
Performancegebühren	43	465	927 912	-	-	-	-
Managementgebühren	51	4 680 880	20 725 790	2 246 501	6 972 276	2 313 804	289 951
Nettodividendenaufwand <sup>^</sup>	-	-	26 747	1 394 074	-	-	-
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	-	-	-	-	-
Verwahrstellengebühren	2 844	314 835	578 595	41 251	119 056	97 555	50 909
Verwaltungsgebühren	6 533	1 341 125	3 459 837	520 623	1 469 498	396 846	90 518
Taxe d'abonnement	1 051	221 888	310 460	80 896	214 892	110 675	23 654
Vertriebsgebühren	-	-	-	6 656	99 164	-	-
Bank- und Zinskosten	46	46 347	30 886	643	2 806	12 389	78 807
Sonstige Aufwendungen	1 900	275 643	779 690	88 221	1 086 734	193 946	23 798
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>12 468</b>	<b>6 881 183</b>	<b>26 839 917</b>	<b>4 378 865</b>	<b>9 964 426</b>	<b>3 125 215</b>	<b>557 637</b>
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	246 495	15 390	-	-	2 484	-
<b>NETTOANLAGEERTRAG/ (-VERLUST)</b>	<b>489 139</b>	<b>3 605 593</b>	<b>102 808 855</b>	<b>2 328 132</b>	<b>(3 467 949)</b>	<b>20 546 718</b>	<b>3 737 468</b>

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

<sup>^</sup> Einschliesslich erhaltene/gezahlte Dividenden im Zusammenhang mit Derivaten mit zugrunde liegenden Anteilswerten.

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA SEG US Equity* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund* GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe** EUR
<b>ERTRÄGE</b>						
Nettodividenden <sup>^</sup>	-	946 033	144 347	302 191	-	20 716 710
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	-	386 348	91 739	13 083 418	2 473 742	136 092 266
Nettoertrag aus Swaps	179 461	730 090	-	-	-	17 487 738
Bankzinsen	447 756	488 842	90 176	8 093 376	4 174 058	27 661 838
Sonstige Erträge	457 000	272	-	-	5	525 146
<b>Erträge insgesamt</b>	<b>1 084 217</b>	<b>2 551 585</b>	<b>326 262</b>	<b>21 478 985</b>	<b>6 647 805</b>	<b>202 483 698</b>
<b>AUFWAND</b>						
Performancegebühren	32	1 089 270	-	3 238 119	19 773	4 989 940
Managementgebühren	1 218 357	3 122 166	213 279	8 047 490	7 670 985	54 809 777
Nettodividendenaufwand <sup>^</sup>	400 154	-	-	-	139 813	1 854 611
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	130 324	24 277 203	1 096 960	24 150 553
Verwahrstellengebühren	24 212	46 352	11 076	136 731	333 781	1 670 798
Verwaltungsgebühren	173 364	588 226	75 184	1 661 556	1 871 202	11 118 646
Taxe d'abonnement	39 096	94 594	11 261	255 137	298 209	1 585 807
Vertriebsgebühren	-	-	-	-	-	105 460
Bank- und Zinskosten	-	106	12	48 185	123 914	325 660
Sonstige Aufwendungen	47 891	85 532	69 736	254 145	706 449	3 491 369
<b>Aufwendungen insgesamt</b>	<b>1 903 106</b>	<b>5 026 246</b>	<b>510 872</b>	<b>37 918 566</b>	<b>12 261 086</b>	<b>104 102 621</b>
Abzüglich: Kostenzuschüsse	12 296	-	-	-	-	261 684
<b>NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)</b>	<b>(806 593)</b>	<b>(2 474 661)</b>	<b>(184 610)</b>	<b>(16 439 581)</b>	<b>(5 613 281)</b>	<b>98 642 761</b>

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Für die in Euro angegebene Summe der Ertrags- und Aufwandsrechnung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 30. September 2023 umgerechnet: 1 Euro = 0,94585 US-Dollar und 1 Euro = 1,15403 Pfund Sterling.

<sup>^</sup> Einschliesslich erhaltene/gezahlte Dividenden im Zusammenhang mit Derivaten mit zugrunde liegenden Anteilswerten.

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short* USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD	Schroder GAIA Oaktree Credit USD
<b>NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)**</b>	<b>489 139</b>	<b>3 605 593</b>	<b>102 808 855</b>	<b>2 328 132</b>	<b>(3 467 949)</b>	<b>20 546 718</b>	<b>3 737 468</b>
<b>Realisierter Nettogewinn/(Verlust)</b>							
aus verkauften Wertpapieren	249 858	38 746	14 459 597	(4 447 028)	32 868 972	(3 213 272)	(566 488)
aus Devisenterminkontrakten	(5 616)	41 585 247	21 940 054	5 458 645	29 356 883	21 355 677	(493 900)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	(46 359 877)	430	-	476 064	(13 267 294)	42 905
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	(8 210 941)	-	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	887 973	-	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	20 534 694	(78 121 541)	-
aus Differenzkontrakten	(274 501)	-	-	2 079 260	-	62 425 167	-
aus Versicherungsprämien	-	-	115 075 452	-	-	-	-
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	2 869 422	-	805 668	-	(2 452 300)	(353)
aus Devisengeschäften	(12 471)	(946 184)	2 932 099	(19 560)	2 685 460	(10 257 685)	(136 875)
<b>Realisierter Nettogewinn/(Verlust)</b>	<b>(42 730)</b>	<b>(10 135 614)</b>	<b>154 407 632</b>	<b>3 876 985</b>	<b>85 922 073</b>	<b>(23 531 248)</b>	<b>(1 154 711)</b>
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwaches/ (Wertverlustes)</b>							
aus Anlagen	102 103	(14 385 341)	196 272 435	45 053 433	6 373 162	59 972 821	4 489 809
aus Devisenterminkontrakten	(126 011)	(12 478 911)	(1 315 925)	(498 072)	1 480 328	4 013 615	183 564
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	222 471	-	-	(2 219 883)	(11 506 487)	(43 173)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	4 270 772	-	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	1 519 944	-	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	(26 549 873)	(26 419 591)	-
aus Differenzkontrakten	175 559	(428 530)	-	(14 226 977)	-	22 748 355	-
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	22 384	-	269 212	-	(641 856)	(422)
aus Devisengeschäften	(256)	(410 340)	27 799	(8 358)	249 722	(149 070)	46 577
<b>NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/ (WERTVERLUSTES)</b>	<b>151 395</b>	<b>(21 667 551)</b>	<b>194 984 309</b>	<b>30 589 238</b>	<b>(20 666 544)</b>	<b>48 017 787</b>	<b>4 676 355</b>
<b>NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB</b>	<b>597 804</b>	<b>(28 197 572)</b>	<b>452 200 796</b>	<b>36 794 355</b>	<b>61 787 580</b>	<b>45 033 257</b>	<b>7 259 112</b>
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	10 006 000	242 009 370	557 465 603	34 752 920	58 940 722	137 610 643	31 599 635
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	-	(184 098 355)	(501 920 313)	(137 155 614)	(298 756 479)	(376 321 007)	(16 674 098)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	(187 270)	(4 741 511)	-	-	(23 328)	(108 020)
<b>Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Geschäftsjahres</b>	<b>10 603 804</b>	<b>29 526 173</b>	<b>503 004 575</b>	<b>(65 608 339)</b>	<b>(178 028 177)</b>	<b>(193 700 435)</b>	<b>22 076 629</b>
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	-	371 451 166	1 976 853 711	219 535 032	588 597 772	490 363 715	47 516 413
Nennwährungsanpassung***	-	-	-	-	-	-	-
<b>NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES</b>	<b>10 603 804</b>	<b>400 977 339</b>	<b>2 479 858 286</b>	<b>153 926 693</b>	<b>410 569 595</b>	<b>296 663 280</b>	<b>69 593 042</b>

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Die Berechnung des Nettoanlageertrags/(-verlusts) finden Sie in der Ertrags- und Aufwandsrechnung.

\*\*\* Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2022 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 30. September 2023.

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA SEG US Equity* USD	Schroder GAIA Sirius US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund* GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe** EUR
<b>NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)***</b>	<b>(806 593)</b>	<b>(2 474 661)</b>	<b>(184 610)</b>	<b>(16 439 581)</b>	<b>(5 613 281)</b>	<b>98 642 761</b>
<b>Realisierter Nettogewinn/(Verlust)</b>						
aus verkauften Wertpapieren	(349 741)	9 673 452	(2 123 847)	1 456 764	26 236 566	71 598 835
aus Devisenterminkontrakten	(5 960 276)	1 611 647	(200 302)	19 394 742	27 686 073	154 519 246
aus Kassageschäften	-	-	-	10 265	-	9 709
aus Terminkontrakten	-	-	(175 331)	(10 769 833)	(10 129 714)	(75 851 489)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	(1 957 867)	(1 851 849)
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	46 255	(1 108 135)	(8 770 699)
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	132 634	125 452
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	447 790	423 542
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	(4 740 205)	(3 643 634)
aus Total Return Swapkontrakten	-	3 581 217	-	64 539 557	(1 916 803)	9 262 459
aus Differenzkontrakten	(5 505 376)	-	179 242	-	-	55 751 473
aus Versicherungsprämien	-	-	-	-	-	108 844 128
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	(893 955)	666 370	(39 064)	-	(14 318 148)	(12 646 922)
aus Devisengeschäften	(22 132)	3 954	3 665	45 353	(371 186)	(5 619 307)
<b>Realisierter Nettogewinn/(Verlust)</b>	<b>(12 731 480)</b>	<b>15 536 640</b>	<b>(2 355 637)</b>	<b>74 723 103</b>	<b>19 961 005</b>	<b>292 150 944</b>
<b>Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwaches/(Wertverlustes)</b>						
aus Anlagen	(10 810 845)	20 928 897	2 843 271	(9 125)	29 209 371	322 563 883
aus Devisenterminkontrakten	(1 441 701)	(564 881)	(90 379)	(2 372 780)	(4 458 640)	(16 651 631)
aus Kassageschäften	-	-	-	5 055	-	4 781
aus Terminkontrakten	-	-	(138 600)	(522 408)	990 544	(12 650 868)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	(2 276 965)	(2 153 667)
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	(643 735)	(501 579)	2 956 215
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	25 412	24 036
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	180 982	171 182
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	694 067	2 094 123
aus Total Return Swapkontrakten	-	(5 492 261)	-	(13 171 030)	(11 168 218)	(79 754 982)
aus Differenzkontrakten	1 767 521	-	(263 253)	-	-	9 188 681
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	(353 820)	-	-	-	(196 963)	(852 651)
aus Devisengeschäften	(121)	7 562	(4 186)	87 287	(527 137)	(631 020)
<b>NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)</b>	<b>(10 838 966)</b>	<b>14 879 317</b>	<b>2 346 853</b>	<b>(16 626 736)</b>	<b>11 970 874</b>	<b>224 308 082</b>
<b>NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB</b>	<b>(24 377 039)</b>	<b>27 941 296</b>	<b>(193 394)</b>	<b>41 656 786</b>	<b>26 318 598</b>	<b>615 101 787</b>
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	398 073 705	32 105 905	1 937 941	86 274 486	193 454 371	1 691 210 435
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(42 570 699)	(77 079 251)	(42 369 816)	(443 858 159)	(351 705 383)	(2 363 621 304)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	-	-	-	-	(4 786 124)
<b>Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Geschäftsjahres</b>	<b>331 125 967</b>	<b>(17 032 050)</b>	<b>(40 625 269)</b>	<b>(315 926 887)</b>	<b>(131 932 414)</b>	<b>(62 095 206)</b>
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	-	188 469 066	40 625 269	694 846 015	615 538 573	5 333 186 258
Nennwährungsanpassung****	-	-	-	-	-	(342 469 141)
<b>NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES</b>	<b>331 125 967</b>	<b>171 437 016</b>	<b>-</b>	<b>378 919 128</b>	<b>483 606 159</b>	<b>4 928 621 911</b>

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Für die in Euro angegebene Summe der Veränderung des Nettovermögens wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 30. September 2023 umgerechnet: 1 Euro = 0,94585 US-Dollar und 1 Euro = 1,15403 Pfund Sterling.

\*\*\* Die Berechnung des Nettoanlageertrags/(-verlusts) finden Sie in der Ertrags- und Aufwandsrechnung.

\*\*\*\* Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2022 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 30. September 2023.

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short* %	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
<b>Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel</b>	43,99	71,51	93,40	-	-	26,16
<b>Sonstige Wertpapiere</b>						
Werbung	-	-	-	-	-	-
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	-	-	2,04	0,42
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	-	-
Fluggesellschaften	-	-	-	-	-	0,06
Bekleidung	1,42	-	-	-	-	0,93
Automobilhersteller	-	-	-	-	-	0,34
Autoteile und -zubehör	1,89	-	-	-	-	1,45
Banken	2,79	-	-	-	8,26	7,43
Getränke	-	-	-	-	-	0,44
Biotechnologie	-	-	-	-	-	0,13
Baustoffe	-	-	-	-	-	0,59
Chemie	-	-	-	-	-	0,59
Gewerbliche Dienstleistungen	3,11	-	-	1,34	-	1,04
Computer	1,57	-	-	-	-	0,47
Kosmetik und Körperpflege	-	-	-	-	-	-
Vertrieb und Grosshandel	-	-	-	-	-	-
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	-	2,19	9,93	1,88
Elektrik	-	-	-	-	-	0,74
Elektrische Bauteile und Geräte	0,85	-	-	-	-	0,38
Elektronik	3,79	-	-	6,96	-	3,16
Energie – Alternative Energiequellen	-	-	-	-	-	0,06
Bau- und Ingenieurwesen	-	-	-	-	-	0,42
Unterhaltung	-	-	-	-	-	-
Umweltschutz	-	-	-	-	-	-
Lebensmittel	-	-	-	-	-	0,98
Forstwirtschaftliche Erzeugnisse und Papier	-	-	-	-	-	0,45
Gas	-	-	-	-	-	-
Gesundheitswesen – Produkte	-	-	-	-	-	0,04
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	-	-	-	-	0,74
Wohngebäude-Bauträger	-	-	-	-	-	-
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	-	0,74
Haushaltswaren	1,27	-	-	-	-	0,49
Versicherung	1,36	-	2,77	-	9,74	1,09
Internet	1,36	-	-	29,56	13,68	0,71
Investmentgesellschaften	-	-	-	-	0,63	6,63
Eisen und Stahl	-	-	-	-	-	1,19
Freizeit	1,18	-	-	-	-	0,58
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	0,76	0,09
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	-	0,40
Maschinen – Diversifiziert	1,13	-	-	-	-	0,58
Medien	-	-	-	4,54	-	-
Metallprodukte und Eisenwaren	1,20	-	-	-	-	0,12
Bergbau	0,57	-	-	-	-	0,43
Diverse Fertigungsbetriebe	-	-	-	-	3,62	-
Öl und Gas	-	-	-	-	4,06	1,01
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	4,60	-

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.



# Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short* %	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
<b>Sonstige Wertpapiere (Forts.)</b>						
Verpackung und Container	-	-	-	-	-	0,07
Pharmazeutika	-	-	-	-	2,44	0,73
Pipelines	-	-	-	-	-	-
Immobilien	-	-	-	-	-	1,36
Einzelhandel	1,16	-	-	-	-	2,24
Halbleiter	22,04	-	-	8,32	-	15,74
Software	-	-	-	33,14	6,49	0,19
Telekommunikation	1,82	-	-	-	-	1,21
Transport	-	-	-	-	13,02	-
Wasser	-	-	-	-	-	-
<b>Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens</b>	<b>92,50</b>	<b>71,51</b>	<b>96,17</b>	<b>86,05</b>	<b>79,27</b>	<b>84,50</b>
<b>Termineinlagen</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>7,50</b>	<b>28,49</b>	<b>3,83</b>	<b>13,95</b>	<b>20,73</b>	<b>15,50</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA SEG US Equity* %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
<b>Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel</b>	90,63	-	19,06	0,03	59,00
<b>Sonstige Wertpapiere</b>					
Werbung	-	-	-	-	0,04
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	2,17	-	0,15
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	0,13
Fluggesellschaften	-	-	1,20	-	-
Bekleidung	-	-	-	-	-
Automobilhersteller	-	-	1,50	-	0,13
Autoteile und -zubehör	-	-	-	-	0,16
Banken	-	-	2,14	-	4,67
Getränke	-	-	1,62	-	-
Biotechnologie	-	-	-	-	2,14
Baustoffe	-	4,41	-	-	0,44
Chemie	-	-	-	-	0,15
Gewerbliche Dienstleistungen	-	5,87	6,86	-	0,75
Computer	-	-	0,80	-	-
Kosmetik und Körperpflege	-	-	-	-	0,31
Vertrieb und Grosshandel	-	0,87	-	-	-
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	0,96	-	1,54
Elektrik	-	-	-	-	1,57
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	0,03
Elektronik	-	2,63	1,41	-	0,15
Energie – Alternative Energiequellen	-	-	-	-	0,07
Bau- und Ingenieurwesen	-	2,98	-	-	0,17
Unterhaltung	-	11,00	-	-	-
Umweltschutz	-	3,66	2,13	-	0,04
Lebensmittel	-	-	-	-	0,22
Forstwirtschaftliche Erzeugnisse und Papier	-	-	-	-	-
Gas	-	-	-	-	0,63
Gesundheitswesen – Produkte	-	4,33	14,69	-	1,22
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	-	1,21	-	0,83
Wohngebäude-Bauträger	-	-	-	-	0,16
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	0,09
Haushaltswaren	-	-	-	-	-
Versicherung	-	4,70	-	-	1,33
Internet	-	6,02	1,95	-	0,83
Investmentgesellschaften	-	-	1,77	1,32	2,11
Eisen und Stahl	-	-	-	-	0,02
Freizeit	-	-	2,84	-	-
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	-
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	0,29
Maschinen – Diversifiziert	-	9,69	-	-	0,38
Medien	-	-	-	-	0,12
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	0,06
Bergbau	-	-	-	-	0,57
Diverse Fertigungsbetriebe	-	3,41	1,49	-	0,17
Öl und Gas	-	-	2,15	-	7,22
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	1,00	-	0,58

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA SEG US Equity* %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
<b>Sonstige Wertpapiere (Forts.)</b>					
Verpackung und Container	-	-	-	-	-
Pharmazeutika	-	-	4,49	-	2,14
Pipelines	-	-	-	-	0,76
Immobilien	-	-	-	-	0,26
Einzelhandel	-	5,07	0,96	-	0,32
Halbleiter	-	4,53	4,64	-	0,60
Software	-	12,94	12,07	-	0,84
Telekommunikation	-	-	1,12	-	0,19
Transport	-	-	2,87	-	0,27
Wasser	-	-	-	-	0,02
<b>Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens</b>	<b>90,63</b>	<b>82,11</b>	<b>93,10</b>	<b>1,35</b>	<b>93,87</b>
<b>Termineinlagen</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>58,58</b>	<b>-</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>	<b>9,37</b>	<b>17,89</b>	<b>6,90</b>	<b>40,07</b>	<b>6,13</b>
<b>Summe Nettovermögen</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>	<b>100,00</b>

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023

## Schroder GAIA Asian Equity Long Short\*

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Aktien</b>				
<b>China</b>			<b>447 970</b>	<b>4,22</b>
7 200	CNH	Contemporary Amperex Technology	200 325	1,89
46 800	CNH	Yizumi Holdings	120 252	1,13
31 300	CNH	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	127 393	1,20
<b>Indonesien</b>			<b>182 446</b>	<b>1,72</b>
468 000	IDR	Bank Mandiri Persero	182 446	1,72
<b>Philippinen</b>			<b>443 299</b>	<b>4,18</b>
45 420	PHP	BDO Unibank	113 919	1,07
56 300	PHP	International Container Terminal Services	206 190	1,95
316 800	PHP	Wilcon Depot	123 190	1,16
<b>Südkorea</b>			<b>1 419 913</b>	<b>13,39</b>
161	KRW	Korea Zinc	60 372	0,57
312	KRW	L&F	40 092	0,38
964	KRW	NAVER	143 950	1,36
16 539	KRW	Samsung Electronics	838 350	7,90
748	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	144 400	1,36
508	KRW	Samsung SDI	192 749	1,82
<b>Taiwan</b>			<b>2 650 459</b>	<b>25,00</b>
15 598	TWD	Advantech	166 705	1,57
67 000	TWD	ASE Technology Holding	227 273	2,14
18 000	TWD	Chroma ATE	153 901	1,45
5 000	TWD	Delta Electronics	50 263	0,47
10 000	TWD	Eclat Textile	150 865	1,42
16 000	TWD	MediaTek	364 307	3,44
23 000	TWD	Merida Industry	124 688	1,18
14 000	TWD	Nien Made Enterprise	134 446	1,27
10 000	TWD	Sinbon Electronics	100 215	0,95
15 750	TWD	Sporton International	123 197	1,16
56 000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	907 296	8,56
3 000	TWD	Voltronic Power Technology	147 303	1,39
<b>Summe Aktien</b>			<b>5 144 087</b>	<b>48,51</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind</b>			<b>5 144 087</b>	<b>48,51</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelteten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Anleihen</b>				
<b>USA</b>			<b>4 664 317</b>	<b>43,99</b>
685 000	USD	United States Treasury Bill 05/10/23, ZCP	684 499	6,46
600 000	USD	United States Treasury Bill 12/10/23, ZCP	598 946	5,65
500 000	USD	United States Treasury Bill 19/10/23, ZCP	498 611	4,70
500 000	USD	United States Treasury Bill 26/10/23, ZCP	498 097	4,70
500 000	USD	United States Treasury Bill 02/11/23, ZCP	497 581	4,69
500 000	USD	United States Treasury Bill 09/11/23, ZCP	497 074	4,69
700 000	USD	United States Treasury Bill 16/11/23, ZCP	695 180	6,55
700 000	USD	United States Treasury Bill 24/11/23, ZCP	694 329	6,55
<b>Summe Anleihen</b>			<b>4 664 317</b>	<b>43,99</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelteten Markt gehandelt werden</b>			<b>4 664 317</b>	<b>43,99</b>
<b>Summe Kapitalanlagen</b>			<b>9 808 404</b>	<b>92,50</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>			<b>795 400</b>	<b>7,50</b>
<b>Nettoinventarwert</b>			<b>10 603 804</b>	<b>100,00</b>

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA BlueTrend

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Anleihen</b>				
<b>USA</b>				
42 000 000	USD	United States Treasury Note 15/10/23, 0.13%	41 921 423	10,45
41 000 000	USD	United States Treasury Note 15/11/23, 0.25%	40 746 533	10,16
41 000 000	USD	United States Treasury Note 15/12/23, 0.13%	40 567 984	10,12
37 500 000	USD	United States Treasury Note 15/01/24, 0.13%	36 938 019	9,21
34 500 000	USD	United States Treasury Note 15/02/24, 0.13%	33 832 175	8,44
34 000 000	USD	United States Treasury Note 15/03/24, 0.25%	33 222 454	8,29
19 500 000	USD	United States Treasury Note 15/04/24, 0.38%	18 982 526	4,73
12 500 000	USD	United States Treasury Note 15/05/24, 0.25%	12 103 392	3,02
<b>Summe Anleihen</b>			<b>258 314 506</b>	<b>64,42</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind</b>			<b>258 314 506</b>	<b>64,42</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Anleihen</b>				
<b>Irland</b>				
858 627 315	USD	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	28 420 565	7,09
<b>Summe Anleihen</b>			<b>28 420 565</b>	<b>7,09</b>
<b>Summe sonstige Wertpapiere</b>			<b>28 420 565</b>	<b>7,09</b>
<b>Summe Kapitalanlagen</b>			<b>286 735 071</b>	<b>71,51</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>			<b>114 242 268</b>	<b>28,49</b>
<b>Nettoinventarwert</b>			<b>400 977 339</b>	<b>100,00</b>

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Cat Bond

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens		
<b>Aktien</b>													
<b>Bermuda</b>						<b>7 500 417</b>	<b>0,30</b>						
697		USD	Voussoir Re	7 500 417	0,30								
<b>Supranational</b>						<b>61 087 078</b>	<b>2,47</b>						
550		USD	Voussoir Re SideCar	89 100	-	20 250 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/23, variabel	19 782 225	0,80			
697		USD	Voussoir Re SideCar-Preference	76 670	-	8 250 000	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variabel	6 967 331	0,28			
530		USD	Voussoir Re SideCar-Preference	601 550	0,03	12 087 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variabel	12 018 406	0,48			
557		USD	Voussoir Re SideCar-Preference	60 319 758	2,44	4 380 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B1 21/04/25, variabel	4 253 418	0,17			
<b>Summe Aktien</b>						<b>68 587 495</b>	<b>2,77</b>	4 750 000	USD	Kilimanjaro III Re Series C1 21/04/25, variabel	4 644 431	0,19	
<b>Anleihen</b>													
<b>Bermuda</b>						<b>465 167 373</b>	<b>18,75</b>	8 500 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B2 20/04/26, variabel	8 056 513	0,32	
19 450 000		USD	Acorn Re 07/11/24, variabel	19 115 460	0,77	4 100 000	USD	Kilimanjaro III Re Series C2 20/04/26, variabel	3 898 895	0,16			
1 667 000		USD	Aquila Re I Series 2023-1A 08/06/26, variabel	1 689 004	0,07	706 475	USD	Manatee Re III 08/06/26, variabel	141 295	0,01			
6 076 000		USD	Aquila Re I Series 2023-1B 08/06/26, variabel	6 189 621	0,25	25 602 000	USD	Merna Reinsurance II 08/07/24, variabel	25 031 075	1,01			
7 971 000		USD	Aquila Re I Series 2023-1C 08/06/26, variabel	8 252 177	0,33	11 500 000	USD	Montoya Re 07/04/25, variabel	11 732 300	0,47			
10 263 000		USD	Baldwin Re 07/07/25, variabel	10 098 022	0,41	28 500 000	USD	Mystic Re IV 08/01/24, variabel	28 398 825	1,14			
2 667 000		USD	Blue Halo Re Series A 24/02/25, variabel	2 613 860	0,11	5 000 000	USD	Nakama Re 14/01/25, variabel	5 006 875	0,20			
3 500 000		USD	Blue Halo Re Series B 24/02/25, variabel	3 574 900	0,14	14 962 000	USD	Northshore Re II 08/01/24, variabel	14 950 030	0,60			
500 000		USD	Bowline Re 23/05/25, variabel	499 488	0,02	10 875 000	USD	Sanders Re II 07/04/24, variabel	10 797 244	0,44			
1 487 500		USD	Eden Re II 22/03/24, ZCP	433 011	0,02	9 917 000	USD	Sanders Re II Series A 07/04/25, variabel	9 439 001	0,38			
193 872		USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	142 030	0,01	16 447 000	USD	Sanders Re II Series A1 07/04/25, variabel	15 850 796	0,64			
24 512 000		USD	Everglades Re II Series A1 14/05/24, variabel	23 846 499	0,96	7 750 000	USD	Sanders Re III Series A 07/06/25, variabel	7 697 106	0,31			
28 750 000		USD	Everglades Re II Series A2 14/05/24, variabel	27 671 156	1,12	8 250 000	USD	Sanders Re III Series B 07/06/25, variabel	7 795 219	0,31			
22 750 000		USD	Everglades Re II Series B1 14/05/24, variabel	21 594 300	0,87	8 750 000	USD	Sanders Re III 07/04/26, variabel	7 157 938	0,29			
9 417 000		USD	Four Lakes Re 07/01/25, variabel	9 125 544	0,37	6 256 000	USD	Tailwind Re Series A 08/01/25, variabel	6 066 756	0,24			
24 450 000		USD	Galileo Re Series C 08/01/24, variabel	23 842 418	0,96	12 458 000	USD	Tailwind Re Series B 08/01/25, variabel	11 985 219	0,48			
9 650 000		USD	Galileo Re Series D 08/01/24, variabel	9 451 693	0,38	5 152 000	USD	Tailwind Re Series C 08/01/25, variabel	5 052 824	0,20			
6 400 000		USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	6 248 160	0,25	250 000	USD	Tailwind Re Series D 08/01/25, variabel	248 238	0,01			
5 000 000		USD	Integrity Re 12/06/28, variabel	4 487 500	0,18	14 500 000	USD	Titania Re 21/06/24, variabel	14 333 975	0,58			
12 000 000		USD	Kilimanjaro III Re Series A1 19/12/23, variabel	10 134 300	0,41	17 107 000	USD	Titania Re 27/12/24, variabel	16 442 821	0,66			

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
9 250 000	USD	Tomoni Re Series A 07/04/26, variabel	9 104 313	0,37
9 475 000	USD	Tomoni Re Series B 07/04/26, variabel	9 305 161	0,38
1 384 000	USD	Voussior Re 01/03/24, variabel	-	-
<b>Irland</b>			<b>38 662 530</b>	<b>1,56</b>
9 356 000	EUR	Azzurro Re II DAC 17/01/24, variabel	9 895 093	0,40
11 966 000	EUR	Hexagon II Reinsurance DAC 17/01/24, variabel	11 772 438	0,47
16 500 000	USD	Queen Street 2023 Re DAC 08/12/25, variabel	16 994 999	0,69
<b>Singapur</b>			<b>77 797 839</b>	<b>3,14</b>
9 033 000	USD	Easton Re 08/01/24, variabel	9 075 681	0,37
7 750 000	USD	Integrity Re II 12/04/28, variabel	5 231 250	0,21
6 250 000	USD	Kizuna Re III 07/04/26, variabel	6 189 063	0,25
46 075 000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	45 977 090	1,85
4 012 000	USD	Phoenix 3 Re 04/01/29, ZCP	4 449 463	0,18
11 500 000	NZD	Totara Re 08/06/27, 13.39%	6 875 292	0,28
<b>Supranational</b>			<b>47 664 771</b>	<b>1,92</b>
17 500 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 29/12/23, variabel	17 538 062	0,71
2 763 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 13/03/24, variabel	2 760 099	0,11
5 050 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 13/03/24, variabel	5 037 375	0,20
6 700 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series C 13/03/24, variabel	6 645 060	0,27
4 750 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series D 13/03/24, variabel	4 679 938	0,19
10 750 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 31/03/26, variabel	11 004 237	0,44
<b>Summe Anleihen</b>			<b>629 292 513</b>	<b>25,37</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind</b>			<b>697 880 008</b>	<b>28,14</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
<b>Anleihen</b>				
<b>Bermuda</b>			<b>1 215 403 214</b>	<b>49,02</b>
7 308 000	USD	2001 Cat Re 08/01/24, variabel	7 297 952	0,29
36 059 000	USD	Alamo Re 07/06/24, variabel	35 682 182	1,45
8 432 000	USD	Alamo Re 07/06/26, variable	8 587 781	0,35
2 450 000	USD	Artex 17/01/25, variabel	-	-
2 761 000	USD	Baldwin Re 07/07/27, variabel	2 745 262	0,11
4 600 000	USD	Bayou Re Series A 26/05/26, variabel	4 660 605	0,19
2 000 000	USD	Bayou Re Series B 26/05/26, variabel	2 075 850	0,08
19 855 000	USD	Bonanza Re 20/02/24, variabel	18 896 004	0,76
18 996 000	USD	Bonanza Re 23/12/24, variabel	17 112 547	0,69
12 250 000	USD	Bonanza Re 16/03/25, variabel	9 187 500	0,37
6 750 000	USD	Bonanza Re 08/01/26, variabel	6 800 288	0,27
3 333 000	USD	Bowline Re Series 2022-1 23/05/25, variabel	3 335 750	0,13
24 917 000	USD	Cape Lookout Re 22/03/24, variabel	24 599 930	0,99
10 000 000	USD	Cape Lookout Re 28/03/25, variabel	9 708 000	0,39
9 905 000	USD	Cape Lookout Re 28/04/26, variabel	10 094 928	0,41
6 750 000	USD	Citrus Re 07/06/25, variabel	6 680 981	0,27
7 500 000	USD	Citrus Re Series A 07/06/26, variabel	7 664 250	0,31
5 000 000	USD	Citrus Re Series B 07/06/26, variabel	5 026 375	0,20
10 833 000	USD	Commonwealth Re 08/07/25, variabel	10 902 602	0,44
6 546 000	USD	Commonwealth Re 08/07/26, variabel	6 641 735	0,27
526 606	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP	235 920	0,01
1 077 899	USD	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP	481 821	0,02
2 819 160	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	2 106 194	0,08
1 500 000	USD	Eden Re II Series A 19/03/27, ZCP	1 559 850	0,06
10 000 000	USD	Eden Re II Series B 19/03/27, ZCP	10 399 000	0,42
26 762 000	USD	Everglades Re II 16/01/24, ZCP	25 684 829	1,04
18 282 000	USD	Everglades Re II Series A 16/01/24, ZCP	17 482 163	0,70

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
7 750 000	USD	Everglades Re II 19/05/25, variabel	7 426 050	0,30	7 500 000	USD	Matterhorn Re 08/01/24, variabel	6 268 313	0,25
1 250 000	USD	Finca Re 06/06/25, variabel	1 286 688	0,05	4 257 000	USD	Matterhorn Re 07/06/24, variabel	4 344 907	0,18
34 654 000	USD	FloodSmart Re Series A 01/03/24, variabel	34 679 990	1,41	7 750 000	USD	Matterhorn Re 24/03/25, variabel	7 714 156	0,31
5 625 000	USD	FloodSmart Re Series B 01/03/24, variabel	4 789 406	0,19	11 500 000	USD	Matterhorn Re Series A 24/03/25, variabel	11 248 438	0,45
25 020 000	USD	FloodSmart Re Series A 25/02/25, variabel	24 107 395	0,97	14 250 000	USD	Matterhorn Re 08/12/25, variabel	12 972 131	0,52
8 750 000	USD	FloodSmart Re Series B 25/02/25, variabel	8 742 781	0,35	7 600 000	USD	Matterhorn Re 25/01/27, variabel	7 621 108	0,31
2 250 000	USD	FloodSmart Re Series C 25/02/25, variabel	2 208 150	0,09	5 250 000	USD	Mayflower Re Series A 08/07/26, variabel	5 309 588	0,21
17 708 000	USD	FloodSmart Re Series A 11/03/26, variabel	18 337 519	0,74	4 750 000	USD	Mayflower Re Series B 08/07/26, variabel	4 836 213	0,20
4 500 000	USD	FloodSmart Re Series B 11/03/26, variabel	4 721 738	0,19	20 144 000	USD	Merna Reinsurance II 05/04/24, variabel	20 095 150	0,81
7 917 000	USD	Four Lakes Re 07/01/26, variabel	7 938 772	0,32	15 000 000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/25, variabel	15 027 750	0,61
3 806 744	USD	Frontline Re 06/07/26, variabel	2 093 709	0,08	12 000 000	USD	Merna Reinsurance II Series 2 07/07/25, variabel	11 330 400	0,46
7 680 000	USD	Gateway Re II 27/04/26, variabel	7 792 128	0,31	19 000 000	USD	Merna Reinsurance II Series 3 07/07/25, variabel	19 271 225	0,78
5 000 000	USD	Herbie Re 08/07/24, variabel	5 046 750	0,20	9 091 000	USD	Merna Reinsurance II Series A 07/07/26, variabel	9 236 911	0,37
3 833 000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	3 771 768	0,15	9 091 000	USD	Merna Reinsurance II Series B 07/07/26, variabel	9 708 733	0,39
9 250 000	USD	Hestia Re 22/04/25, variabel	9 028 231	0,36	3 750 000	USD	MetroCat Re 08/05/26, variabel	3 727 594	0,15
1 866 569	USD	Herbie Re 08/01/26, variabel	1 119 941	0,05	23 750 000	USD	Mona Lisa Re 08/07/25, variabel	23 286 874	0,94
6 000 000	USD	Herbie Re 08/01/27, variabel	6 424 950	0,26	8 250 000	USD	Mona Lisa Re Series A 08/01/26, variabel	8 847 713	0,36
6 758 000	USD	Hypatia 08/04/26, variabel	7 050 452	0,28	6 671 000	USD	Mona Lisa Re Series B 08/01/26, variabel	7 154 147	0,29
6 750 000	USD	Integrity Re 06/06/25, variabel	6 216 919	0,25	8 462 000	USD	Montoya Re 07/04/26, variabel	9 124 152	0,37
8 691 000	USD	Integrity Re Series A 06/06/25, variabel	9 118 380	0,37	10 500 000	USD	Mountain Re 05/06/26, variabel	10 668 263	0,43
3 000 000	USD	Kendall Re 02/05/24, variabel	2 980 275	0,12	13 250 000	USD	Mystic Re IV Series A 08/01/25, variabel	12 845 213	0,52
7 857 000	USD	Kilimanjaro III Re 21/04/25, variabel	7 538 399	0,30	500 000	USD	Mystic Re IV Series B 08/01/25, variabel	491 250	0,02
23 344 000	USD	Kilimanjaro III Re 25/06/25, variabel	23 347 501	0,94	14 250 000	USD	Mystic Re IV 08/01/26, variabel	14 598 413	0,59
10 464 000	USD	Kilimanjaro III Re 20/04/26, variabel	9 832 236	0,40	6 602 000	USD	Nakama Re Series 1 09/05/28, variabel	6 584 175	0,27
9 906 000	USD	Locke Tavern Re 09/04/26, variabel	10 091 490	0,41	8 111 000	USD	Nakama Re Series 2 09/05/28, variabel	8 198 599	0,33
5 000 000	USD	Lower Ferry Re Series A 08/07/26, variabel	5 047 250	0,20	9 418 000	USD	Northshore Re II 08/07/25, variabel	9 482 042	0,38
9 750 000	USD	Lower Ferry Re Series B 08/07/26, variabel	9 900 150	0,40					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.



# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	
8 491 000	USD	Phoenician Re 14/12/23, variabel	8 479 537	0,34	19 250 000	USD	Torrey Pines Re Series B 07/06/24, variabel	18 887 138	0,76	
16 000 000	USD	Phoenician Re Series A 14/12/23, variabel	15 964 400	0,64	9 500 000	USD	Torrey Pines Re Series A 06/06/25, variabel	9 508 788	0,38	
13 000 000	USD	Phoenician Re 14/12/24, variabel	12 822 875	0,52	5 000 000	USD	Torrey Pines Re Series B 06/06/25, variabel	4 909 125	0,20	
5 000 000	USD	Power Protective Re 15/12/23, variabel	4 947 250	0,20	8 333 000	USD	Torrey Pines Re Series A 05/06/26, variabel	8 450 079	0,34	
2 250 000	USD	Power Protective Re 09/10/24, variabel	2 212 875	0,09	2 625 000	USD	Torrey Pines Re Series B 05/06/26, variabel	2 610 300	0,11	
3 286 000	USD	Purple Re 24/04/26, variabel	3 325 761	0,13	21 366 000	USD	Ursa Re II 06/12/24, variabel	20 630 474	0,83	
5 653 000	USD	Purple Re 05/06/26, variabel	5 699 779	0,23	41 725 000	USD	Ursa Re II Series AA 07/12/23, variabel	41 672 843	1,69	
10 000 000	EUR	Randolph Re 15/06/24, ZCP	10 006 871	0,40	16 700 000	USD	Ursa Re II Series D 07/12/23, variabel	16 655 328	0,67	
23 000 000	USD	Riverfront Re Series A 07/01/25, variabel	22 104 149	0,89	10 500 000	USD	Ursa Re II Series A 16/06/25, variabel	10 478 213	0,42	
5 750 000	USD	Riverfront Re Series B 07/01/25, variabel	5 281 950	0,21	5 250 000	USD	Ursa Re II Series E 16/06/25, variabel	5 149 200	0,21	
19 872 000	USD	Sakura Re Series A 07/04/25, variabel	19 778 104	0,80	17 500 000	USD	Ursa Re II Series AA 06/12/25, variabel	18 250 313	0,74	
18 792 000	USD	Sakura Re Series B 07/04/25, variabel	18 372 938	0,74	11 250 000	USD	Ursa Re II Series C 06/12/25, variabel	11 785 500	0,48	
11 500 000	USD	Sakura Re 05/01/26, variabel	12 235 713	0,49	8 173 000	USD	Ursa Re Series AA 06/12/25, variabel	8 260 655	0,33	
2 651 542	USD	Sanders Re II 07/04/26, variabel	20 085	-	2 419 000	USD	Ursa Re Series C 06/12/25, variabel	2 436 659	0,10	
12 050 000	USD	Sanders Re III 07/04/26, variabel	11 435 149	0,46	6 000 000	USD	Veraison Re 09/03/26, variabel	6 340 650	0,26	
11 750 000	USD	Sanders Re III 05/06/26, variabel	12 211 481	0,49	6 875 000	USD	Wrigley Re Series A 07/08/26, variabel	6 913 672	0,28	
5 156 000	USD	Sanders Re III 07/04/27, variabel	5 121 584	0,21	8 565 000	USD	Wrigley Re Series B 07/08/26, variabel	8 661 785	0,35	
10 000 000	USD	Sanders Re III Series A 07/04/27, variabel	10 089 500	0,41	<b>Kaimaninseln</b>				<b>164 200 833</b>	<b>6,62</b>
14 500 000	USD	Sierra Series A 31/01/24, variabel	14 453 600	0,58	1 092 500	USD	Caelus Re V Series B 05/06/24, variabel	942 281	0,04	
3 500 000	USD	Sierra Series B 31/01/24, variabel	3 477 863	0,14	3 747 995	USD	Caelus Re V Series C 05/06/24, variabel	552 829	0,02	
4 079 000	USD	Solomon Re 08/06/26, variabel	4 155 379	0,17	11 550 000	USD	Caelus Re VI 07/06/24, variabel	11 283 484	0,46	
3 375 000	USD	Stabilitas Re 05/06/26, variabel	3 460 978	0,14	4 500 000	USD	Long Point Re IV 01/06/26, variabel	4 486 500	0,18	
15 000 000	USD	Sutter Re Series B 19/06/26, variabel	15 171 000	0,61	7 062 000	USD	Residential Reinsurance 2019 06/12/23, variabel	6 953 422	0,28	
11 781 000	USD	Sutter Re Series E 19/06/26, variabel	11 850 213	0,48	2 000 000	USD	Residential Reinsurance 2019 06/06/26, variabel	1 500 000	0,06	
2 708 000	USD	Titania Re 27/02/26, variabel	2 933 983	0,12	6 154 000	USD	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variabel	6 151 692	0,25	
3 750 000	USD	Topanga Re 08/01/26, variabel	3 364 125	0,14	5 484 000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variabel	5 456 854	0,22	
19 000 000	USD	Torrey Pines Re Series A 07/06/24, variabel	18 542 575	0,75	5 000 000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variabel	4 930 125	0,20	

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	
4 250 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 11 06/06/25, variabel	3 621 850	0,15	18 500 000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity 06/06/25, variabel	18 882 025	0,76	
5 535 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 12 06/06/25, variabel	4 515 730	0,18	19 500 000	EUR	Lion III Re DAC 16/07/25, variabel	20 114 366	0,81	
4 642 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 13 06/06/25, variabel	4 172 810	0,17	5 250 000	EUR	Orange Capital Re DAC 17/01/25, variabel	5 424 426	0,22	
6 500 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 14 06/06/25, variabel	6 191 250	0,25	7 269 000	EUR	Windmill II Re DAC 05/07/24, variabel	7 646 724	0,31	
14 416 667	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 2 06/12/25, variabel	13 876 763	0,56	<b>Singapur</b>				<b>82 995 048</b>	<b>3,35</b>
4 310 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 3 06/12/25, variabel	4 042 888	0,16	4 000 000	USD	Astro Re 08/07/25, variabel	3 400 000	0,14	
6 300 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 13 06/06/26, variabel	5 561 010	0,22	9 750 000	USD	Catahoula II Re Series A 16/06/25, variabel	9 584 006	0,39	
2 950 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 14 06/06/26, variabel	2 796 526	0,11	5 250 000	USD	Catahoula II Re Series B 16/06/25, variabel	5 287 931	0,21	
3 750 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 3 06/12/26, variabel	3 919 031	0,16	11 466 000	USD	First Coast Re III 07/04/25, variabel	11 205 435	0,45	
8 500 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 5 06/12/26, variabel	8 538 250	0,34	7 973 000	USD	First Coast Re IV 07/04/26, variabel	8 009 277	0,32	
10 117 000	USD	Vitality Re XI Series A 09/01/24, variabel	10 104 607	0,41	8 957 000	EUR	Hexagon III Re 15/01/26, variabel	8 759 554	0,35	
5 000 000	USD	Vitality Re XI Series B 09/01/24, variabel	4 969 375	0,20	5 000 000	EUR	Hexagon III Re Series CAT 15/01/26, variabel	5 048 369	0,20	
12 044 000	USD	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variabel	11 973 844	0,48	17 714 000	USD	Nakama Re Series 2 13/10/26, variabel	17 388 948	0,71	
6 000 000	USD	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variabel	5 894 250	0,24	3 000 000	USD	Phoenix 2 Re 04/01/28, ZCP	3 328 140	0,13	
8 148 000	USD	Vitality Re XIII Series A 06/01/26, variabel	8 004 392	0,32	625 000	USD	Phoenix 2 Re Series 22-1 04/01/28, ZCP	887 938	0,04	
4 000 000	USD	Vitality Re XIII Series B 06/01/26, variabel	3 867 500	0,16	5 000 000	USD	Umigame Re Series A1 07/04/25, variabel	4 901 250	0,20	
14 000 000	USD	Vitality Re XIV Series A 05/01/27, variabel	14 337 049	0,58	2 750 000	USD	Umigame Re Series A2 07/04/25, variabel	2 713 700	0,11	
5 550 000	USD	Vitality Re XIV Series B 05/01/27, variabel	5 556 521	0,22	2 500 000	USD	Umigame Re Series B1 07/04/25, variabel	2 480 500	0,10	
<b>China</b>			<b>3 266 250</b>	<b>0,13</b>	<b>Vereinigtes Königreich</b>				<b>28 748 913</b>	<b>1,16</b>
3 250 000	USD	Great Wall Re 05/01/26, variabel	3 266 250	0,13	29 750 000	USD	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variabel	28 748 913	1,16	
<b>Hongkong</b>			<b>11 460 046</b>	<b>0,46</b>	<b>USA</b>				<b>96 010 529</b>	<b>3,87</b>
11 558 000	USD	Black Kite Re 09/06/25, variabel	11 460 046	0,46	6 315 000	USD	Cosaint Re 03/04/24, variabel	5 492 156	0,22	
<b>Irland</b>			<b>70 828 797</b>	<b>2,86</b>	5 500 000	USD	Gateway Re 12/05/25, variabel	5 405 263	0,22	
18 425 000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variabel	18 761 256	0,76	20 666 000	USD	Gateway Re Series A 24/02/26, variabel	21 790 229	0,87	
					4 500 000	USD	Gateway Re Series B 24/02/26, variabel	4 634 100	0,19	
					507 548	USD	JGWPT XXV 15/02/67, 7,14%	491 653	0,02	
					8 000 000	USD	Lightning Re 31/03/26, variabel	8 380 400	0,34	

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
5 250 000	USD	Logistics Re 20/12/24, variabel	5 156 156	0,21
8 500 000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 13 06/06/27, variabel	8 324 475	0,34
17 300 000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 14 06/06/27, variabel	17 200 957	0,68
1 375 446	USD	Security First Managers 25/02/25, variabel	1 375 446	0,06
13 903 000	USD	Vista Re 21/05/24, variabel	13 877 975	0,56
3 750 000	USD	Vista Re 21/05/25, variabel	3 881 719	0,16
<b>Summe Anleihen</b>			<b>1 672 913 630</b>	<b>67,47</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b>			<b>1 672 913 630</b>	<b>67,47</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Marktwert USD	% des Nettovermögens
<b>Anleihen</b>				
<b>Bermuda</b>			<b>88 231</b>	<b>-</b>
891 964	USD	Pelican IV Re Series A 07/05/24, variabel	4 750	-
4 750 000	USD	Pelican IV Re Series B 07/05/24, variabel	83 481	-
<b>USA</b>			<b>13 972 595</b>	<b>0,56</b>
13 099 432	USD	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5.96%	12 522 009	0,50
2 400	USD	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP	-	-
1 836 184	USD	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP	1 450 586	0,06
<b>Summe Anleihen</b>			<b>14 060 826</b>	<b>0,56</b>
<b>Summe sonstige Wertpapiere</b>			<b>14 060 826</b>	<b>0,56</b>
<b>Summe Kapitalanlagen</b>			<b>2 384 854 464</b>	<b>96,17</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>			<b>95 003 822</b>	<b>3,83</b>
<b>Nettoinventarwert</b>			<b>2 479 858 286</b>	<b>100,00</b>

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Contour Tech Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
<b>Aktien</b>				
<b>USA</b>				
56 964	USD	Activision Blizzard	5 333 539	3,46
7 485	USD	Adobe	3 816 602	2,48
30 386	USD	AppLovin	1 214 225	0,79
46 682	USD	Block	2 066 145	1,34
6 465	USD	Broadcom	5 369 700	3,49
97 581	USD	CCC Intelligent Solutions Holdings	1 302 706	0,85
229 786	USD	Endeavor Group Holdings	4 572 741	2,97
85 757	USD	Marvell Technology	4 642 026	3,02
124 542	USD	Match Group	4 878 933	3,17
25 100	USD	Meta Platforms	7 535 271	4,90
29 990	USD	Microsoft	9 469 343	6,15
11 235	USD	MongoDB	3 885 737	2,52
23 900	USD	Netflix	9 024 640	5,86
83 735	USD	New Relic	7 169 391	4,66
120 475	USD	News	2 416 729	1,57
800	USD	NVIDIA	347 992	0,23
101 355	USD	Oracle	10 735 521	6,98
170 963	USD	Pinterest	4 621 130	3,00
94 554	USD	Semtech	2 434 766	1,58
57 654	USD	Spotify Technology	8 915 615	5,79
199 049	USD	Trimble	10 720 778	6,96
57 300	USD	Twilio	3 353 769	2,18
150 764	USD	Unity Software	4 732 482	3,07
255 217	USD	Western Union	3 363 760	2,19
228 010	USD	Zillow Group	10 524 942	6,84
<b>Summe Aktien</b>			<b>132 448 483</b>	<b>86,05</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind</b>			<b>132 448 483</b>	<b>86,05</b>
<b>Summe Kapitalanlagen</b>			<b>132 448 483</b>	<b>86,05</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>			<b>21 478 210</b>	<b>13,95</b>
<b>Nettoinventarwert</b>			<b>153 926 693</b>	<b>100,00</b>

## Schroder GAIA Egerton Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% Netto- vermö- gen
<b>Aktien</b>				
<b>Bermuda</b>				
47 772	USD	RenaissanceRe Holdings	8 943 045	2,18
<b>Kanada</b>				
161 491	CAD	Canadian National Railway	16 541 468	4,03
525 185	CAD	Canadian Pacific Kansas City	36 923 617	8,99
743 665	CAD	Cenovus Energy	14 645 336	3,57
<b>Dänemark</b>				
116 090	DKK	Novo Nordisk	10 022 415	2,44
<b>Frankreich</b>				
56 326	EUR	Safran	8 372 297	2,04
<b>Deutschland</b>				
66 398	EUR	Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft in München	24 507 502	5,97
<b>Indien</b>				
96 383	USD	HDFC Bank	5 379 580	1,31
285 633	USD	ICICI Bank	6 246 238	1,52
<b>Niederlande</b>				
33 117	USD	Shell	2 016 621	0,49
<b>Vereinigtes Königreich</b>				
1 068 600	HKD	HSBC Holdings	7 963 577	1,94
<b>USA</b>				
155 064	USD	Alphabet	19 338 083	4,71
17 065	USD	Amazon.com	2 051 835	0,50
50 970	USD	Arch Capital Group	3 842 817	0,94
4 108	USD	Booking Holdings	11 982 849	2,92
7 605	USD	Everest Re Group	2 673 493	0,65
10 970	USD	First Citizens BancShares	14 319 884	3,49
125 785	USD	Fiserv	13 439 275	3,27
142 232	USD	General Electric	14 872 308	3,62
21 939	USD	Hilton Worldwide Holdings	3 116 386	0,76
44 557	USD	KKR	2 596 085	0,63
43 358	USD	Mastercard	16 236 336	3,95
80 243	USD	Meta Platforms	22 785 292	5,55
44 203	USD	Microsoft	13 201 322	3,22
342 430	USD	Schlumberger	18 882 638	4,60
112 927	USD	Visa	24 567 830	5,98
<b>Summe Aktien</b>			<b>325 468 129</b>	<b>79,27</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind</b>			<b>325 468 129</b>	<b>79,27</b>
<b>Summe Kapitalanlagen</b>			<b>325 468 129</b>	<b>79,27</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>			<b>85 101 466</b>	<b>20,73</b>
<b>Nettoinventarwert</b>			<b>410 569 595</b>	<b>100,00</b>

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Helix

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Aktien</b>				
<b>Bahrain</b>			<b>988 497</b>	<b>0,33</b>
340 332	BHD	Aluminium Bahrain BSC	988 497	0,33
<b>Brasilien</b>			<b>16 691 778</b>	<b>5,63</b>
48 000	BRL	Arezzo Industria e Comercio	622 968	0,21
457 300	BRL	B3 – Brasil Bolsa Balcao	1 122 876	0,38
469 762	BRL	Banco Bradesco	1 342 124	0,45
829 000	BRL	Cia Paranaense de Energia	1 392 929	0,47
365 400	BRL	Embraer	1 257 130	0,42
734 451	BRL	Gerdau	3 540 777	1,20
626 073	BRL	Itausa	1 132 015	0,38
44 400	BRL	Klabin	211 213	0,07
151 600	BRL	PRIO	1 424 771	0,48
328 768	BRL	Raia Drogasil	1 814 228	0,62
23 800	BRL	Rede D'Or Sao Luiz	120 826	0,04
121 900	BRL	Suzano	1 321 972	0,45
234 600	BRL	Vivara Participacoes	1 258 962	0,42
17 800	BRL	WEG	128 987	0,04
<b>China</b>			<b>20 252 630</b>	<b>6,83</b>
4 662	USD	Alibaba Group Holding	404 382	0,14
16 100	CNH	Bafang Electric Suzhou	126 643	0,04
114 000	HKD	China Mengniu Dairy	382 094	0,13
45 600	HKD	China Pacific Insurance Group	114 119	0,04
125 596	CNH	Contemporary Amperex Technology	3 499 950	1,18
206 660	CNH	East Money Information	431 147	0,15
40 800	CNH	Estun Automation	123 535	0,04
26 944	CNH	Foshan Haitian Flavouring & Food	140 494	0,05
167 900	CNH	Foxconn Industrial Internet	453 986	0,15
33 920	CNH	Gongniu Group	482 885	0,16
6 552	USD	H World Group	258 345	0,09
12 300	CNH	Hithink RoyalFlush Information Network	252 322	0,09
65 416	CNH	Hongfa Technology	301 233	0,10
122 000	CNH	Hualan Biological Engineering	371 739	0,13
12 100	HKD	JD.com	177 826	0,06
2 700	CNH	Kweichow Moutai	666 518	0,22
9 512	CNH	Leader Harmonious Drive Systems	154 161	0,05
16 300	CNH	LONGi Green Energy Technology	61 032	0,02

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
286 474	CNH	Midea Group	2 181 462	0,74
135 452	CNH	NARI Technology	412 542	0,14
26 800	CNH	Ping An Insurance Group of China	177 667	0,06
545 000	CNH	Sany Heavy Industry	1 188 629	0,40
72 200	CNH	Shandong Sinocera Functional Material	270 834	0,09
125 708	CNH	Shenzhen Inovance Technology	1 147 216	0,39
121 100	HKD	Shenzhou International Group Holdings	1 159 689	0,39
82 700	CNH	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing	196 825	0,07
24 211	CNY	Suzhou Everbright Photonics	216 485	0,07
34 056	CNH	Thunder Software Technology	357 913	0,12
105 800	CNH	Venustech Group	410 087	0,14
66 900	CNH	Wanhua Chemical Group	810 981	0,27
29 800	CNH	Wuliangye Yibin	638 476	0,22
54 900	CNH	WuXi AppTec	649 388	0,22
27 000	HKD	Wuxi Biologics Cayman	157 377	0,05
17 900	CNH	Wuxi Lead Intelligent Equipment	66 875	0,02
27 866	CNH	Xiamen Faratronic	370 731	0,12
95 000	CNH	Xuji Electric	252 829	0,09
276 384	CNH	Yizumi Holdings	711 279	0,24
90 600	CNH	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	369 326	0,12
103 500	HKD	Zylox-Tonbridge Medical Technology	103 608	0,03
<b>Kolumbien</b>			<b>167 337</b>	<b>0,06</b>
38 688	COP	Banco Davivienda	167 337	0,06
<b>Georgien</b>			<b>1 600 811</b>	<b>0,54</b>
43 938	GBP	TBC Bank Group	1 600 811	0,54
<b>Deutschland</b>			<b>459 707</b>	<b>0,15</b>
4 735	EUR	Dr Ing hc F Porsche	446 173	0,15
404	EUR	Schott Pharma	13 534	-
<b>Griechenland</b>			<b>3 635 838</b>	<b>1,23</b>
406 140	EUR	National Bank of Greece	2 296 204	0,78
406 068	EUR	Piraeus Financial Holdings	1 208 088	0,41
8 481	EUR	Terna Energy	131 546	0,04
<b>Hongkong</b>			<b>177 727</b>	<b>0,06</b>
21 800	HKD	AIA Group	177 727	0,06
<b>Ungarn</b>			<b>3 111 181</b>	<b>1,05</b>
28 001	HUF	OTP Bank	1 015 367	0,34

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
86 225	HUF	Richter Gedeon	2 095 814	0,71
<b>Indonesien</b>			<b>2 528 914</b>	<b>0,85</b>
821 600	IDR	Bank BTPN Syariah	101 271	0,03
34 500	IDR	Bank Central Asia	19 700	0,01
5 067 300	IDR	Bank Mandiri Persero	1 975 445	0,66
238 600	IDR	Bank Rakyat Indonesia Persero	80 665	0,03
1 825 900	IDR	Industri Jamu Dan Farmasi Sido Muncul	69 704	0,02
608 400	IDR	Mitra Keluarga Karyasehat	106 288	0,04
724 700	IDR	Telkom Indonesia Persero	175 841	0,06
<b>Italien</b>			<b>5 256 561</b>	<b>1,77</b>
4 124	EUR	Ariston Holding	26 918	0,01
97 804	EUR	Eni	1 579 758	0,53
59	EUR	Ferrari	17 472	0,01
70 470	EUR	FinecoBank Banca Fineco	859 135	0,29
2 681	EUR	Industrie De Nora	46 211	0,02
248 850	EUR	Intesa Sanpaolo	642 867	0,22
55 068	EUR	Iveco Group	516 683	0,17
1 631	EUR	Moncler	95 113	0,03
474	EUR	Philogen	8 306	-
998	EUR	Prysmian	40 311	0,01
13 563	EUR	Terna-Rete Elettrica Nazionale	102 357	0,03
54 910	EUR	UniCredit	1 321 430	0,45
<b>Japan</b>			<b>66 615</b>	<b>0,02</b>
4 600	JPY	Integral	66 615	0,02
<b>Kasachstan</b>			<b>1 891 943</b>	<b>0,64</b>
128 074	USD	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	1 708 507	0,58
1 895	USD	Kaspi.KZ	183 436	0,06
<b>Kenia</b>			<b>114 892</b>	<b>0,04</b>
1 158 300	KES	Safaricom	114 892	0,04
<b>Mexiko</b>			<b>3 753 524</b>	<b>1,27</b>
2 073 358	MXN	Gentera	2 439 807	0,83
115 200	MXN	Grupo Aeroportuario del Centro Norte	1 255 841	0,42
27 800	MXN	Orbia Advance	57 876	0,02
<b>Peru</b>			<b>102 556</b>	<b>0,03</b>
4 554	USD	Intercorp Financial Services	102 556	0,03
<b>Philippinen</b>			<b>6 472 642</b>	<b>2,18</b>
5 464 300	PHP	Ayala Land	2 844 380	0,95

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
268 430	PHP	BDO Unibank	673 258	0,23
330 920	PHP	International Container Terminal Services	1 211 938	0,41
1 986 800	PHP	Puregold Price Club	1 014 892	0,34
1 872 600	PHP	Wilcon Depot	728 174	0,25
<b>Polen</b>			<b>3 659 438</b>	<b>1,23</b>
88 734	PLN	Grupa Pracuj	1 158 713	0,39
10 577	PLN	KRUK	1 003 168	0,34
244	PLN	LPP	726 681	0,24
81 337	PLN	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	770 876	0,26
<b>Rumänien</b>			<b>1 363 321</b>	<b>0,46</b>
140 058	RON	Banca Transilvania	658 851	0,22
27 580	RON	Societatea De Producere A Energiei Electrice in Hidrocentrale Hidroelectrica	704 470	0,24
<b>Slowenien</b>			<b>3 522 817</b>	<b>1,19</b>
231 065	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	3 522 817	1,19
<b>Südafrika</b>			<b>5 137 330</b>	<b>1,73</b>
19 566	ZAR	Capitec Bank Holdings	1 782 526	0,59
10 456	ZAR	Clicks Group	143 553	0,05
1 615 165	ZAR	Netcare	1 157 400	0,39
127 172	ZAR	Shoprite Holdings	1 618 997	0,55
53 388	ZAR	Tiger Brands	434 854	0,15
<b>Südkorea</b>			<b>24 776 790</b>	<b>8,35</b>
27 605	KRW	Hankook Tire & Technology	810 107	0,27
179	KRW	Hyundai Motor	25 350	0,01
3 147	KRW	KB Financial Group	128 968	0,04
9 235	KRW	Koh Young Technology	84 726	0,03
779	KRW	Korea Zinc	292 111	0,10
1 961	KRW	L&F	251 992	0,08
1 273	KRW	LG Chem	468 389	0,16
364	KRW	LG Chem – Preference	84 162	0,03
5 679	KRW	NAVER	848 020	0,29
9 664	KRW	Samsung Electro- Mechanics	984 018	0,33
274 038	KRW	Samsung Electronics	13 890 765	4,69
55 040	KRW	Samsung Electronics – Preference	2 222 973	0,75
10 332	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	1 994 580	0,67
6 514	KRW	Samsung SDI	2 471 592	0,83
5 684	KRW	SK Telecom	219 037	0,07

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.



# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Schweiz</b>			<b>175 056</b>	<b>0,06</b>
7 470	GBP	Wizz Air Holdings	175 056	0,06
<b>Taiwan</b>			<b>41 829 620</b>	<b>14,09</b>
92 059	TWD	Advantech	983 887	0,33
498 000	TWD	ASE Technology Holding	1 689 286	0,57
108 000	TWD	Chroma ATE	923 406	0,31
166 000	TWD	Chunghwa Telecom	596 521	0,20
146 000	TWD	CTBC Financial Holding	110 810	0,04
14 250	TWD	Dadi Early-Childhood Education Group	33 991	0,01
51 000	TWD	Delta Electronics	512 678	0,17
59 000	TWD	Eclat Textile	890 104	0,30
38 000	TWD	Giant Manufacturing	210 127	0,07
539 000	TWD	Hon Hai Precision Industry	1 736 528	0,59
214 000	TWD	MediaTek	4 872 601	1,64
256 000	TWD	Merida Industry	1 387 835	0,47
150 000	TWD	Nien Made Enterprise	1 440 498	0,49
5 000	TWD	Novatek Microelectronics	65 519	0,02
211 000	TWD	Sinbon Electronics	2 114 543	0,71
92 187	TWD	Sporton International	721 092	0,24
1 355 000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	21 953 346	7,40
66 000	TWD	Uni-President Enterprises	143 325	0,05
412 000	TWD	United Microelectronics	576 893	0,19
17 650	TWD	Voltronic Power Technology	866 630	0,29
<b>Thailand</b>			<b>525 453</b>	<b>0,18</b>
69 900	THB	Kasikornbank	241 879	0,08
50 700	THB	Kasikornbank-XDR	175 440	0,06
504 800	THB	Land & Houses	108 134	0,04
<b>Vereinigte Arabische Emirate</b>			<b>1 068 294</b>	<b>0,36</b>
560 557	AED	Emaar Development	1 068 294	0,36
<b>Vereinigtes Königreich</b>			<b>1 137 580</b>	<b>0,38</b>
14 721	EUR	CNH Industrial	179 861	0,06
206 546	PLN	Pepco Group	957 719	0,32
<b>USA</b>			<b>3 963 787</b>	<b>1,34</b>
22 783	USD	ARM Holdings	1 219 346	0,41
149 100	MXN	GCC	1 407 650	0,47
1 762	USD	Mastercard	697 593	0,24
2 779	USD	Visa	639 198	0,22

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Vietnam</b>			<b>173 708</b>	<b>0,06</b>
56 900	VND	Vietnam Dairy Products	173 708	0,06
<b>Summe Aktien</b>			<b>154 606 347</b>	<b>52,11</b>
<b>Anleihen</b>				
<b>Brasilien</b>			<b>1 130 346</b>	<b>0,38</b>
2 096 000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10.00%	408 454	0,14
1 610 000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/31, 10.00%	307 560	0,10
2 210 000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/33, 10.00%	414 332	0,14
<b>Kolumbien</b>			<b>592 052</b>	<b>0,20</b>
1 580 000 000	COP	Colombian TES 26/03/31, 7.00%	306 317	0,10
642 800 000	COP	Colombian TES 09/02/33, 13.25%	171 736	0,06
734 700 000	COP	Colombian TES 26/10/50, 7.25%	113 999	0,04
<b>Tschechische Republik</b>			<b>339 631</b>	<b>0,11</b>
570 000	EUR	CPI Property Group 27/01/31, 1.50%	339 631	0,11
<b>El Salvador</b>			<b>153 104</b>	<b>0,05</b>
200 000	USD	El Salvador Government International Bond 15/07/52, 9.50%	153 104	0,05
<b>Ungarn</b>			<b>321 805</b>	<b>0,11</b>
140 000 000	HUF	Hungary Government Bond 27/10/27, 3.00%	321 805	0,11
<b>Elfenbeinküste</b>			<b>525 305</b>	<b>0,18</b>
470 000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5.88%	412 098	0,14
140 000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 30/01/32, 4.88%	113 207	0,04
<b>Mexiko</b>			<b>698 592</b>	<b>0,24</b>
2 700 000	MXN	Mexican Bonos 18/11/38, 8.50%	137 042	0,05
6 410 000	MXN	Mexican Bonos 13/11/42, 7.75%	297 290	0,10
2 570 000	MXN	Mexican Bonos 07/11/47, 8.00%	121 760	0,04
2 900 000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/11/26, 7.47%	142 500	0,05
<b>Nigeria</b>			<b>472 324</b>	<b>0,16</b>
550 000	USD	Nigeria Government International Bond 24/03/29, 8.38%	472 324	0,16

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Russland</b>				
38 000 000	RUB	Russian Federal Bond – OFZ 23/03/33, 7.70%	116 803	0,04
<b>Südafrika</b>				
6 500 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	281 676	0,10
2 890 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	121 141	0,04
1 730 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8.50%	67 265	0,02
<b>Supranational</b>				
20 000 000	ARS	European Bank for Reconstruction & Development 28/05/24, 175.00%	49 756	0,02
<b>Türkei</b>				
200 000	USD	Pegasus Hava Tasimaciligi 30/04/26, 9.25%	202 538	0,07
250 000	USD	Turkey Government International Bond 16/04/43, 4.88%	159 093	0,05
<b>Ukraine</b>				
330 000	USD	VF Ukraine PAT via VFU Funding 11/02/25, 6.20%	249 150	0,08
<b>Summe Anleihen</b>			<b>5 480 581</b>	<b>1,85</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind</b>			<b>160 086 928</b>	<b>53,96</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Anleihen</b>				
<b>Brasilien</b>				
241 563	USD	MC Brazil Downstream Trading 30/06/31, 7.25%	185 567	0,06
<b>Burkina Faso</b>				
380 000	USD	Endeavour Mining 14/10/26, 5.00%	340 101	0,12
<b>USA</b>				
1 000 000	USD	United States Treasury Bill 05/10/23, ZCP	999 272	0,34
10 000 000	USD	United States Treasury Bill 12/10/23, ZCP	9 982 487	3,36
10 000 000	USD	United States Treasury Bill 19/10/23, ZCP	9 972 265	3,36

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
10 000 000	USD	United States Treasury Bill 26/10/23, ZCP	9 962 130	3,36
10 000 000	USD	United States Treasury Bill 09/11/23, ZCP	9 941 483	3,35
10 000 000	USD	United States Treasury Bill 16/11/23, ZCP	9 931 139	3,35
10 000 000	USD	United States Treasury Bill 30/11/23, ZCP	9 911 270	3,34
10 000 000	USD	United States Treasury Bill 07/12/23, ZCP	9 899 785	3,34
1 000 000	USD	United States Treasury Bill 18/01/24, ZCP	983 803	0,33
<b>Summe Anleihen</b>			<b>72 109 302</b>	<b>24,31</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden</b>			<b>72 109 302</b>	<b>24,31</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Luxemburg</b>				
100 000	USD	Schroder GAIA Asian Equity Long Short	10 616 000	3,58
6 139	USD	Schroder ISF – China A	798 693	0,27
2 884	USD	Schroder ISF Emerging Markets Value	442 865	0,15
17 893	USD	Schroder ISF Indian Equity	6 616 386	2,23
<b>Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			<b>18 473 944</b>	<b>6,23</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
<b>Anleihen</b>				
<b>Britische Jungferninseln</b>				
100 339	USD	Noventiq Holdings	-	-
<b>Summe Anleihen</b>			-	-
<b>Summe sonstige Wertpapiere</b>			-	-
<b>Summe Kapitalanlagen</b>			<b>250 670 174</b>	<b>84,50</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>			<b>45 993 106</b>	<b>15,50</b>
<b>Nettoinventarwert</b>			<b>296 663 280</b>	<b>100,00</b>

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.



# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Anleihen</b>				
<b>Argentinien</b>				
775 000	USD	YPF 27/06/29, 8.50%	626 023	0,90
250 000	USD	YPF Energia Electrica 25/07/26, 10.00%	233 770	0,34
<b>Belgien</b>				
100 000	EUR	Telenet Finance Luxembourg Notes 01/03/28, 3.50%	98 478	0,14
<b>Kanada</b>				
200 000	EUR	Primo Water Holdings 31/10/28, 3.88%	190 710	0,27
<b>Frankreich</b>				
22 905	EUR	Accor 07/12/27, 0.70%	23 075	0,03
200 000	EUR	Afflelou 19/05/26, 4.25%	200 754	0,29
100 000	EUR	Altice France 15/07/29, 4.00%	76 518	0,11
220 000	EUR	Banijay Entertainment 01/05/29, 7.00%	231 134	0,33
210 000	EUR	CAB Selas 01/02/28, 3.38%	186 095	0,27
23 454	EUR	Edenred 14/06/28, ZCP	25 469	0,04
200 000	EUR	Electricite de France perpetual, variabel	215 710	0,31
200 000	EUR	Iliad Holding 15/10/28, 5.63%	197 311	0,28
100 000	EUR	Loxam 15/07/26, 3.75%	99 254	0,14
100 000	EUR	Loxam 15/04/27, 4.50%	94 630	0,14
110 000	EUR	Parts Europe 16/07/25, 6.50%	116 298	0,17
27 134	EUR	Safran 01/04/28, ZCP	29 114	0,04
22 655	EUR	Veolia Environnement 01/01/25, ZCP	24 279	0,03
<b>Deutschland</b>				
180 000	EUR	Cheplapharm Arzneimittel 15/01/28, 4.38%	174 045	0,25
100 000	EUR	Cheplapharm Arzneimittel 15/05/30, 7.50%	106 107	0,15
215 000	EUR	IHO Verwaltungs 15/05/28, 8.75%	235 015	0,34
200 000	EUR	Nidda Healthcare Holding 21/08/26, 7.50%	213 432	0,31
200 000	EUR	Renk 15/07/25, 5.75%	210 604	0,30
92 316	EUR	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 30/07/26, 6.00%	95 300	0,14
100 000	EUR	TUI Cruises 15/05/26, 6.50%	100 186	0,14
200 000	EUR	WEPA Hygieneprodukte 15/12/27, 2.88%	186 006	0,27

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Indien</b>				
200 000	USD	Vedanta Resources Finance II 21/01/24, 13.88%	179 205	0,26
200 000	USD	Vedanta Resources Finance II 11/03/25, 8.95%	147 341	0,21
<b>Italien</b>				
210 000	EUR	Castor 15/02/29, variabel	211 488	0,30
200 000	EUR	Engineering-Ingegneria Informatica 30/09/26, 5.88%	190 677	0,27
210 000	EUR	Lottomatica 01/06/28, 7.13%	227 296	0,33
200 000	EUR	Mooney Group 17/12/26, variabel	211 080	0,30
200 000	EUR	Telecom Italia 15/02/28, 6.88%	213 256	0,31
<b>Luxemburg</b>				
200 000	EUR	Altice Financing 15/01/28, 3.00%	178 945	0,26
205 000	EUR	INEOS Finance 15/05/28, 6.63%	213 097	0,31
100 000	EUR	Matterhorn Telecom 15/11/27, 4.00%	98 919	0,14
200 000	EUR	Summer BC Holdco B 31/10/26, 5.75%	194 534	0,28
<b>Niederlande</b>				
200 000	GBP	GTCR W-2 Merger Sub 15/01/31, 8.50%	249 830	0,35
110 000	EUR	Q-Park Holding I 01/03/26, variabel	115 567	0,17
210 000	EUR	TMNL Holding 15/01/29, 3.75%	191 510	0,28
100 000	EUR	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 3.75%	98 049	0,14
100 000	EUR	UPC Holding 15/06/29, 3.88%	87 911	0,13
120 000	EUR	VZ Vendor Financing II 15/01/29, 2.88%	98 244	0,14
100 000	EUR	Ziggo Bond 28/02/30, 3.38%	78 135	0,11
<b>Spanien</b>				
100 000	EUR	Cellnex Telecom 05/07/28, 0.50%	105 323	0,15
170 000	EUR	Cirsa Finance International 31/07/28, 7.88%	181 181	0,26
210 000	EUR	Lorca Telecom Bondco 18/09/27, 4.00%	206 817	0,30
100 000	EUR	Telefonica Europe 2 perpetual, variabel	92 377	0,13
100 000	EUR	Telefonica Europe 4 perpetual, variabel	103 722	0,15

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Schweden</b>				
100 000	EUR	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden perpetual, variabel	16 777	0,02
100 000	EUR	Verisure Holding 15/07/26, 3.88%	99 778	0,14
100 000	EUR	Verisure Holding 15/10/27, 9.25%	112 462	0,17
<b>Vereinigtes Königreich</b>			<b>963 599</b>	<b>1,38</b>
184 943	EUR	EG Global Finance 30/10/25, 6.25%	190 203	0,27
100 000	GBP	Hurricane Finance 15/10/25, 8.00%	119 606	0,17
205 000	GBP	Pinewood Finance 30/09/25, 3.25%	235 287	0,34
100 000	GBP	Premier Foods Finance 15/10/26, 3.50%	111 512	0,16
100 000	GBP	Virgin Media Secured Finance 15/05/29, 5.25%	105 539	0,15
110 000	EUR	Vodafone Group 27/08/80, variabel	94 560	0,14
100 000	EUR	Vodafone Group 30/08/84, variabel	106 892	0,15
<b>USA</b>			<b>2 313 438</b>	<b>3,33</b>
265 000	EUR	Allied Universal 01/06/28, 3.63%	231 839	0,33
200 000	EUR	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 2.13%	188 080	0,27
125 000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/27, 5.25%	104 485	0,15
100 000	EUR	Clarios Global 15/05/26, 4.38%	101 864	0,15
220 000	EUR	Coty 15/09/28, 5.75%	234 840	0,34
200 000	EUR	Dana Financing Luxembourg 15/07/29, 3.00%	165 424	0,24
90 000	USD	Ford Motor 12/02/32, 3.25%	69 445	0,10
100 000	USD	Ford Motor 19/08/32, 6.10%	94 306	0,14
65 000	USD	Ford Motor Credit 13/11/30, 4.00%	54 352	0,08
85 000	USD	MGIC Investment 15/08/28, 5.25%	79 243	0,11
190 000	USD	MPT Operating Partnership 15/10/27, 5.00%	147 512	0,21
190 000	USD	Oceaneering International 01/02/28, 6.00%	179 187	0,26
110 000	EUR	Silgan Holdings 01/06/28, 2.25%	99 117	0,14
180 000	USD	TransDigm 15/11/27, 5.50%	169 168	0,24

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
290 000	USD	Vital Energy 15/01/25, 9.50%	292 624	0,42
100 000	USD	Vital Energy 15/01/28, 10.13%	101 952	0,15
<b>Summe Anleihen</b>			<b>11 169 875</b>	<b>16,05</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind</b>			<b>11 169 875</b>	<b>16,05</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Anleihen</b>				
<b>Argentinien</b>			<b>138 451</b>	<b>0,20</b>
5 600	USD	Genneia 02/09/27, 8.75%	5 361	0,01
140 000	USD	Pampa Energia 15/04/29, 9.13%	133 090	0,19
<b>Australien</b>			<b>1 386 063</b>	<b>1,99</b>
295 000	USD	Mineral Resources 01/05/27, 8.13%	291 369	0,42
125 000	USD	Mineral Resources 01/05/30, 8.50%	122 780	0,18
254 440	AUD	Ruby Bond Trust 12/03/53, variabel	163 877	0,24
264 151	AUD	Ruby Bond Trust Series 2021-1 12/03/53, variabel	168 642	0,24
500 000	AUD	Ruby Bond Trust 14/01/54, variabel	319 748	0,45
500 000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2022-1 14/01/54, variabel	319 647	0,46
<b>Bermuda</b>			<b>402 999</b>	<b>0,58</b>
400 000	USD	Home Re 25/01/34, variabel	402 999	0,58
<b>Brasilien</b>			<b>163 313</b>	<b>0,23</b>
200 000	USD	Azul Secured Finance 28/05/30, 10.88%	163 313	0,23
<b>Kanada</b>			<b>1 285 052</b>	<b>1,85</b>
15 000	USD	Bombardier 15/03/25, 7.50%	14 955	0,02
255 000	USD	Bombardier 15/06/26, 7.13%	247 294	0,36
100 000	USD	Bombardier 15/02/28, 6.00%	90 821	0,13
405 000	USD	Cascades 15/01/28, 5.38%	374 593	0,53
9 000	USD	First Majestic Silver 15/01/27, 0.38%	6 778	0,01
300 000	USD	Intelligent Packaging 15/09/28, 6.00%	262 961	0,38
195 000	USD	Precision Drilling 15/01/26, 7.13%	193 292	0,28

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermög- en	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermög- en
100 000	USD	Strathcona Resources 01/08/26, 6.88%	94 358	0,14	103 254	EUR	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	93 037	0,13
<b>Kaimaninseln</b>			<b>4 991 516</b>	<b>7,17</b>	99 268	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	104 084	0,15
250 000	USD	ACAM 17/11/34, variabel	239 380	0,34	108 202	GBP	Frost CMBS DAC* 20/11/33, variabel	112 132	0,16
250 000	USD	ACAM Series 2019-FL1 17/11/34, variabel	244 129	0,35	375 000	EUR	Goldentree Loan Management CLO 4 DAC 20/07/34, variabel	366 876	0,53
1 093 923	USD	Falcon Aerospace 15/09/39, 6.66%	323 112	0,46	800 000	EUR	ICG Euro CLO 19/04/36, variabel	848 830	1,22
375 000	USD	ICG US CLO 16/01/33, variabel	290 902	0,42	100 000	GBP	Last Mile Logistics CMBS UK DAC 17/08/33, variabel	122 071	0,18
375 000	USD	Marble Point CLO XV 23/07/32, variabel	335 432	0,48	174 770	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 17/08/33, variabel	166 807	0,24
250 000	USD	MP CLO VIII 28/04/34, variabel	235 281	0,34	550 821	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance Series 1A 17/08/33, variabel	535 272	0,77
250 000	USD	Ocean Trails CLO XI 20/07/34, variabel	235 617	0,34	375 000	EUR	Palmer Square European CLO DAC 15/04/35, variabel	356 322	0,51
250 000	USD	Ocean Trails CLO XI Series 2021-11A 20/07/34, variabel	245 828	0,35	94 405	EUR	Pearl Finance DAC 17/11/32, variabel	96 975	0,14
470 264	USD	Pioneer Aircraft Finance 15/06/44, 3.97%	409 691	0,59	300 000	EUR	Penta CLO 10 DAC 20/11/34, variabel	293 069	0,42
1 116 071	USD	Thunderbolt II Aircraft Lease 15/09/38, variabel	703 593	1,01	375 000	EUR	Segovia European CLO 20/07/32, variabel	382 111	0,55
375 000	USD	Trinitas CLO XVI 20/07/34, variabel	365 233	0,52	250 000	EUR	St Paul's CLO VII DAC 18/07/34, variabel	252 322	0,36
1 000 000	USD	Trinitas CLO XVIII 20/01/35, variabel	986 914	1,43	398 915	GBP	Taurus UK DAC 17/11/29, variabel	459 976	0,66
400 000	USD	TRTX Issuer 15/03/38, variabel	376 404	0,54	310 000	GBP	Taurus UK DAC 17/05/31, variabel	331 423	0,48
<b>Hongkong</b>			<b>192 902</b>	<b>0,28</b>	279 128	GBP	Taurus UK DAC 17/08/31, variabel	306 830	0,44
240 000	USD	Seaspan 01/08/29, 5.50%	192 902	0,28	500 000	EUR	Tikehau CLO VIII DAC 25/10/34, variabel	536 300	0,77
<b>Irland</b>			<b>10 686 036</b>	<b>15,36</b>	375 000	EUR	Vendome Funding CLO DAC 20/07/34, variabel	330 896	0,48
375 000	EUR	Ares European CLO XII DAC 20/04/32, variabel	375 008	0,54	<b>Jersey</b>			<b>502 280</b>	<b>0,72</b>
321 530	EUR	Arrow CMBS 2018 DAC 22/05/30, variabel	335 900	0,48	500 000	USD	ICG US CLO 18/07/36, variabel	502 280	0,72
750 000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 15/04/32, variabel	725 010	1,04	<b>Luxemburg</b>			<b>227 035</b>	<b>0,33</b>
750 000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 19/10/34, variabel	756 196	1,09	260 000	USD	ION Trading Technologies 15/05/28, 5.75%	227 035	0,33
800 000	EUR	Barings Euro CLO 2022-1 DAC 28/10/34, variabel	850 702	1,23	<b>Mexiko</b>			<b>120 446</b>	<b>0,17</b>
550 000	EUR	BBAM European CLO I DAC 22/07/34, variabel	524 600	0,75	200 000	USD	Braskem Idesa 20/02/32, 6.99%	120 446	0,17
250 000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund 15/01/37, variabel	249 326	0,36	<b>Singapur</b>			<b>44 098</b>	<b>0,06</b>
300 000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund 15/01/37, variabel	322 167	0,46	20 000	USD	Sea 01/12/25, 2.38%	19 220	0,03
458 683	EUR	European Loan Conduit No 36 DAC Series C 17/02/30, variabel	466 257	0,67	31 000	USD	Sea 15/09/26, 0.25%	24 878	0,03
382 236	EUR	European Loan Conduit No 36 DAC Series D 17/02/30, variabel	385 537	0,55					

\* Notleidendes Wertpapier.

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	
<b>Vereinigtes Königreich</b>						<b>106 158</b>	<b>0,15</b>					
8 000	USD		Farfetch 01/05/27, 3.75%	4 290	0,01	370 000	USD		Bloomin' Brands 15/04/29, 5.13%	325 092	0,47	
100 000	GBP		Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 15/07/28, 4.88%	101 868	0,14	320 000	USD		Brinker International 15/07/30, 8.25%	308 309	0,44	
<b>USA</b>						<b>28 008 019</b>	<b>40,24</b>					
195 000	USD		Academy 15/11/27, 6.00%	184 529	0,27	250 000	USD		BRSP 19/08/38, variabel	222 891	0,32	
170 000	USD		Ahead DB Holdings 01/05/28, 6.63%	143 969	0,21	58 000	USD		Cable One 15/03/26, ZCP	47 734	0,07	
61 000	USD		Alarm.com Holdings 15/01/26, ZCP	53 009	0,08	235 000	USD		Cablevision Lightpath 15/09/28, 5.63%	180 689	0,26	
310 000	USD		Albertsons 15/02/28, 5.88%	298 690	0,43	415 000	USD		Calpine 01/02/29, 4.63%	348 108	0,50	
60 000	USD		Albertsons 15/02/30, 4.88%	54 146	0,08	240 000	USD		Calpine 01/02/31, 5.00%	194 374	0,28	
135 000	USD		Allied Universal 01/06/28, 4.63%	112 699	0,16	165 000	USD		Carnival 01/03/27, 5.75%	149 476	0,21	
280 000	USD		Allied Universal Finance 15/07/26, 6.63%	265 706	0,38	20 000	USD		Carnival 01/06/30, 10.50%	20 615	0,03	
275 000	USD		AMC Networks 15/02/29, 4.25%	169 170	0,24	396 846	USD		Castlelake Aircraft Structured Trust 2017-1R 15/08/41, 2.74%	360 561	0,52	
245 000	USD		American Airlines 15/07/25, 11.75%	263 520	0,38	120 000	USD		CCO Holdings 01/02/28, 5.00%	109 108	0,16	
7 000	USD		American Water Capital 15/06/26, 3.63%	6 782	0,01	360 000	USD		CCO Holdings 01/03/31, 7.38%	347 999	0,50	
90 000	USD		APX Group 15/02/27, 6.75%	86 524	0,12	350 000	USD		Central Parent 15/06/29, 8.00%	349 445	0,50	
250 000	USD		Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 15/05/36, variabel	234 212	0,34	45 000	USD		Ceridian HCM Holding 15/03/26, 0.25%	39 798	0,06	
80 000	USD		Ardagh Holdings USA 15/08/26, 4.13%	73 230	0,11	700 000	USD		Churchill Downs 01/05/31, 6.75%	662 374	0,94	
100 000	USD		AREIT 17/07/28, variabel	99 661	0,14	330 000	USD		CITGO Petroleum 15/06/25, 7.00%	325 369	0,47	
103 000	USD		AREIT Trust 14/09/36, variabel	96 175	0,14	285 000	USD		Cloud Software Group 31/03/29, 6.50%	252 333	0,36	
305 000	USD		ASP Unifrax Holdings 30/09/28, 5.25%	217 690	0,31	52 000	USD		Cloudflare 15/08/26, ZCP	44 460	0,06	
170 000	USD		AssuredPartners 15/01/29, 5.63%	147 372	0,21	280 000	USD		Cogent Communications Group 15/06/27, 7.00%	267 669	0,38	
115 000	USD		B&G Foods 15/09/28, 8.00%	115 381	0,17	45 000	USD		CommScope 01/07/28, 7.13%	26 401	0,04	
50 000	USD		Bausch Health 01/02/27, 6.13%	31 283	0,04	225 000	USD		CommScope 01/09/29, 4.75%	163 544	0,24	
55 000	USD		Bausch Health 01/06/28, 4.88%	31 375	0,05	145 000	USD		CommScope Technologies 15/06/25, 6.00%	135 628	0,19	
49 000	USD		Beauty Health 01/10/26, 1.25%	38 343	0,06	40 000	USD		Community Health Systems 15/03/27, 5.63%	34 346	0,05	
375 000	USD		BellRing Brands 15/03/30, 7.00%	369 801	0,53	30 000	USD		Community Health Systems 15/01/29, 6.00%	24 260	0,03	
293 445	USD		Blackbird Capital Aircraft 15/07/46, 2.44%	251 022	0,36	35 000	USD		Comstock Resources 15/01/30, 5.88%	30 338	0,04	
41 000	USD		Blackline 15/03/26, ZCP	35 516	0,05	380 000	USD		Consolidated Communications 01/10/28, 6.50%	297 825	0,43	
									Coty 15/04/26, 6.50%	333 744	0,48	
									CQP 15/06/31, 5.50%	350 555	0,50	
									CSC Holdings 01/02/28, 5.38%	216 069	0,31	

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregeltten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregeltten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
3 000	USD	Datadog 15/06/25, 0.13%	3 536	0,01	135 000	USD	GTCR W-2 Merger Sub 15/01/31, 7.50%	135 678	0,19
430 000	USD	Directv Financing 15/08/27, 5.88%	381 380	0,55	41 000	USD	Haemonetics 01/03/26, ZCP	35 773	0,05
115 000	USD	DISH DBS 01/12/26, 5.25%	97 563	0,14	410 000	USD	Hanesbrands 15/02/31, 9.00%	390 903	0,56
50 000	USD	DISH DBS 01/12/28, 5.75%	38 531	0,06	200 000	USD	HAT Holdings I 15/04/25, 6.00%	194 828	0,28
405 000	USD	Edgewell Personal Care 01/04/29, 4.13%	344 876	0,50	375 000	USD	HAT Holdings I 15/06/26, 3.38%	333 716	0,48
9 000	USD	Enphase Energy 01/03/28, ZCP	7 493	0,01	80 000	USD	HAT Holdings I 15/09/30, 3.75%	61 320	0,09
18 000	USD	Envestnet 01/12/27, 2.63%	16 497	0,02	170 000	USD	Hess Midstream Operations 15/06/28, 5.13%	156 615	0,23
6 000	USD	Envista Holdings 15/08/28, 1.75%	5 556	0,01	285 000	USD	Howard Midstream Energy Partners 15/07/28, 8.88%	287 757	0,41
510 000	USD	EquipmentShare.com 15/05/28, 9.00%	491 614	0,70	350 000	USD	Hunt 15/04/29, 5.25%	275 324	0,40
6 000	USD	Etsy 01/10/26, 0.13%	6 120	0,01	405 000	USD	Imola Merger 15/05/29, 4.75%	355 371	0,51
30 000	USD	Etsy 15/06/28, 0.25%	22 890	0,03	10 000	USD	Integer Holdings 15/02/28, 2.13%	10 915	0,02
322 000	USD	Everi Holdings 15/07/29, 5.00%	278 194	0,40	185 000	USD	Iron Mountain 15/03/28, 5.25%	171 269	0,25
9 000	USD	Exact Sciences 15/03/27, 0.38%	8 190	0,01	180 000	USD	Iron Mountain 15/07/28, 5.00%	163 943	0,24
125 000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/29, 4.63%	106 074	0,15	305 000	USD	JB Poindexter 15/04/26, 7.13%	296 991	0,43
90 000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/30, 6.75%	73 467	0,11	65 000	USD	JetBlue Airways 01/04/26, 0.50%	50 577	0,07
455 000	USD	FirstCash 01/01/30, 5.63%	409 895	0,59	145 000	USD	LABL 01/11/28, 5.88%	130 474	0,19
7 000	USD	Fluor 15/08/29, 1.13%	7 261	0,01	375 000	USD	Level 3 Financing 01/07/28, 4.25%	234 129	0,34
400 000	USD	FMC GMSR Issuer Trust 25/07/26, variabel	329 022	0,47	14 000	USD	Liberty Media-Liberty Formula One 15/08/27, 2.25%	13 692	0,02
22 000	USD	Ford Motor 15/03/26, ZCP	21 725	0,03	12 000	USD	LivNova USA 15/12/25, 3.00%	13 058	0,02
160 000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/08/27, 9.75%	165 647	0,24	15 000	USD	Live Nation Entertainment 15/01/29, 3.13%	15 593	0,02
195 000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/05/28, 5.50%	176 998	0,25	23 000	USD	Lumentum Holdings 15/06/28, 0.50%	16 820	0,02
210 000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/28, 5.00%	179 599	0,26	600 000	USD	Marriott Ownership Resorts 15/06/29, 4.50%	503 357	0,71
170 000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/29, 6.75%	131 030	0,19	340 000	USD	Medline Borrower 01/10/29, 5.25%	294 292	0,42
195 000	USD	Graham Packaging 15/08/28, 7.13%	163 645	0,24	295 000	USD	Minerals Technologies 01/07/28, 5.00%	270 912	0,39
305 000	USD	Gray Television 15/10/30, 4.75%	202 437	0,29	17 000	USD	MP Materials 01/04/26, 0.25%	14 685	0,02
					155 000	USD	MPH Acquisition Holdings 01/09/28, 5.50%	131 864	0,19

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.



# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
2 000	USD	Nabors Industries 15/06/29, 1.75%	1 769	-	23 000	USD	Shift4 Payments 01/08/27, 0.50%	19 766	0,03
280 791	USD	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 15/03/35, variabel	276 433	0,40	535 000	USD	Sirius XM Radio 01/07/29, 5.50%	473 847	0,68
105 000	USD	NCR 01/10/28, 5.00%	94 087	0,14	240 000	USD	Six Flags Entertainment 15/04/27, 5.50%	221 032	0,32
245 000	USD	NCR 15/04/29, 5.13%	216 106	0,31	195 000	USD	SK Invictus Intermediate II 30/10/29, 5.00%	156 505	0,22
140 000	USD	NCR Atleos Escrow 01/04/29, 9.50%	136 134	0,20	45 000	USD	Spirit AeroSystems 15/04/25, 7.50%	44 208	0,06
180 000	USD	Necessity Retail Real Estate Investment Trust 30/09/28, 4.50%	137 232	0,20	18 000	USD	Splunk 15/09/25, 1.13%	19 386	0,03
355 000	USD	Neptune Bidco US 15/04/29, 9.29%	322 216	0,46	48 000	USD	Spotify USA 15/03/26, ZCP	40 974	0,06
27 000	USD	NextEra Energy Partners 15/06/24, ZCP	25 677	0,04	55 000	USD	Standard Industries 15/01/28, 4.75%	49 678	0,07
18 000	USD	NRG Energy 01/06/48, 2.75%	19 134	0,03	170 000	USD	Standard Industries 15/07/30, 4.38%	141 187	0,20
52 000	USD	Nutanix 01/10/27, 0.25%	46 670	0,07	425 000	USD	Talen Energy Supply 01/06/30, 8.63%	436 045	0,63
33 000	USD	NuVasive 15/03/25, 0.38%	30 476	0,04	55 000	USD	Tenet Healthcare 01/02/27, 6.25%	53 269	0,08
275 000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/28, 4.25%	224 474	0,32	325 000	USD	Tenet Healthcare 01/10/28, 6.13%	305 396	0,44
55 000	USD	Olympus Water US Holding 15/11/28, 9.75%	54 951	0,08	95 000	USD	TMS International 15/04/29, 6.25%	78 670	0,11
10 000	USD	ON Semiconductor 01/03/29, 0.50%	11 030	0,02	5 000	USD	TransMedics Group 01/06/28, 1.50%	4 541	0,01
290 000	USD	OneMain Finance 15/03/26, 7.13%	284 445	0,41	40 000	USD	Tronox 15/03/29, 4.63%	32 315	0,05
390 000	USD	Pediatrix Medical Group 15/02/30, 5.38%	343 945	0,49	105 000	USD	Uber Technologies 15/09/27, 7.50%	105 991	0,15
28 000	USD	Perficient 15/11/26, 0.13%	22 576	0,03	110 000	USD	Uber Technologies 15/01/28, 6.25%	107 682	0,15
205 000	USD	Performance Food Group 15/10/27, 5.50%	194 414	0,28	71 000	USD	Unity Software 15/11/26, ZCP	56 552	0,08
125 000	USD	Permian Resources Operating 15/02/26, 7.75%	125 924	0,18	165 000	USD	Univision Communications 30/06/30, 7.38%	150 914	0,22
200 000	USD	Post Holdings 15/01/28, 5.63%	189 240	0,27	80 000	USD	US Foods 01/06/30, 4.63%	69 589	0,10
480 000	USD	Prime Security Services Borrower 15/01/28, 6.25%	445 138	0,64	200 000	USD	Venture Global LNG 01/06/28, 8.13%	198 158	0,28
293 416	USD	PRPM 25/06/26, variabel	234 600	0,34	85 000	USD	Venture Global LNG 01/06/31, 8.38%	83 632	0,12
200 000	USD	PRPM 25/09/26, variabel	161 106	0,23	400 000	USD	Verus Securitization Trust 25/08/67, variabel	378 688	0,54
40 000	USD	QVC 01/04/24, 4.85%	38 486	0,06	211 000	USD	Verus Securitization Trust 25/06/68, variabel	206 431	0,30
65 000	USD	QVC 15/02/25, 4.45%	56 951	0,08	97 609	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-A3 25/08/68, variabel	97 407	0,14
85 000	USD	Rocket Mortgage 15/10/26, 2.88%	74 664	0,11	100 000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-B1 25/08/68, variabel	97 357	0,14
165 000	USD	SEG Holding 15/10/28, 5.63%	165 512	0,24					
31 000	USD	Shake Shack 01/03/28, ZCP	23 289	0,03					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelteten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
100 000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-M1 25/08/68, variabel	99 115	0,14
201 000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-A3 25/09/68, variabel	201 010	0,29
150 000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-B1 25/09/68, variabel	145 389	0,21
100 000	USD	Vistra Operations 15/10/31, 7.75%	98 728	0,14
370 000	USD	VM Consolidated 15/04/29, 5.50%	333 458	0,48
189 000	USD	VMC Finance 16/06/36, variabel	169 005	0,24
455 000	USD	VMC Finance Series 2021-FL4 16/06/36, variabel	420 486	0,60
370 000	USD	Wash Multifamily Acquisition 15/04/26, 5.75%	345 902	0,50
375 000	USD	Watco 15/06/27, 6.50%	356 556	0,51
390 480	USD	WAVE Trust 15/11/42, 3.84%	315 847	0,45
34 000	USD	Western Digital 01/02/24, 1.50%	33 592	0,05
90 000	USD	Windsor Holdings III 15/06/30, 8.50%	88 908	0,13
14 000	USD	Wolfspeed 15/02/28, 0.25%	9 506	0,01
11 000	USD	World Kinect 01/07/28, 3.25%	10 925	0,02
13 000	USD	Zscaler 01/07/25, 0.13%	15 678	0,02
<b>Summe Anleihen</b>			<b>48 254 368</b>	<b>69,33</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelteten Markt gehandelt werden</b>			<b>48 254 368</b>	<b>69,33</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Anleihen</b>				
<b>Kaimaninseln</b>			<b>651 524</b>	<b>0,94</b>
756 453	USD	Horizon Aircraft Finance I 15/12/38, 4.46%	651 524	0,94
<b>China</b>			<b>32 081</b>	<b>0,05</b>
5 000	USD	Bilibili 01/04/26, 1.38%	4 963	0,01
200 000	USD	Shimao Group Holdings 15/07/26, 5.60%*	7 000	0,01
200 000	USD	Shimao Group Holdings 13/07/30, 4.60%*	7 982	0,01
200 000	USD	Sino-Ocean Land Treasure IV 05/05/26, 3.25%	12 136	0,02
<b>Irland</b>			<b>2 109 873</b>	<b>3,03</b>
750 000	EUR	Aurium CLO 18/01/38, variabel	793 334	1,14
500 000	EUR	Dryden 27 R Euro CLO DAC 15/04/33, variabel	464 139	0,67
250 000	EUR	ICG Euro CLO DAC 15/05/35, variabel	251 937	0,36
500 000	EUR	ICG Euro CLO DAC Series 2022-1A 15/05/35, variabel	505 363	0,72
100 000	EUR	Rockford Tower Europe CLO DAC 20/04/34, variabel	95 100	0,14
<b>USA</b>			<b>852 818</b>	<b>1,23</b>
100 000	EUR	Darling Global Finance 15/05/26, 3.63%	102 781	0,15
750 000	USD	Voya CLO 20/10/34, variabel	750 037	1,08
<b>Summe Anleihen</b>			<b>2 757 862</b>	<b>3,97</b>
<b>Summe sonstige Wertpapiere</b>			<b>2 757 862</b>	<b>3,97</b>
<b>Summe Kapitalanlagen</b>			<b>63 070 539</b>	<b>90,63</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>			<b>6 522 503</b>	<b>9,37</b>
<b>Nettoinventarwert</b>			<b>69 593 042</b>	<b>100,00</b>

\* Notleidendes Wertpapier.

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA SEG US Equity\*

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert GBP	% Netto- vermö- gen
<b>Aktien</b>				
<b>USA</b>			<b>271 886 595</b>	<b>82,11</b>
49 655	USD	Amphenol	4 170 523	1,26
12 671	USD	ANSYS	3 770 256	1,14
222 691	USD	Brown & Brown	15 552 739	4,70
98 764	USD	CDW	19 926 625	6,02
307 009	USD	Ceridian HCM Holding	20 830 561	6,29
72 435	USD	Clean Harbors	12 122 722	3,66
64 842	USD	Core & Main	1 870 692	0,56
159 574	USD	Entegris	14 985 594	4,53
19 014	USD	Fastenal	1 038 925	0,31
72 314	USD	Jacobs Solutions	9 870 861	2,98
268 453	USD	Live Nation Entertainment	22 292 336	6,73
35 594	USD	Martin Marietta Materials	14 610 625	4,41
86 616	USD	Middleby	11 086 848	3,35
15 267	USD	Morningstar	3 576 142	1,08
33 416	USD	Paychex	3 853 867	1,16
101 550	USD	PTC	14 387 604	4,35
129 547	USD	Revvity	14 340 853	4,33
276 135	USD	Rollins	10 308 120	3,11
97 070	USD	Service International	5 546 580	1,68
233 731	USD	Signet Jewelers	16 784 223	5,07
27 617	USD	Teledyne Technologies	11 283 754	3,41
116 959	USD	Toro	9 719 293	2,94
84 435	USD	Trimble	4 547 669	1,37
63 617	USD	Vail Resorts	14 115 976	4,26
106 269	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	11 293 207	3,41
<b>Summe Aktien</b>			<b>271 886 595</b>	<b>82,11</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind</b>			<b>271 886 595</b>	<b>82,11</b>
<b>Summe Kapitalanlagen</b>			<b>271 886 595</b>	<b>82,11</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>			<b>59 239 372</b>	<b>17,89</b>
<b>Nettoinventarwert</b>			<b>331 125 967</b>	<b>100,00</b>

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.



# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Sirios US Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Aktien</b>				
<b>Schweiz</b>			<b>7 731 045</b>	<b>4,51</b>
100 325	USD	Alcon	7 731 045	4,51
<b>Taiwan</b>			<b>501 239</b>	<b>0,29</b>
5 768	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	501 239	0,29
<b>USA</b>			<b>118 697 970</b>	<b>69,24</b>
37 742	USD	Abbott Laboratories	3 655 313	2,13
5 637	USD	Adobe	2 874 306	1,68
17 819	USD	agilon health	316 465	0,18
20 715	USD	Alphabet	2 710 765	1,58
10 988	USD	American Express	1 639 300	0,96
17 052	USD	Analog Devices	2 985 635	1,74
12 449	USD	Becton Dickinson	3 218 440	1,88
116 603	USD	Boston Scientific	6 156 638	3,59
100 556	USD	Carlyle Group	3 032 769	1,77
10 279	USD	Clean Harbors	1 720 293	1,00
11 060	USD	Constellation Brands	2 779 710	1,62
3 524	USD	CyberArk Software	577 125	0,34
1 678	USD	Danaher	416 312	0,24
55 380	USD	Delta Air Lines	2 049 060	1,20
8 075	USD	Eli Lilly	4 337 325	2,53
23 150	USD	General Electric	2 559 233	1,49
28 330	USD	Global Payments	3 268 999	1,91
52 184	USD	Globus Medical	2 590 936	1,51
6 093	USD	HCA Healthcare	1 498 756	0,87
28 779	USD	HEICO	3 718 822	2,17
6 677	USD	Hess	1 021 581	0,60
11 268	USD	Inari Medical	736 927	0,43
430	USD	Inspire Medical Systems	85 329	0,05
1 340	USD	Intuit	684 660	0,40
18 298	USD	Keysight Technologies	2 421 008	1,41
396	USD	KLA	181 629	0,11
11 754	USD	Lantheus Holdings	816 668	0,48
2 853	USD	Marvell Technology	154 433	0,09
36 340	USD	Medtronic	2 847 602	1,66
14 618	USD	Microsoft	4 615 634	2,69
21 599	USD	Nabors Industries	2 659 701	1,55
3 439	USD	Natera	152 176	0,09
295 793	USD	Norwegian Cruise Line Holdings	4 874 669	2,84
4 449	USD	Old Dominion Freight Line	1 820 264	1,06
4 521	USD	Option Care Health	146 254	0,09

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
30 176	USD	PACCAR	2 565 564	1,50
19 350	USD	PacWest Bancorporation	396 482	0,23
2 664	USD	Palo Alto Networks	624 548	0,36
107 430	USD	Portillo's	1 653 348	0,96
13 973	USD	Regions Financial	240 336	0,14
56 310	USD	Riskified	252 269	0,15
17 450	USD	Roper Technologies	8 450 685	4,93
23 237	USD	S&P Global	8 491 031	4,95
29 330	USD	Schlumberger	1 709 939	1,00
12 433	USD	Splunk	1 818 326	1,06
17 572	USD	Tenable Holdings	787 226	0,46
4 087	USD	Tenet Healthcare	269 292	0,16
25 976	USD	Texas Instruments	4 130 444	2,41
13 700	USD	T-Mobile US	1 918 685	1,12
15 254	USD	Union Pacific	3 106 172	1,81
14 361	USD	Waste Connections	1 928 682	1,13
74 349	USD	Wells Fargo	3 037 900	1,77
9 273	USD	Workday	1 992 304	1,16
<b>Summe Aktien</b>			<b>126 930 254</b>	<b>74,04</b>
<b>Anleihen</b>				
<b>USA</b>			<b>1 628 711</b>	<b>0,95</b>
1 733 000	USD	TransDigm 15/11/27, 5.50%	1 628 711	0,95
<b>Summe Anleihen</b>			<b>1 628 711</b>	<b>0,95</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind</b>			<b>128 558 965</b>	<b>74,99</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Anleihen</b>				
<b>USA</b>			<b>31 045 369</b>	<b>18,11</b>
1 274 000	USD	NCL 15/03/26, 5.88%	1 177 369	0,69
30 000 000	USD	United States Treasury Bill 02/11/23, ZCP	29 868 000	17,42
<b>Summe Anleihen</b>			<b>31 045 369</b>	<b>18,11</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden</b>			<b>31 045 369</b>	<b>18,11</b>
<b>Summe Kapitalanlagen</b>			<b>159 604 334</b>	<b>93,10</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>			<b>11 832 682</b>	<b>6,90</b>
<b>Nettoinventarwert</b>			<b>171 437 016</b>	<b>100,00</b>

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Anleihen</b>				
<b>Deutschland</b>			<b>62 944</b>	<b>0,01</b>
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4.25%	12 205	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4.75%	12 970	0,01
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3.25%	10 907	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2.50%	9 748	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2.50%	9 702	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1.25%	7 412	-
<b>USA</b>			<b>20 916</b>	<b>0,01</b>
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2.50%	6 787	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3.00%	7 423	0,01
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2.50%	6 706	-
<b>Summe Anleihen</b>			<b>83 860</b>	<b>0,02</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind</b>			<b>83 860</b>	<b>0,02</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Anleihen</b>				
<b>USA</b>			<b>21 324</b>	<b>0,01</b>
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2.88%	7 240	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3.00%	7 391	0,01
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2.50%	6 693	-
<b>Summe Anleihen</b>			<b>21 324</b>	<b>0,01</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden</b>			<b>21 324</b>	<b>0,01</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Luxemburg</b>				
<b>5 000 000</b>			<b>5 000 000</b>	<b>1,32</b>
5 000 000	USD	JPMorgan Liquidity Funds-US Dollar Treasury Liquidity Fund	5 000 000	1,32
<b>Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen</b>			<b>5 000 000</b>	<b>1,32</b>
<b>Summe Kapitalanlagen</b>			<b>5 105 184</b>	<b>1,35</b>

<b>Termineinlagen</b>				
<b>Finanzen</b>			<b>221 977 000</b>	<b>58,58</b>
52 000 000	USD	Banque 02/10/23, 5.30%	52 000 000	13,73
52 000 000	USD	Credit Agricole 02/10/23, 5.30%	52 000 000	13,72
14 000 000	USD	Mizuho Bank 02/10/23, 5.32%	14 000 000	3,69
51 977 000	USD	Rabobank 02/10/23, 5.30%	51 977 000	13,72
52 000 000	USD	Toronto-Dominion Bank 02/10/23, 5.30%	52 000 000	13,72
<b>Summe Termineinlagen</b>			<b>221 977 000</b>	<b>58,58</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>			<b>151 836 944</b>	<b>40,07</b>
<b>Nettoinventarwert</b>			<b>378 919 128</b>	<b>100,00</b>

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Aktien</b>				
<b>Australien</b>				
127 645	GBP	Glencore	731 821	0,15
<b>Österreich</b>				
21 835	EUR	Addiko Bank	293 180	0,06
31 741	EUR	BAWAG Group	1 458 438	0,30
<b>Belgien</b>				
1 177	EUR	Aedifica	67 010	0,01
14 000	EUR	KBC Group	875 360	0,18
3 516	EUR	UCB	288 239	0,06
<b>Brasilien</b>				
1 265	USD	Banco Bradesco	3 605	-
148 931	BRL	Hapvida Participacoes e Investimentos	139 256	0,03
<b>Kanada</b>				
194 638	CAD	Advantage Energy	1 328 396	0,27
210 328	CAD	ARC Resources	3 357 197	0,70
69 853	USD	Barrick Gold	1 016 361	0,21
22 919	USD	Canadian Natural Resources	1 482 172	0,31
115 292	USD	Cenovus Energy	2 400 379	0,50
3 200	USD	Clementia Pharmaceuticals	-	-
12 646	CAD	Enbridge	419 438	0,09
88 746	CAD	Enerplus	1 561 590	0,32
77 819	CAD	Foran Mining	212 559	0,04
22 486	CAD	Headwater Exploration	118 535	0,02
4 500	CAD	Intact Financial	656 057	0,14
113 841	CAD	Kelt Exploration	607 655	0,13
48 381	CAD	MEG Energy	941 439	0,19
108 254	CAD	NuVista Energy	1 036 114	0,21
80 200	CAD	Peyto Exploration & Development	813 662	0,17
53 343	CAD	Peyto Exploration & Development	537 652	0,11
8 320	USD	Shopify	454 022	0,09
10 663	USD	Suncor Energy	366 594	0,08
1 255	CAD	Tourmaline Oil	63 154	0,01
<b>China</b>				
214 030	HKD	Alibaba Group Holding	2 339 558	0,48
22 934	CNH	Amoy Diagnostics	78 100	0,02
2 860	HKD	Anhui Conch Cement	7 615	-
20 600	HKD	Anta Sports Products	231 886	0,05
3 739	HKD	BYD	115 546	0,02

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
201 617	HKD	China Gas Holdings	190 264	0,04
358 618	HKD	China Longyuan Power Group	312 322	0,06
11 923	HKD	China National Building Material	6 258	-
61 886	HKD	China Resources Gas Group	181 368	0,04
27 205	CNH	Contemporary Amperex Technology	756 925	0,16
32 774	HKD	ENN Energy Holdings	272 037	0,06
54 070	HKD	Hope Education Group	3 418	-
1 563	HKD	JD.com	22 973	-
310 213	HKD	Kunlun Energy	267 393	0,06
26 579	HKD	Li Ning	111 835	0,02
229 124	HKD	Lifetech Scientific	70 221	0,01
2 368	HKD	Ping An Insurance Group of China	13 562	-
14 460	CNH	Proya Cosmetics	201 329	0,04
15 302	HKD	Remegen	78 748	0,02
140 600	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer	123 526	0,03
9 900	HKD	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical	96 839	0,02
235 517	CNH	Sinoma Science & Technology	663 574	0,14
9 900	HKD	Tencent Holdings	387 102	0,08
132 000	HKD	Venus MedTech Hangzhou	78 381	0,02
25 800	HKD	WuXi AppTec	308 871	0,06
455	HKD	XPeng	4 064	-
1 240	CNH	Yunnan Energy New Material	10 179	-
7 191	USD	Zai Lab	174 813	0,04
509	CNH	Zhejiang HangKe Technology	1 824	-
5 539	CNH	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology	5 200	-
<b>Dänemark</b>			<b>465 204</b>	<b>0,10</b>
4 968	USD	Ascendis Pharma	465 204	0,10
<b>Finnland</b>			<b>500 905</b>	<b>0,10</b>
45 560	SEK	Nordea Bank Abp	500 905	0,10
<b>Frankreich</b>			<b>5 007 079</b>	<b>1,04</b>
74 213	EUR	ALD	575 517	0,12
24 510	EUR	AXA	730 234	0,15
16 872	EUR	BNP Paribas	1 077 945	0,22
3 590	EUR	Cie de Saint-Gobain	215 890	0,04
1 574	EUR	Dassault Aviation	296 877	0,06
77 516	EUR	Engie	1 190 788	0,26

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
2 260	EUR	Publicis Groupe	171 462	0,04
11 360	EUR	TotalEnergies	748 366	0,15
<b>Deutschland</b>			<b>4 830 149</b>	<b>1,00</b>
1 926	EUR	Allianz	459 585	0,10
3 692	EUR	Bayer	177 408	0,04
9 025	EUR	Daimler Truck Holding	313 158	0,06
16 495	USD	Immatics	191 012	0,04
5 914	EUR	LEG Immobilien	408 543	0,08
2 139	EUR	Münchener Rückversicherungs- Gesellschaft in München	834 704	0,17
1 689	EUR	Rheinmetall	435 531	0,09
5 652	EUR	Siemens	810 647	0,17
18 216	EUR	Talanx	1 155 532	0,24
307	EUR	Wacker Chemie	44 029	0,01
<b>Indien</b>			<b>568 317</b>	<b>0,12</b>
484	INR	Adani Ports & Special Economic Zone	4 812	-
1 702	INR	Ambuja Cements	8 706	-
49 182	INR	Bharti Airtel	548 995	0,12
15 252	INR	IRB Infrastructure Developers	5 804	-
<b>Irland</b>			<b>2 644 280</b>	<b>0,55</b>
4 776	USD	AerCap Holdings	299 312	0,06
273 063	EUR	AIB Group	1 229 844	0,26
166 171	EUR	Irish Continental Group	785 309	0,16
75 090	EUR	Permanent TSB Group Holdings	170 686	0,04
3 298	USD	Prothena	159 129	0,03
<b>Italien</b>			<b>3 114 511</b>	<b>0,64</b>
3 612	EUR	DiaSorin	330 020	0,07
1 311	EUR	FinecoBank Banca Fineco	15 960	-
300 327	EUR	Intesa Sanpaolo	774 751	0,16
82 966	EUR	UniCredit	1 993 780	0,41
<b>Japan</b>			<b>6 829 640</b>	<b>1,41</b>
3 000	JPY	Bank of Nagoya	104 189	0,02
186 500	JPY	Chiba Bank	1 357 192	0,29
20 535	JPY	Chugai Pharmaceutical	635 398	0,13
224 400	JPY	Concordia Financial Group	1 023 344	0,21
10 990	JPY	Daiichi Sankyo	301 960	0,06
6 800	JPY	Ebara	318 932	0,07
2 798	JPY	Eisai	155 478	0,03
1 400	JPY	Hyakujushi Bank	24 564	0,01
25 900	JPY	Iyogin Holdings	186 312	0,04
21 000	JPY	Kyushu Financial Group	108 344	0,02
1 400	JPY	Mitsubishi Gas Chemical	18 854	-

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
102	JPY	Omron	4 551	-
16 500	JPY	Otsuka Holdings	586 620	0,12
205	JPY	Panasonic Holdings	2 307	-
50 200	JPY	Resona Holdings	278 243	0,06
29 700	JPY	Shiga Bank	695 597	0,14
6 000	JPY	Shiseido	210 787	0,04
5 420	JPY	Sony Group	443 929	0,09
9 900	JPY	Sumitomo Mitsui Trust Holdings	373 039	0,08
<b>Jersey</b>			<b>1 823 836</b>	<b>0,38</b>
33 781	USD	WisdomTree Brent Crude Oil	1 823 836	0,38
<b>Niederlande</b>			<b>6 240 333</b>	<b>1,29</b>
1 779	USD	Argenx	874 610	0,18
17 493	EUR	ASR Nederland	656 924	0,14
30 374	EUR	EXOR	2 695 557	0,56
10 980	USD	Merus	258 908	0,05
55 175	GBP	Shell	1 754 334	0,36
<b>Norwegen</b>			<b>1 031 330</b>	<b>0,21</b>
44 536	NOK	Aker Carbon Capture	47 173	0,01
17 109	USD	Seadrill	766 312	0,15
15 895	NOK	TGS	217 845	0,05
<b>Philippinen</b>			<b>3 420</b>	<b>-</b>
2 420	PHP	Security Bank	3 420	-
<b>Südafrika</b>			<b>805 884</b>	<b>0,17</b>
29 155	GBP	Anglo American	805 884	0,17
<b>Südkorea</b>			<b>475 309</b>	<b>0,10</b>
9 246	KRW	Samsung Electronics	468 672	0,10
118	KRW	SKC	6 637	-
<b>Spanien</b>			<b>1 252 539</b>	<b>0,26</b>
148 134	EUR	CaixaBank	592 943	0,12
612 246	EUR	Unicaja Banco	659 596	0,14
<b>Schweiz</b>			<b>2 302 237</b>	<b>0,48</b>
6 260	CHF	Alcon	485 153	0,10
2 372	CHF	Cie Financiere Richemont	290 232	0,06
6 045	CHF	Novartis	619 920	0,13
370	CHF	Tecan Group	124 984	0,03
31 545	CHF	UBS Group	781 948	0,16
<b>Taiwan</b>			<b>188 308</b>	<b>0,04</b>
1 393	TWD	Kinsus Interconnect Technology	4 682	-
290	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	4 699	-
2 059	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing-ADR	178 927	0,04
<b>Vereinigtes Königreich</b>			<b>8 653 550</b>	<b>1,79</b>
9 606	USD	Abcam	217 384	0,04
16 670	GBP	Admiral Group	483 460	0,10

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
12 873	GBP	AstraZeneca	1 743 720	0,37	4 151	USD	Biogen	1 066 849	0,22
120 330	GBP	Aviva	572 283	0,12	546	USD	BlackRock	352 984	0,07
455 808	GBP	Barclays	883 916	0,18	3 376	USD	Blueprint Medicines	169 543	0,04
65 754	GBP	Beazley	444 053	0,09	94	USD	Booking Holdings	289 891	0,06
79 486	GBP	BP	515 356	0,11	3 760	USD	Boston Properties	223 645	0,05
17 305	GBP	British American Tobacco	544 103	0,11	2 388	USD	Boston Scientific	126 086	0,03
19 101	GBP	Cranswick	827 798	0,17	10 335	USD	Bridgebio Pharma	272 534	0,06
3 339	GBP	Genus	85 389	0,02	5 855	USD	Builders FirstSource	728 889	0,15
19 129	GBP	Hunting	71 302	0,01	15 589	USD	BWX Technologies	1 168 863	0,24
29 009	GBP	IMI	554 976	0,11	2 453	USD	California Resources	137 393	0,03
26 358	GBP	Lancashire Holdings	189 740	0,04	7 785	USD	Capital One Financial	755 534	0,16
4 305	GBP	London Stock Exchange Group	432 493	0,09	2 200	USD	Cboe Global Markets	343 662	0,07
22 263	GBP	National Grid	266 198	0,06	532	USD	Cencora	95 744	0,02
28 638	NOK	Subsea 7	394 632	0,08	5 275	USD	Centene	363 342	0,08
11 541	USD	Verona Pharma	188 118	0,04	15 452	USD	CenterPoint Energy	414 886	0,09
28 527	GBP	Wise	238 629	0,05	2 874	USD	CH Robinson Worldwide	247 538	0,05
<b>USA</b>			<b>93 570 850</b>	<b>19,34</b>	3 296	USD	Cheniere Energy	547 004	0,11
6 983	USD	Abbott Laboratories	676 304	0,14	6 712	USD	Chesapeake Energy	578 776	0,12
5 393	USD	Acadia Healthcare	379 182	0,08	10 196	USD	Chord Energy	1 652 466	0,34
17 124	USD	Aclaris Therapeutics	117 299	0,02	56 081	USD	Citizens Financial Group	1 502 971	0,31
2 728	USD	Addus HomeCare	232 398	0,05	5 173	USD	Comcast	229 371	0,05
6 209	USD	agilon health	110 272	0,02	9 946	USD	ConocoPhillips	1 191 531	0,25
4 574	USD	Akero Therapeutics	231 353	0,05	913	USD	Consolidated Edison	78 089	0,02
45 912	USD	Alignment Healthcare	318 629	0,07	45 498	USD	Coterra Energy	1 230 721	0,25
19 941	USD	Alkermes	558 547	0,12	10 993	USD	Crinetics Pharmaceuticals	326 932	0,07
4 591	USD	Alnylam Pharmaceuticals	813 066	0,17	15 820	USD	Cytokinetics	466 057	0,10
1 191	USD	Amazon.com	151 400	0,03	2 094	USD	Danaher	519 521	0,11
23 713	USD	American Electric Power	1 783 692	0,37	564	USD	Deere	212 842	0,04
2 819	USD	American Express	420 567	0,09	4 515	USD	Denali Therapeutics	93 144	0,02
713	USD	American Water Works	88 291	0,02	2 422	USD	Devon Energy	115 529	0,02
843	USD	AMETEK	124 562	0,03	1 817	USD	Dexcom	169 526	0,04
806	USD	ANSYS	239 825	0,05	21 200	USD	Diamondback Energy	3 283 455	0,67
26 270	USD	Antero Resources	666 733	0,14	10 830	USD	Dominion Energy	483 776	0,10
282	USD	Aon	91 430	0,02	89	USD	DR Horton	9 565	-
9 235	USD	Apellis Pharmaceuticals	351 299	0,07	6 036	USD	Edison International	382 018	0,08
1 315	USD	Applied Industrial Technologies	203 312	0,04	19 897	USD	Elanco Animal Health	223 642	0,05
39 058	USD	Ares Management	4 017 895	0,82	2 280	USD	elf Beauty	250 412	0,05
3 020	USD	Array Technologies	67 014	0,01	3 349	USD	Eli Lilly	1 798 848	0,37
16 949	USD	Atmos Energy	1 795 408	0,37	2 884	USD	Encompass Health	193 689	0,04
6 730	USD	AtriCure	294 774	0,06	3 828	USD	Entergy	354 090	0,07
343	USD	Autodesk	70 970	0,01	87 167	USD	EQT	3 537 236	0,72
22 564	USD	AZEK	671 053	0,14	260	USD	Equinix	188 828	0,04
5 242	USD	Baker Hughes	185 147	0,04	6 100	USD	Eversource Energy	354 715	0,07
37 551	USD	Bank of New York Mellon	1 601 550	0,33	13 799	USD	Exact Sciences	941 368	0,19
7 911	USD	Bath & Body Works	267 392	0,06	13 798	USD	Exelon	521 426	0,11
1 054	USD	Becton Dickinson	272 491	0,06	27 811	USD	Expro Group Holdings	646 050	0,13
					10 857	USD	Federated Hermes	367 727	0,08

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.



# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
18 516	USD	Flex	499 562	0,10	18 550	USD	Navigator Holdings	273 984	0,06
21 995	USD	Fluor	807 217	0,17	13 675	USD	Net Power	206 493	0,04
125 164	USD	FNB	1 350 520	0,28	1 836	USD	NiSource	45 312	0,01
3 050	USD	Fortive	226 188	0,05	5 165	USD	Nuvalent	237 435	0,05
71 903	USD	Geron	152 434	0,03	937	USD	NVIDIA	407 586	0,08
2 475	USD	Goldman Sachs Group	800 836	0,17	4 021	USD	ON Semiconductor	373 752	0,08
4 090	GBP	GSK	74 454	0,02	4 858	USD	ONE Gas	331 704	0,07
2 237	USD	Gulfport Energy	265 442	0,05	2 059	USD	Oracle	218 089	0,05
200 778	GBP	Haleon	834 978	0,17	660	USD	Paycom Software	171 118	0,04
7 426	USD	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital	157 431	0,03	4 452	USD	Pfizer	147 673	0,03
2 227	USD	HCA Healthcare	547 797	0,11	70 127	USD	PG&E	1 131 149	0,23
15 437	USD	Health Catalyst	156 222	0,03	2 219	USD	Phillips 66	266 613	0,06
2 272	USD	Hologic	157 677	0,03	1 602	USD	Pioneer Natural Resources	367 739	0,08
10 685	USD	Houlihan Lokey	1 144 577	0,24	10 142	USD	Privia Health Group	233 266	0,05
227	USD	Humana	110 440	0,02	1 192	USD	Progressive	166 046	0,03
1 059	USD	ICON	260 779	0,05	1 673	USD	QuidelOrtho	122 196	0,03
896	USD	Illumina	123 003	0,03	4 205	USD	RayzeBio	93 351	0,02
25 749	USD	ImmunoGen	408 637	0,08	369	USD	Regeneron Pharmaceuticals	303 672	0,06
701	USD	Inari Medical	45 845	0,01	753	USD	RH	199 063	0,04
802	USD	Inspire Medical Systems	159 149	0,03	13 289	USD	Rocket Pharmaceuticals	272 292	0,06
574	USD	Insulet	91 547	0,02	35 663	USD	Roivant Sciences	416 544	0,09
34 893	USD	Intel	1 240 446	0,26	942	USD	Roper Technologies	456 192	0,09
546	USD	Intellia Therapeutics	17 265	-	3 853	USD	Ross Stores	435 196	0,09
2 638	USD	Intercontinental Exchange	290 233	0,06	5 501	USD	S&P Global	2 010 119	0,42
1 440	USD	Intuitive Surgical	420 898	0,09	5 574	USD	Sage Therapeutics	114 713	0,02
3 537	USD	JPMorgan Chase	512 936	0,11	2 683	USD	Salesforce	544 059	0,11
2 885	USD	Karuna Therapeutics	487 825	0,10	225	USD	Sarepta Therapeutics	27 275	0,01
27 618	USD	KKR	1 701 269	0,35	20 284	USD	Schlumberger	1 182 557	0,24
509	USD	KLA	233 458	0,05	1 891	USD	Seagen	401 176	0,08
3 777	USD	Kymera Therapeutics	52 500	0,01	2 175	USD	Sempra	147 965	0,03
985	USD	Laboratory of America Holdings	198 034	0,04	120	USD	ServiceNow	67 075	0,01
3 250	USD	Legend Biotech	218 303	0,05	13 436	USD	Shoals Technologies Group	245 207	0,05
3 685	USD	Lennar	413 568	0,09	2 723	USD	Shockwave Medical	542 149	0,11
5 277	USD	Liberty Media-Liberty Formula One	328 757	0,07	3 136	USD	SilverBow Resources	112 175	0,02
6 124	USD	Marathon Oil	163 817	0,03	5 257	USD	Skyline Champion	334 976	0,07
1 540	USD	Marathon Petroleum	233 064	0,05	3 933	USD	Southwest Gas Holdings	237 593	0,05
8 626	USD	Matador Resources	513 074	0,11	5 131	USD	Sprouts Farmers Market	219 607	0,05
9 098	USD	Merck	936 639	0,19	5 400	USD	StepStone Group	170 532	0,04
336	USD	Meta Platforms	100 871	0,02	4 249	USD	Structure Therapeutics	214 235	0,04
555	USD	Microsoft	175 241	0,04	470	USD	Stryker	128 437	0,03
8 093	USD	Morgan Stanley	660 955	0,14	9 935	USD	Surgery Partners	290 599	0,06
2 315	USD	Morningstar	542 266	0,11	637	USD	Take-Two Interactive Software	89 428	0,02
600	USD	Morphic Holding	13 746	-					
605	USD	MSCI	310 413	0,06					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
28 576	USD	Targa Resources	2 449 534	0,51
9 007	USD	Tenaris	284 621	0,06
837	USD	Tesla	209 434	0,04
104	USD	Thermo Fisher Scientific	52 642	0,01
1 599	USD	Tidewater	113 641	0,02
2 678	USD	T-Mobile US	375 054	0,08
22 847	USD	Tradeweb Markets	1 832 329	0,38
2 490	USD	Trane Technologies	505 246	0,10
5 779	USD	Uber Technologies	265 776	0,05
2 750	USD	United States Steel	89 320	0,02
2 417	USD	United Therapeutics	545 928	0,11
1 778	USD	UnitedHealth Group	896 450	0,19
9 235	USD	Valaris	692 440	0,14
502	USD	Valero Energy	71 138	0,01
28	USD	Vaxcyte	1 427	-
1 902	USD	Veeva Systems	386 962	0,08
3 847	USD	Veracyte	85 904	0,02
674	USD	Verisk Analytics	159 226	0,03
1 706	USD	Vertex Pharmaceuticals	593 244	0,12
67	USD	Vicor	3 946	-
41 350	USD	Viper Energy Partners	1 152 838	0,24
706	USD	Visa	162 387	0,03
5 488	USD	Vistra	182 092	0,04
1 498	USD	Waste Connections	201 181	0,04
1 205	USD	Waters	330 423	0,07
16 534	USD	Wells Fargo	675 579	0,14
4 635	USD	Welltower	379 699	0,08
5 127	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	544 846	0,11
7 854	USD	Williams	264 601	0,05
102 044	USD	WisdomTree	714 308	0,15
2 196	USD	Workday	471 811	0,10
9 208	USD	WW International	101 933	0,02
2 866	USD	Zoetis	498 627	0,10
2 417	USD	Zoom Video Communications	169 045	0,03
<b>Summe Aktien</b>			<b>168 653 297</b>	<b>34,87</b>
<b>Anleihen</b>				
<b>Österreich</b>			<b>775 033</b>	<b>0,16</b>
1 000 000	EUR	UNIQA Insurance Group 09/12/41, variabel	775 033	0,16
<b>Frankreich</b>			<b>540 077</b>	<b>0,11</b>
300 000	EUR	Orange perpetual, variabel	313 057	0,06
214 190	EUR	Vallourec 30/06/26, 8.50%	227 020	0,05

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Deutschland</b>			<b>3 224 422</b>	<b>0,67</b>
1 200 000	EUR	Allianz 07/09/38, variabel	1 230 110	0,25
400 000	EUR	Allianz 06/07/47, variabel	396 767	0,08
1 500 000	EUR	Allianz 25/07/53, variabel	1 597 545	0,34
<b>Hongkong</b>			<b>1 223 941</b>	<b>0,25</b>
620 000	USD	Melco Resorts Finance 21/07/28, 5.75%	543 864	0,11
825 000	USD	Melco Resorts Finance 04/12/29, 5.38%	680 077	0,14
<b>Mexiko</b>			<b>12 029 713</b>	<b>2,49</b>
2 420 835 400	MXN	Mexico Cetes 23/01/25, ZCP	12 029 713	2,49
<b>Niederlande</b>			<b>617 873</b>	<b>0,13</b>
600 000	EUR	NN Group 03/11/43, variabel	617 873	0,13
<b>Peru</b>			<b>3 574 577</b>	<b>0,74</b>
13 670 000	PEN	Peru Government Bond 12/08/31, 6.95%	3 574 577	0,74
<b>Südkorea</b>			<b>200 302</b>	<b>0,04</b>
200 000	USD	Korea Development Bank 09/03/24, variabel	200 302	0,04
<b>Supranational</b>			<b>1 370 438</b>	<b>0,28</b>
127 500 000	ZAR	Asian Development Bank 30/04/40, ZCP	1 131 986	0,23
13 000 000	TRY	European Bank for Reconstruction & Development 15/10/26, ZCP	192 356	0,04
3 800 000	TRY	International Finance 09/05/27, ZCP	46 096	0,01
<b>USA</b>			<b>821 586</b>	<b>0,17</b>
500 000	USD	United States Treasury Note 31/10/23, variabel	500 018	0,10
504 000	USD	Williams 15/10/51, 3.50%	321 568	0,07
<b>Summe Anleihen</b>			<b>24 377 962</b>	<b>5,04</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind</b>			<b>193 031 259</b>	<b>39,91</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
<b>Anleihen</b>				
<b>Kanada</b>			<b>5 572 007</b>	<b>1,16</b>
1 500 000	CAD	Ontario Treasury Bill 18/10/23, ZCP	1 101 859	0,23
1 750 000	CAD	Ontario Treasury Bill 31/01/24, ZCP	1 269 429	0,26

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

# Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermög- en
1 000 000	CAD	Province of British Columbia Canada 04/10/23, ZCP	735 885	0,15
860 000	CAD	Quebec Treasury Bill 20/10/23, ZCP	631 617	0,13
2 500 000	CAD	Saskatchewan Canada Coupon Strip 02/11/23, ZCP	1 833 217	0,39
<b>Italien</b>			<b>1 035 199</b>	<b>0,21</b>
245 000	USD	Telecom Italia Capital 15/11/33, 6.38%	212 687	0,04
434 000	USD	Telecom Italia Capital 18/07/36, 7.20%	386 551	0,08
476 000	USD	Telecom Italia Capital 04/06/38, 7.72%	435 961	0,09
<b>Macau</b>			<b>1 899 763</b>	<b>0,39</b>
1 805 000	USD	Wynn Macau 07/03/29, 4.50%	1 899 763	0,39
<b>Südkorea</b>			<b>498 039</b>	<b>0,10</b>
500 000	USD	Korea Development Bank 27/10/23, ZCP	498 039	0,10
<b>USA</b>			<b>251 921 587</b>	<b>52,10</b>
905 000	USD	Arsenal AIC Parent 01/10/30, 8.00%	901 624	0,19
255 000	USD	Diamond Foreign Asset 01/10/30, 8.50%	255 279	0,05
1 117 000	USD	Fluor 15/08/29, 1.13%	1 158 608	0,24
1 280 000	USD	Frontier Communications Holdings 15/05/30, 8.75%	1 216 672	0,26
850 000	USD	Ionis Pharmaceuticals 15/06/28, 1.75%	896 325	0,19
1 050 000	USD	Owens-Brockway Glass Container 15/05/31, 7.25%	1 027 688	0,21
980 000	USD	Spirit Loyalty Cayman 20/09/25, 8.00%	980 380	0,20
400 000	USD	Tidewater 03/07/28, 10.38%	414 750	0,09
465 500	USD	Transocean 15/02/30, 8.75%	476 388	0,10
19 945 000	USD	United States Treasury Bill 03/10/23, ZCP	19 936 236	4,12
4 505 000	USD	United States Treasury Bill 05/10/23, ZCP	4 501 207	0,93
35 505 000	USD	United States Treasury Bill 10/10/23, ZCP	35 451 622	7,33
13 490 000	USD	United States Treasury Bill 12/10/23, ZCP	13 466 482	2,78
17 565 000	USD	United States Treasury Bill 17/10/23, ZCP	17 519 756	3,62
29 491 000	USD	United States Treasury Bill 19/10/23, ZCP	29 409 041	6,08
9 295 000	USD	United States Treasury Bill 24/10/23, ZCP	9 262 268	1,92

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermög- en
18 775 000	USD	United States Treasury Bill 26/10/23, ZCP	18 703 469	3,87
10 370 000	USD	United States Treasury Bill 31/10/23, ZCP	10 322 861	2,13
2 320 000	USD	United States Treasury Bill 02/11/23, ZCP	2 308 819	0,48
14 710 000	USD	United States Treasury Bill 07/11/23, ZCP	14 627 915	3,02
6 525 000	USD	United States Treasury Bill 09/11/23, ZCP	6 486 754	1,34
3 955 000	USD	United States Treasury Bill 14/11/23, ZCP	3 928 881	0,81
985 000	USD	United States Treasury Bill 16/11/23, ZCP	978 207	0,20
11 975 000	USD	United States Treasury Bill 21/11/23, ZCP	11 883 071	2,46
4 390 000	USD	United States Treasury Bill 24/11/23, ZCP	4 354 473	0,90
18 415 000	USD	United States Treasury Bill 28/11/23, ZCP	18 262 319	3,78
165 000	USD	United States Treasury Bill 30/11/23, ZCP	163 560	0,03
10 315 000	USD	United States Treasury Bill 07/12/23, ZCP	10 211 773	2,11
9 980 000	USD	United States Treasury Bill 21/12/23, ZCP	9 859 156	2,04
250 000	USD	United States Treasury Bill 18/01/24, ZCP	245 967	0,05
1 875 000	USD	Viking Cruises 15/07/31, 9.13%	1 880 996	0,40
915 000	USD	Viking Ocean Cruises Ship VII 15/02/29, 5.63%	829 040	0,17
<b>Summe Anleihen</b>			<b>260 926 595</b>	<b>53,96</b>
<b>Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden</b>			<b>260 926 595</b>	<b>53,96</b>

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermög- ens
<b>Anleihen</b>				
<b>Schweiz</b>				
1 867 000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7.25%	-	-
200 000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7.50%	-	-
325 000	USD	Credit Suisse Group perpetual*, 7.50%	-	-
<b>Summe Anleihen</b>			<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Summe sonstige Wertpapiere</b>			<b>-</b>	<b>-</b>
<b>Summe Kapitalanlagen</b>			<b>453 957 854</b>	<b>93,87</b>
<b>Sonstiges Nettovermögen</b>			<b>29 648 305</b>	<b>6,13</b>
<b>Nettoinventarwert</b>			<b>483 606 159</b>	<b>100,00</b>

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023

## Die Gesellschaft

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft in der Rechtsform einer «Société Anonyme», die nach den Gesetzen des Grossherzogtums Luxemburg gegründet wurde und bei der es sich um eine Société d'Investissement à Capital Variable («SICAV») handelt. Das ausschliessliche Ziel der Gesellschaft besteht darin, die ihr zur Verfügung stehenden Mittel in übertragbaren Wertpapieren und anderen zulässigen Vermögenswerten jeder Art, einschliesslich derivativer Finanzinstrumente, anzulegen, um das Investitionsrisiko zu streuen und die Erträge aus ihrem Portfoliomanagement an ihre Anteilhaber weiterzugeben.

Die Anlagestrategie der einzelnen Teilfonds beruht auf einer alternativen Anlagestrategie, die von den jeweiligen Anlageverwaltern entwickelt wurde und derzeit von ihnen verwaltet wird.

## Anteilklassen

Anteile werden grundsätzlich als thesaurierende Anteile ausgegeben. Ausschüttende Anteile innerhalb eines Teilfonds werden nur nach dem Ermessen des Verwaltungsrats ausgegeben. Anleger können sich bei der Verwaltungsgesellschaft oder bei ihrer Vertriebsstelle erkundigen, ob innerhalb der Anteilklassen und Teilfonds ausschüttende Anteile erhältlich sind.

Der Verwaltungsrat kann beschliessen, in jedem Teilfonds verschiedene Anteilklassen einzuführen, deren Vermögenswerte in Übereinstimmung mit der besonderen Anlagepolitik des jeweiligen Teilfonds gemeinsam investiert werden, die sich aber durch besondere Gebührenstrukturen, Referenzwährungen oder sonstige spezielle Merkmale von den anderen Anteilklassen unterscheiden können. Für jede Anteilklasse wird ein eigener Nettoinventarwert je Anteil berechnet, der aufgrund dieser variablen Faktoren unterschiedlich ausfallen kann. Die für den jeweiligen Teilfonds verfügbaren Anteilklassen werden im aktuellen Verkaufsprospekt genauer aufgeführt.

Die Anteilklasse E ist nicht über das weltweite Vertriebsstellennetz von Schroders verfügbar. Wenden Sie sich bei diesbezüglichen Fragen bitte an die Verwaltungsgesellschaft.

## Ausgabeaufschlag

Die Verwaltungsgesellschaft und die Vertriebsstellen haben Anspruch auf einen Ausgabeaufschlag, der nach Ermessen des Verwaltungsrats ganz oder teilweise erlassen werden kann.

Anteilklassen	Ausgabeaufschlag
A <sup>1</sup> -, A2- und K-Anteile	Bis zu 3,09278% des Nettoinventarwerts je Anteil
A1-Anteile	Bis zu 2,04081% des Nettoinventarwerts je Anteil
C-, C1-, E- und F-Anteile	Bis zu 1,01010% des Nettoinventarwerts je Anteil
I-, IF-, IZ-, N-, PI-, R-, R1-, R2-, R3-, R4-, R5-, S-, X-, Y-, Y1- und Y2-Anteile	Kein Ausgabeaufschlag

<sup>1</sup> Der Ausgabeaufschlag für den Schroder GAIA Cat Bond Anteilklasse A beträgt bis zu 1,01010% des Nettoinventarwerts je Anteil.

## Vertriebsgebühr

Zum Zeitpunkt dieses Berichts fällt für alle Anteile der Klasse A1 von Schroder GAIA eine Vertriebsgebühr von 0,50% an. Für andere für Investitionen verfügbare Anteilklassen der Gesellschaft gilt keine weitere Vertriebsgebühr.

## Swing-Pricing

Der Nettoinventarwert je Anteil eines Teilfonds kann verwässert werden, wenn Anleger Anteile eines Teilfonds zu einem Kurs kaufen oder verkaufen, der die Handels- und sonstigen Kosten im Zusammenhang mit vom Anlageverwalter zur Berücksichtigung von Mittelzu- oder -abflüssen vorgenommenen Wertpapiertransaktionen nicht berücksichtigt. Um diesen Auswirkungen entgegenzuwirken, kann ein Swing-Pricing-Mechanismus angewandt werden, um die Interessen der Anteilhaber des Teilfonds zu schützen. Wenn an einem Bewertungstag die kumulierten Nettotransaktionen mit Anteilen eines Teilfonds einen zuvor festgelegten Schwellenwert, der von der Verwaltungsgesellschaft für jeden Teilfonds bestimmt und in regelmässigen Abständen überprüft wird, überschreiten, kann der Nettoinventarwert je Anteil nach oben oder unten hin angepasst werden, um die Nettomittelzuflüsse beziehungsweise -abflüsse zu berücksichtigen.

Die Nettomittelzuflüsse werden von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der letzten verfügbaren Informationen zum Zeitpunkt der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil bestimmt. Das Ausmass der Preisanpassung wird von der Verwaltungsgesellschaft auf eine Weise bestimmt, die Handels- und sonstige Kosten angemessen wiedergibt. Derartige Anpassungen können von Teilfonds zu Teilfonds unterschiedlich ausfallen und betragen maximal 2% des ursprünglichen Nettoinventarwerts je Anteil.

Der Mechanismus wurde für die Schroder GAIA-Teilfonds seit ihrer Auflegung angewandt.

Am 30. September 2023, dem letzten Berechnungstag des Berichtsjahrs, wurden für keinen der Teilfonds Swing-Pricing-Anpassungen vorgenommen.

## Mindestanlage bei Erstzeichnung, Mindestanlage bei weiteren Zeichnungen und Mindestanlagebestand

Teilfonds	Anteilklassen	Mindestanlage bei Erstzeichnung		Mindestanlage bei Folgezeichnungen		Mindestanlage- bestand	
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	A- und C-Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000
	I-Anteile	USD	5 000 000	USD	2 500 000	USD	5 000 000
	IZ-Anteile	USD	100 000 000	USD	20 000 000	USD	100 000 000
Schroder GAIA BlueTrend	A-, C-, E- und N-Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000
Schroder GAIA Cat Bond	A-, C-, F- und PI-Anteile	USD	100 000	USD	50 000	USD	100 000
	I-Anteile	USD	5 000 000	USD	2 500 000	USD	5 000 000
	IF-Anteile	USD	1 000 000	USD	500 000	USD	1 000 000
	Y-, Y1- und Y2*-Anteile	USD	100 000 000	USD	2 500 000	USD	100 000 000

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahrs vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Mindestanlage bei Erstzeichnung, Mindestanlage bei weiteren Zeichnungen und Mindestanlagebestand (Forts.)

Teilfonds	Anteilklassen	Mindestanlage bei Erstzeichnung		Mindestanlage bei Folgezeichnungen		Mindestanlage- bestand	
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A-, A1-, C- und E-Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000
Schroder GAIA Egerton Equity	A-, A1-, C- und E-Anteile	EUR	10 000	EUR	5 000	EUR	10 000
	X-Anteile	EUR	100 000 000	EUR	2 500 000	EUR	100 000 000
Schroder GAIA Helix	A-, C-, C1-, E- und S-Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000
	I-Anteile	USD	5 000 000	USD	2 500 000	USD	5 000 000
	IZ-Anteile	USD	100 000 000	USD	20 000 000	USD	100 000 000
	X-Anteile	USD	100 000 000	USD	2 500 000	USD	100 000 000
Schroder GAIA Oaktree Credit	A2-, C- und E-Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000
	I-Anteile	USD	5 000 000	USD	2 500 000	USD	5 000 000
Schroder GAIA SEG US Equity*	C-, K- und R4-Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000
	IZ-Anteile	USD	100 000 000	USD	20 000 000	USD	100 000 000
	R1-Anteile	USD	10 000	USD	5 000		Entfällt
	R2- und R5-Anteile	USD	10 000 000		Entfällt	USD	10 000 000
	R3-Anteile	USD	500 000		Entfällt		Entfällt
Schroder GAIA Sirius US Equity	A-, C- und E-Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000
	X-Anteile	USD	100 000 000	USD	2 500 000	USD	100 000 000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C- und K-Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A-, C-, C1- und E-Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000

## Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden

Der Abschluss wird im Einklang mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen für Investmentfonds auf der Grundlage der Unternehmensfortführung aufgestellt und dargestellt. Teilfonds, die während des Jahres aufgelöst wurden, werden nach dem Nicht-Fortführungsprinzip ausgewiesen.

Zum Bilanzstichtag betrug der verwahrte Barbetrag für den aufgelösten Teilfonds Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return\* 1.994 GBP.

## Nettoinventarwert

### Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil

Der Nettoinventarwert je Anteil wird für jede Anteilsklasse am Berechnungstag in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse berechnet. Bei der Berechnung wird der der jeweiligen Anteilsklasse zuzurechnende Nettoinventarwert, der dem anteiligen Wert ihrer Vermögenswerte abzüglich ihrer Verbindlichkeiten entspricht, durch die Anzahl der ausgegebenen Anteile dieser Anteilsklasse dividiert. Die sich daraus ergebende Summe wird auf die nächsten bis zu vier Dezimalstellen gerundet. Weitere Details zu den Regeln für die Bewertung des Gesamtvermögens befinden sich im aktuellen Verkaufsprospekt.

Der Abschluss wird auf der Grundlage des letzten während des Geschäftsjahres berechneten NIW (29. September 2023 für alle Teilfonds) erstellt und in Übereinstimmung mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen für Investmentfonds dargestellt.

### Bewertung des Vermögens der Gesellschaft

Der Wert von Kassen- oder Einlagenbeständen, Wechseln, Sichtwechseln und Forderungen, transitorischen Aktiva sowie Bardividenden und Zinsen, die wie oben erwähnt, fällig oder aufgelaufen, jedoch noch nicht eingegangen sind, wird in voller Höhe berücksichtigt, es sei denn, es ist im jeweiligen Fall unwahrscheinlich, dass der Betrag in voller Höhe gezahlt wird oder eingeht. In diesem Fall ist der Wert nach einem von der Gesellschaft für angemessen gehaltenen Abzug zu ermitteln.

Der Wert von Wertpapieren, derivativen Finanzinstrumenten und Vermögenswerten wird an dem jeweiligen Geschäftstag auf Basis der Schlusskurse an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt ermittelt, an der bzw. an dem diese Wertpapiere oder Vermögenswerte gehandelt werden oder zum Handel zugelassen sind. Bei Wertpapieren, die nicht an einer amtlichen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden oder zum Handel zugelassen sind, oder bei Wertpapieren, die zwar gehandelt werden oder zum Handel zugelassen sind, deren letzter verfügbarer Kurs aber nicht ihren tatsächlichen Wert widerspiegelt, muss der Verwaltungsrat den erwarteten Verkaufspreis zugrunde legen, der mit der gebotenen Sorgfalt und in gutem Glauben anzusetzen ist.

Derivative Finanzinstrumente, die nicht an einer amtlichen Börse notiert sind oder an einem anderen organisierten Markt gehandelt werden, müssen täglich einer zuverlässigen und überprüfbaren Bewertung unterzogen werden und können jederzeit auf Initiative der Gesellschaft zum beizulegenden Zeitwert veräußert, abgewickelt oder durch ein Gegengeschäft glattgestellt werden.

Sollte einer der vorstehend beschriebenen Bewertungsgrundsätze nicht der an spezifischen Märkten üblicherweise angewendeten Bewertungsmethode entsprechen oder erscheint einer dieser Bewertungsgrundsätze aufgrund der Ungenauigkeit der Bewertung zur Ermittlung des Werts des Gesellschaftsvermögens ungeeignet, kann der Verwaltungsrat nach Treu und Glauben und gemäss den allgemein anerkannten Bewertungsgrundsätzen und -verfahren andere Bewertungsgrundsätze festlegen.

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Nettoinventarwert (Forts.)

Anteile an offenen OGA werden auf der Grundlage ihres von diesen OGA zuletzt gemeldeten Nettoinventarwerts bewertet.

Der Gesamtabchluss wird in EUR, der Währung der Gesellschaft, aufgestellt, und die Abschlüsse der Teilfonds werden in der jeweiligen Basiswährung aufgestellt. Für die Umrechnung von anderen Währungen als dem EUR in der Nettovermögensaufstellung, der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in EUR werden die zum Jahresende geltenden Wechselkurse verwendet.

## Fair Value Pricing

Der Verwaltungsrat behält sich das Recht vor, Fair Value Pricing immer dann anzuwenden, wenn er dies für angebracht hält.

Zum 30. September 2023 wurde die Fair-Value-Anpassung auf die folgenden Wertpapiere angewandt:

Teilfonds	Wertpapiername
Schroder GAIA Cat Bond	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP
Schroder GAIA Helix	CFD auf MAGNIT PJSC CFD auf TRINITY LIMITED
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Clementia Pharmaceuticals

## Besteuerung

Die Gesellschaft unterliegt in Luxemburg keinen Steuern auf Einkommen oder Kapitalerträge.

Die einzige Steuer, die die Gesellschaft abführen muss, ist die «Taxe d'abonnement» zum Satz von 0,05% per annum des Nettoinventarwerts der einzelnen Teilfonds am Ende des jeweiligen Quartals. Sie wird vierteljährlich berechnet und fällig.

Auf Anteilsklassen oder Teilfonds, die ausschliesslich institutionellen Anlegern (im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 in der jeweils gültigen Fassung) vorbehalten sind, wird eine Steuer zum Satz von 0,01% per annum erhoben.

Von der Gesellschaft vereinnahmte Zins- und Dividendenenerträge unterliegen gegebenenfalls einer nicht erstattungsfähigen Quellensteuer in den Herkunftsländern. Des Weiteren muss die Gesellschaft möglicherweise Steuern auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge auf ihre Vermögenswerte im Ursprungsland zahlen, und entsprechende Rückstellungen werden in bestimmten Ländern möglicherweise anerkannt.

## Managementgebühren

Die Anlageverwalter haben Anspruch auf Managementgebühren für ihre Dienste, die auf der Grundlage der Nettoinventarwerte der Teilfonds täglich berechnet und verbucht sowie monatlich gezahlt werden. Die für das Berichtsjahr tatsächlich anfallenden Gebühren sind in der folgenden Tabelle dargestellt:

Teilfonds	Anteilsklasse	Managementgebühren
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	A-Anteile	2,00%
	C- und IZ-Anteile	1,25%
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA BlueTrend	A-Anteile	1,60%
	C-, E- und N-Anteile	1,00%
Schroder GAIA Cat Bond	A- und F-Anteile	1,50%
	C- und IF-Anteile	1,10%
	PI-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,10% (0,46%)
	Y-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,10% (0,88%)
	Y1-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,50% (1,28%)
	Y2*-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,10% (0,24%)
Schroder GAIA Contour Tech Equity	I-Anteile	Entfällt
	A- und A1-Anteile	2,00%
	C-Anteile	1,25%
Schroder GAIA Egerton Equity	E-Anteile	1,00%
	A- und A1-Anteile	2,00%
	C- und E-Anteile	1,25%
Schroder GAIA Helix	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25% (1,25%)
	A-Anteile	2,00%
Schroder GAIA Oaktree Credit	C-, C1- und IZ-Anteile	1,00%
	E-Anteile	0,75%
	S-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00% (0,35%)
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00% (0,60%)
	I-Anteile	Entfällt
	A2-Anteile	1,25%
Schroder GAIA Oaktree Credit	C-Anteile	0,75%
	E-Anteile	0,60%
	I-Anteile	Entfällt

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Managementgebühren (Forts.)

Teilfonds	Anteilsklasse	Managementgebühren
S Schroder GAIA SEG US Equity*	C- und R3-Anteile	1,40%
	IZ-, R2- und R5-Anteile	1,15%
	K-Anteile	1,90%
	R1-Anteile	1,75%
	R4-Anteile	2,30%
S Schroder GAIA Sirius US Equity	A-Anteile	2,00%
	C-Anteile	1,25%
	E-Anteile	1,00%
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25% (1,25%)
S Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund*	C- und R-Anteile	0,75%
	K-Anteile	1,25%
	I-Anteile	Entfällt
S Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C-Anteile	1,40%
	K-Anteile	1,90%
S Schroder GAIA Wellington Pagosa	A-Anteile	2,00%
	C- und C1-Anteile	1,25%
	E-Anteile	0,75%

Diese Gebühren können von der Verwaltungsgesellschaft nach freiem Ermessen teilweise erlassen werden.

## Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 20.167 EUR. Bernard Herman und Eric Bertrand erhielten für das Berichtsjahr jeweils eine Vergütung in Höhe von 17.646 EUR. Hugh Mullan erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 16.000 EUR. Die verbleibenden Verwaltungsratsmitglieder verzichteten auf ihr Honorar.

## Performancegebühren

Die Performancegebühr wird dann fällig, wenn der Fonds eine sog. Outperformance erzielt, d. h. dass die Zunahme des Nettoinventarwerts pro Anteil während des entsprechenden Wertentwicklungsjahres die High-Water-Mark übersteigt. Als Referenz gilt der jemals am Ende eines vorhergehenden Wertentwicklungsjahres verzeichnete Nettoinventarwert pro Anteil (die «High-Water-Mark»).

Die Performancegebühr einer Anteilsklasse läuft an jedem Geschäftstag auf und wird am nächstfolgenden Berechnungstag in den Nettoinventarwerten der Teilfonds berücksichtigt, und zwar auf Grundlage der Differenz zwischen dem Nettoinventarwert je Anteil am gleichen Berechnungstag (vor Abzug etwaiger Rückstellungen für die Performancegebühr) und der Hurdle, multipliziert mit der durchschnittlichen Zahl der während des Geschäftsjahres ausgegebenen Anteile oder im Falle einer auf der Outperformance gegenüber der Benchmark basierenden Performancegebühr mit dem angestrebten Nettoinventarwert je Anteil (d. h. dem hypothetischen Nettoinventarwert je Anteil, der unter Zugrundelegung der Wertentwicklung der Benchmark bis zum Geschäftstag erzielt worden wäre) oder, sofern höher, anhand der High-Water-Mark multipliziert mit der durchschnittlichen Anzahl der während des Geschäftsjahres umlaufenden Anteile. Für I-Anteile wird keine Performancegebühr berechnet.

Nähere Einzelheiten zur Berechnung der während des Berichtsjahres angefallenen Performancegebühren sind in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt. Weitere Angaben zur Berechnung der Performancegebühren sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Die für das Jahr zahlbaren Gebühren sind in der Nettovermögensaufstellung unter «Fällige Performancegebühren» ausgewiesen. Die für die einzelnen Anteilsklassen während des Berichtsjahres in Rechnung gestellten Performancegebühren sind auf den Seiten 143-144 aufgeführt.

Teilfonds	Anlageverwalter	Benchmark
S Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	Schroder Investment Management (Singapore) Ltd.	
S Schroder GAIA BlueTrend	Systematica Investments Limited	
S Schroder GAIA BlueTrend, in BRL abgesichert	Systematica Investments Limited	
S Schroder GAIA BlueTrend, in CHF abgesichert	Systematica Investments Limited	
S Schroder GAIA BlueTrend, in EUR abgesichert	Systematica Investments Limited	
S Schroder GAIA BlueTrend, in GBP abgesichert	Systematica Investments Limited	
S Schroder GAIA BlueTrend, in SEK abgesichert	Systematica Investments Limited	
S Schroder GAIA Cat Bond	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
S Schroder GAIA Cat Bond, in CHF abgesichert	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
S Schroder GAIA Cat Bond, in EUR abgesichert	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
S Schroder GAIA Cat Bond, in GBP abgesichert	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
S Schroder GAIA Cat Bond, in JPY abgesichert	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
S Schroder GAIA Cat Bond, in SEK abgesichert	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
S Schroder GAIA Cat Bond, in SGD abgesichert	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
S Schroder GAIA Contour Tech Equity	Contour Asset Management, LLC	
S Schroder GAIA Contour Tech Equity, in CHF abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
S Schroder GAIA Contour Tech Equity, in EUR abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
S Schroder GAIA Contour Tech Equity, in GBP abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
S Schroder GAIA Contour Tech Equity, in SEK abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
S Schroder GAIA Contour Tech Equity, in SGD abgesichert	Contour Asset Management, LLC	

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Performancegebühren (Forts.)

Teilfonds	Anlageverwalter	Benchmark
Schroder GAIA Egerton Equity	Egerton Capital (UK) LLP	Euro Short-Term Rate (ESTR) + 1,00%
Schroder GAIA Egerton Equity, in GBP abgesichert	Egerton Capital (UK) LLP	Euro Short-Term Rate (ESTR) + 1,00%
Schroder GAIA Egerton Equity, in USD abgesichert	Egerton Capital (UK) LLP	Euro Short-Term Rate (ESTR) + 1,00%
Schroder GAIA Helix	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Helix, in CHF abgesichert	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Helix, in EUR abgesichert	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Helix, in GBP abgesichert	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Helix, in JPY abgesichert	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Helix, in SEK abgesichert	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Helix, in SGD abgesichert	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA SEG US Equity*	Select Equity Group LP	
Schroder GAIA SEG US Equity, in CHF abgesichert*	Select Equity Group LP	
Schroder GAIA SEG US Equity, in EUR abgesichert*	Select Equity Group LP	
Schroder GAIA SEG US Equity, in GBP abgesichert*	Select Equity Group LP	
Schroder GAIA Sirios US Equity	Sirios Capital Management LP	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Sirios US Equity, in CHF abgesichert	Sirios Capital Management LP	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Sirios US Equity, in EUR abgesichert	Sirios Capital Management LP	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Sirios US Equity, in GBP abgesichert	Sirios Capital Management LP	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund*	Tellworth Investments LLP**	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund, in CHF abgesichert*	Tellworth Investments LLP**	
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund, in EUR abgesichert*	Tellworth Investments LLP**	
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund, in USD abgesichert*	Tellworth Investments LLP**	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified, in CHF abgesichert	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified, in EUR abgesichert	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified, in GBP abgesichert	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Wellington Pagosa, in BRL abgesichert	Wellington Management International Limited	Brazil CETIP DI Interbank Deposit Rate
Schroder GAIA Wellington Pagosa, in CHF abgesichert	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Wellington Pagosa, in EUR abgesichert	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Wellington Pagosa, in GBP abgesichert	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Wellington Pagosa, in SGD abgesichert	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)

Für den Schroder GAIA Asian Equity Long Short\*, den Schroder GAIA Contour Tech Equity, den Schroder GAIA Egerton Equity, den Schroder GAIA SEG US Equity\*, den Schroder GAIA Two Sigma Diversified und den Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund\* beträgt die Performancegebühr 20% der Outperformance.

Für Schroder GAIA Helix, Schroder GAIA Sirios US Equity und Schroder GAIA Wellington Pagosa beträgt die Performancegebühr 20% der Outperformance (mit Ausnahme von E-Anteilen, für die sich die Gebühr auf 15% der Outperformance beläuft).

Für Schroder GAIA BlueTrend beträgt die Performancegebühr 10% der Outperformance.

Für Schroder GAIA Cat Bond und Schroder GAIA Oaktree Credit werden keine Performancegebühren erhoben (mit Ausnahme der Anteile am Schroder GAIA Cat Bond PI mit einem Satz von 10% der Outperformance).

## Gebühren der Verwahrstelle und der Verwaltungsstelle

Die Depotbank und der Fondsverwalter haben Anspruch auf Gebühren für diesbezügliche im Einklang mit der in Luxemburg üblichen Praxis erbrachte Leistungen, die monatlich aus dem Nettovermögen des Fonds zu zahlen sind.

## Wiederanlage von Barsicherheiten

Zur Reduzierung von Kontrahentenrisiken zahlen oder erhalten Teilfonds mit Währungsabsicherungstransaktionen, die sich auf abgesicherte Anteilsklassen beziehen, auf täglicher Basis Barsicherheiten an den Kontrahenten bzw. vom Kontrahenten, wodurch das Risiko über die Dauer des Terminkontrakts reduziert wird.

Anlageverwalter können die von ihren Kontrahenten im Zusammenhang mit Währungsabsicherungsgeschäften erhaltenen Barsicherheiten erneut investieren.

Bei Fälligkeit der Terminkontrakte zu erhaltende oder zu zahlende Sicherheiten sind in der Nettovermögensaufstellung als «Zu erhaltende/zahlende Nettosicherheiten auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung» ausgewiesen. Forderungen nach zu erhaltenden oder zu zahlenden Sicherheiten sind in der Nettovermögensaufstellung als «Zu erhaltende/zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung» ausgewiesen.

## Devisenterminkontrakte

Offene Devisenterminkontrakte sind mit Bezug auf den Devisenterminkurs, der sich auf das Fälligkeitsdatum des betreffenden Kontrakts bezieht, zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter «Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Devisenterminkontrakten» aufgeführt.

Am 30. September 2023 waren die folgenden Teilfonds in Devisenterminkontrakten engagiert:

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

\*\* Der Anlageverwalter des Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund\* wurde mit Wirkung zum 5. Dezember 2022 von BennBridge Ltd. zu Tellworth Investments LLP geändert.



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
<b>Schroder GAIA Asian Equity Long Short*</b>						
Absicherung des Portfolios						
AUD	2 413 000	USD	1 616 651	17. Okt. 2023	(64 417)	
GBP	620 000	USD	797 444	17. Okt. 2023	(40 918)	
NZD	260 000	USD	161 640	17. Okt. 2023	(5 809)	
SGD	1 267 000	USD	947 037	17. Okt. 2023	(19 611)	
USD	57 688	AUD	86 000	17. Okt. 2023	2 366	
USD	114 371	SGD	153 000	17. Okt. 2023	2 378	
					<b>USD</b>	<b>(126 011)</b>
<b>Schroder GAIA BlueTrend</b>						
Absicherung des Portfolios						
AUD	55 800 000	USD	35 921 816	18. Okt. 2023	(25 428)	
AUD	2 005 000	USD	1 288 128	25. Okt. 2023	2 044	
BRL	4 930 608	USD	980 018	25. Okt. 2023	(2 282)	
BRL	4 930 608	USD	1 008 980	22. Nov. 2023	(34 673)	
BRL	187 298 489	USD	37 622 045	20. Dez. 2023	(726 042)	
CAD	90 601 901	USD	67 179 547	18. Okt. 2023	(460 374)	
CAD	3 880 000	USD	2 884 559	25. Okt. 2023	(27 044)	
CHF	18 676 886	USD	20 914 584	18. Okt. 2023	(477 470)	
CLP	3 637 878 166	USD	4 045 927	20. Dez. 2023	22 878	
CNH	21 916 061	USD	3 000 813	10. Okt. 2023	3 032	
CNH	147 421 526	USD	20 209 290	18. Okt. 2023	2 768	
EUR	39 200 000	USD	41 863 093	18. Okt. 2023	(392 889)	
EUR	4 660 000	USD	4 940 766	25. Okt. 2023	(9 402)	
GBP	17 900 000	USD	22 210 186	18. Okt. 2023	(368 370)	
GBP	565 000	USD	685 911	25. Okt. 2023	3 540	
HKD	5 475 000	USD	700 223	25. Okt. 2023	(718)	
HUF	3 793 154 828	USD	10 512 665	18. Okt. 2023	(243 911)	
IDR	110 614 063 072	USD	7 182 369	20. Dez. 2023	(26 542)	
ILS	52 138 096	USD	13 659 311	18. Okt. 2023	19 808	
INR	2 173 828 577	USD	26 131 060	20. Dez. 2023	(48 221)	
JPY	3 096 468 334	USD	21 039 124	18. Okt. 2023	(264 463)	
JPY	76 965 000	USD	517 538	25. Okt. 2023	(490)	
KRW	38 339 566 302	USD	28 942 831	20. Dez. 2023	(396 402)	
MXN	524 985 389	USD	30 242 235	18. Okt. 2023	(195 405)	
MXN	10 875 000	USD	621 308	25. Okt. 2023	331	
MXN	29 387 252	USD	1 719 178	20. Dez. 2023	(55 436)	
NOK	252 831 229	USD	23 546 771	18. Okt. 2023	99 808	
NZD	43 000 000	USD	25 513 478	18. Okt. 2023	258 604	
PHP	377 054 754	USD	6 639 763	20. Dez. 2023	24 278	
PLN	38 082 789	USD	8 801 226	18. Okt. 2023	(87 443)	
SEK	290 762 405	USD	26 116 994	18. Okt. 2023	512 267	
SEK	8 440 000	USD	776 115	25. Okt. 2023	(2 914)	
SGD	27 668 089	USD	20 285 524	18. Okt. 2023	(31 943)	
THB	522 758 389	USD	14 506 077	18. Okt. 2023	(131 063)	
TWD	772 103 965	USD	24 311 656	20. Dez. 2023	(153 587)	
USD	72 510 912	AUD	113 300 000	18. Okt. 2023	(375 479)	
USD	2 944 107	AUD	4 580 000	25. Okt. 2023	(3 020)	
USD	1 012 300	BRL	4 930 608	25. Okt. 2023	34 564	
USD	26 828 996	BRL	134 810 127	20. Dez. 2023	272 697	
USD	96 812 843	CAD	131 627 307	18. Okt. 2023	(117 411)	

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
<b>Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)</b>						
USD	2 581 958	CAD	3 475 000	25. Okt. 2023	22 714	
USD	36 558 871	CHF	32 765 875	18. Okt. 2023	704 932	
USD	195 579	CHF	175 000	25. Okt. 2023	3 936	
USD	13 345 213	CLP	11 951 467 812	20. Dez. 2023	(21 974)	
USD	2 544 675	CNH	18 598 468	10. Okt. 2023	(4 456)	
USD	34 403 668	CNH	250 619 471	18. Okt. 2023	42 770	
USD	10 021	CZK	230 000	25. Okt. 2023	62	
USD	79 358 832	EUR	74 000 000	18. Okt. 2023	1 073 245	
USD	11 210 371	EUR	10 535 000	25. Okt. 2023	61 892	
USD	37 248 098	GBP	30 100 000	18. Okt. 2023	519 686	
USD	1 808 700	GBP	1 480 000	25. Okt. 2023	2 704	
USD	1 949 640	HKD	15 240 000	25. Okt. 2023	2 525	
USD	8 202 775	HUF	2 992 813 561	18. Okt. 2023	100 690	
USD	5 743	HUF	2 125 000	25. Okt. 2023	(2)	
USD	21 664 174	IDR	333 227 157 701	20. Dez. 2023	107 095	
USD	40 669 273	ILS	155 615 198	18. Okt. 2023	(158 438)	
USD	45 066 044	INR	3 752 545 541	20. Dez. 2023	40 856	
USD	56 453 342	JPY	8 284 130 483	18. Okt. 2023	873 899	
USD	1 581 685	JPY	233 825 000	25. Okt. 2023	10 858	
USD	3 726 232	KRW	4 934 500 498	25. Okt. 2023	64 968	
USD	57 330 963	KRW	75 745 408 999	20. Dez. 2023	933 324	
USD	23 841 424	MXN	414 744 151	18. Okt. 2023	104 104	
USD	58 192 513	NOK	622 906 282	18. Okt. 2023	(66 123)	
USD	52 965 452	NZD	89 500 000	18. Okt. 2023	(676 443)	
USD	26 834	NZD	45 000	25. Okt. 2023	(137)	
USD	17 879 830	PHP	1 016 196 657	20. Dez. 2023	(80 362)	
USD	13 057 729	PLN	56 686 832	18. Okt. 2023	87 128	
USD	23 121	PLN	100 000	25. Okt. 2023	245	
USD	57 642 691	SEK	638 131 350	18. Okt. 2023	(800 101)	
USD	48 105 217	SGD	65 329 882	18. Okt. 2023	282 476	
USD	249 163	SGD	340 000	25. Okt. 2023	197	
USD	31 435 397	THB	1 110 961 147	18. Okt. 2023	885 750	
USD	161 287	THB	5 819 287	25. Okt. 2023	1 166	
USD	818 656	TRY	22 810 000	25. Okt. 2023	9 230	
USD	49 247 925	TWD	1 560 655 003	20. Dez. 2023	417 180	
USD	21 699 379	ZAR	415 854 038	18. Okt. 2023	(235 356)	
USD	800 615	ZAR	15 060 000	25. Okt. 2023	6 769	
ZAR	207 315 207	USD	10 955 533	18. Okt. 2023	(20 438)	
					<b>USD</b>	<b>894 768</b>
<b>Absicherung der Anteilsklasse</b>						
BRL	224 406 533	USD	45 379 115	31. Okt. 2023	(916 609)	
CHF	1 906 587	USD	2 112 361	31. Okt. 2023	(23 060)	
EUR	101 374 535	USD	108 063 572	31. Okt. 2023	(758 048)	
GBP	150 073 235	USD	183 895 193	31. Okt. 2023	(758 230)	
SEK	47 683 171	USD	4 275 578	31. Okt. 2023	93 867	
USD	29 481	BRL	145 862	31. Okt. 2023	581	
USD	247 368	CHF	225 623	31. Okt. 2023	122	
USD	47 171	EUR	44 586	31. Okt. 2023	(26)	
USD	293 649	GBP	240 700	31. Okt. 2023	(82)	
USD	7 704	SEK	85 043	31. Okt. 2023	(89)	
					<b>USD</b>	<b>(2 361 574)</b>
					<b>USD</b>	<b>(1 466 806)</b>



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Cat Bond</b>					
Absicherung des Portfolios					
USD	81 842 361	EUR	76 300 000	24. Nov. 2023	991 766
USD	12 821 998	NZD	21 500 000	24. Nov. 2023	(64 345)
					<b>USD</b>
					<b>927 421</b>
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	234 220 251	USD	259 541 832	31. Okt. 2023	(2 875 605)
EUR	814 024 714	USD	867 845 994	31. Okt. 2023	(6 196 170)
GBP	6 265 490	USD	7 678 003	31. Okt. 2023	(32 118)
JPY	1 343 819	USD	9 114	31. Okt. 2023	(76)
SEK	7 364 057 909	USD	660 208 219	31. Okt. 2023	14 596 968
SGD	434 721	USD	318 975	31. Okt. 2023	(561)
USD	463 175	CHF	418 618	31. Okt. 2023	4 440
USD	3 979 253	EUR	3 732 687	31. Okt. 2023	28 183
USD	10 774	GBP	8 803	31. Okt. 2023	32
USD	1 811 842	SEK	20 123 421	31. Okt. 2023	(32 167)
					<b>USD</b>
					<b>5 492 926</b>
					<b>USD</b>
					<b>6 420 347</b>
<b>Schroder GAIA Contour Tech Equity</b>					
Absicherung des Portfolios					
AUD	1 193 873	USD	773 711	10. Nov. 2023	(5 054)
CAD	291 341	USD	215 463	10. Nov. 2023	(849)
EUR	950 698	USD	1 032 703	10. Nov. 2023	(25 935)
GBP	721 264	USD	901 987	10. Nov. 2023	(21 769)
JPY	212 093 571	USD	1 463 510	10. Nov. 2023	(34 830)
NOK	11 691 040	USD	1 106 129	10. Nov. 2023	(11 988)
USD	1 076 326	AUD	1 671 172	10. Nov. 2023	367
USD	215 726	CAD	291 341	10. Nov. 2023	1 111
USD	1 239 994	EUR	1 149 245	10. Nov. 2023	22 971
USD	643 889	GBP	511 490	10. Nov. 2023	19 675
USD	1 528 471	JPY	221 628 201	10. Nov. 2023	35 565
USD	695 556	NOK	7 357 064	10. Nov. 2023	7 022
					<b>USD</b>
					<b>(13 714)</b>
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2 464 601	USD	2 731 049	31. Okt. 2023	(30 257)
EUR	43 535 772	USD	46 414 275	31. Okt. 2023	(331 412)
GBP	12 009 567	USD	14 717 046	31. Okt. 2023	(61 564)
SEK	66 870 943	USD	5 995 325	31. Okt. 2023	132 391
SGD	747 836	USD	548 721	31. Okt. 2023	(965)
USD	72 425	EUR	68 844	31. Okt. 2023	(447)
USD	89 827	GBP	73 997	31. Okt. 2023	(473)
					<b>USD</b>
					<b>(292 727)</b>
					<b>USD</b>
					<b>(306 441)</b>
<b>Schroder GAIA Egerton Equity</b>					
Absicherung des Portfolios					
CHF	6 771 000	EUR	7 097 931	12. Okt. 2023	(97 252)
EUR	25 478 509	CAD	37 232 000	12. Okt. 2023	(442 678)
EUR	3 060 313	INR	273 592 000	13. Okt. 2023	(53 212)
EUR	1 999 592	JPY	313 780 000	12. Okt. 2023	11 361
EUR	3 831 776	MXN	72 008 000	12. Okt. 2023	(69 076)
EUR	2 001 169	SEK	23 863 000	12. Okt. 2023	(64 674)

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)</b>					
EUR	259 973 507	USD	278 479 000	12. Okt. 2023	(3 328 752)
GBP	7 320 000	EUR	8 525 893	12. Okt. 2023	(81 048)
KRW	3 502 142 000	EUR	2 445 630	13. Okt. 2023	9 481
USD	18 406 000	EUR	17 361 900	12. Okt. 2023	40 997
					<b>EUR (4 074 853)</b>
<b>Absicherung der Anteilsklasse</b>					
EUR	483 916	GBP	421 265	31. Okt. 2023	(1 747)
EUR	3 721 999	USD	3 966 374	31. Okt. 2023	(25 145)
GBP	21 233 219	EUR	24 416 663	31. Okt. 2023	62 407
USD	201 528 595	EUR	189 049 977	31. Okt. 2023	1 339 681
					<b>EUR 1 375 196</b>
					<b>EUR (2 699 657)</b>
<b>Schroder GAIA Helix</b>					
<b>Absicherung des Portfolios</b>					
AUD	18 411 000	USD	12 208 045	17. Okt. 2023	(319 374)
AUD	10 669 169	USD	6 909 139	25. Jan. 2024	4 579
BRL	4 240 000	USD	856 373	10. Okt. 2023	(10 235)
CAD	1 684 000	USD	1 246 767	25. Jan. 2024	1 111
CHF	557 000	EUR	583 482	25. Jan. 2024	(4 306)
CHF	6 016 000	USD	6 802 924	25. Jan. 2024	(139 100)
DKK	4 044 000	EUR	542 950	25. Jan. 2024	38
DKK	21 383 000	USD	3 084 548	25. Jan. 2024	(27 446)
EUR	100 436	GBP	87 000	25. Jan. 2024	665
EUR	400 355	NOK	4 583 000	25. Jan. 2024	(5 768)
EUR	30 021 000	USD	32 353 452	25. Jan. 2024	(387 415)
GBP	6 295 000	EUR	7 256 797	25. Jan. 2024	(37 048)
GBP	4 703 000	USD	5 990 889	17. Okt. 2023	(250 153)
GBP	21 502 000	USD	26 795 316	25. Jan. 2024	(528 679)
HKD	377 871 000	USD	48 388 596	25. Jan. 2024	(29 828)
HUF	60 000 000	USD	175 173	10. Okt. 2023	(11 809)
INR	398 497 504	USD	4 769 855	25. Jan. 2024	3 109
JPY	6 109 857 581	USD	42 217 834	25. Jan. 2024	(471 446)
MXN	4 480 000	USD	260 449	10. Okt. 2023	(2 963)
NOK	14 280 000	EUR	1 236 987	25. Jan. 2024	29 114
NOK	18 628 000	USD	1 736 510	25. Jan. 2024	19 643
NZD	2 069 000	USD	1 273 726	17. Okt. 2023	(30 563)
NZD	185 000	USD	109 350	25. Jan. 2024	1 803
SEK	13 450 000	EUR	1 140 310	25. Jan. 2024	31 314
SEK	15 282 000	USD	1 375 348	25. Jan. 2024	39 804
SGD	9 342 000	USD	6 954 605	17. Okt. 2023	(105 853)
SGD	5 359 000	USD	3 954 757	25. Jan. 2024	(7 016)
THB	10 870 000	USD	319 199	27. Okt. 2023	(20 053)
USD	3 258 763	AUD	4 909 000	17. Okt. 2023	88 838
USD	239 553	AUD	374 000	25. Jan. 2024	(2 802)
USD	846 339	BRL	4 240 000	10. Okt. 2023	201
USD	256 619	BRL	1 295 000	17. Nov. 2023	(511)
USD	416 441	BRL	2 110 000	29. Dez. 2023	(541)
USD	3 129 735	BRL	15 566 489	25. Jan. 2024	62 616
USD	169 683	COP	714 980 000	17. Nov. 2023	(4 842)
USD	9 958 339	EUR	9 243 657	25. Jan. 2024	115 791

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Helix (Forts.)</b>					
USD	1 480 142	GBP	1 158 000	17. Okt. 2023	66 624
USD	8 161 145	GBP	6 545 022	25. Jan. 2024	165 809
USD	749 408	HKD	5 850 000	25. Jan. 2024	743
USD	339 275	HUF	123 550 000	10. Okt. 2023	2 881
USD	69 000	JPY	10 244 982	02. Nov. 2023	(29)
USD	3 890 426	JPY	561 912 098	25. Jan. 2024	51 089
USD	508 809	MXN	8 960 000	10. Okt. 2023	(6 163)
USD	425 268	NZD	694 000	17. Okt. 2023	8 277
USD	2 304 257	SGD	3 070 000	17. Okt. 2023	53 597
USD	302 558	THB	10 870 000	27. Okt. 2023	3 412
					<b>USD (1 652 885)</b>
<b>Absicherung der Anteilsklasse</b>					
CHF	656 381	USD	727 341	31. Okt. 2023	(7 632)
EUR	207 663 801	USD	221 394 084	31. Okt. 2023	(1 268 767)
GBP	12 850 763	USD	15 744 503	31. Okt. 2023	(56 712)
JPY	1 224 970	USD	8 308	31. Okt. 2023	(57)
SEK	100 808	USD	9 058	31. Okt. 2023	231
SGD	30 307	USD	22 238	31. Okt. 2023	(5)
USD	891 213	EUR	841 854	31. Okt. 2023	(1 160)
USD	749 202	GBP	615 628	31. Okt. 2023	(2 336)
					<b>USD (1 336 438)</b>
					<b>USD (2 989 323)</b>
<b>Schroder GAIA Oaktree Credit</b>					
<b>Absicherung des Portfolios</b>					
AUD	72 997	USD	47 552	19. Okt. 2023	(590)
EUR	456 200	USD	500 720	19. Okt. 2023	(18 080)
GBP	94 130	USD	122 554	19. Okt. 2023	(7 694)
USD	1 035 277	AUD	1 500 260	19. Okt. 2023	70 116
USD	20 332 721	EUR	18 134 709	19. Okt. 2023	1 146 936
USD	2 797 420	GBP	2 156 923	19. Okt. 2023	165 499
					<b>USD 1 356 187</b>
<b>Absicherung der Anteilsklasse</b>					
CHF	108 298	USD	120 007	31. Okt. 2023	(1 330)
EUR	12 420 229	USD	13 241 410	31. Okt. 2023	(94 524)
GBP	1 917 224	USD	2 349 437	31. Okt. 2023	(9 817)
USD	627	EUR	596	31. Okt. 2023	(4)
USD	66 622	GBP	54 434	31. Okt. 2023	196
					<b>USD (105 479)</b>
					<b>USD 1 250 708</b>
<b>Schroder GAIA SEG US Equity*</b>					
<b>Absicherung der Anteilsklasse</b>					
CHF	4 542 542	USD	5 033 328	31. Okt. 2023	(55 464)
EUR	173 779 620	USD	185 268 401	31. Okt. 2023	(1 321 675)
GBP	10 460 599	USD	12 818 671	31. Okt. 2023	(53 421)
USD	138 144	CHF	125 663	31. Okt. 2023	439
USD	8 165 435	EUR	7 724 537	31. Okt. 2023	(11 031)
USD	361 274	GBP	296 502	31. Okt. 2023	(549)
					<b>USD (1 441 701)</b>

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Sirios US Equity</b>					
Absicherung des Portfolios					
CHF	130 000	USD	144 806	20. Dez. 2023	(1 501)
DKK	6 165 000	USD	885 680	20. Dez. 2023	(7 683)
EUR	113 000	USD	119 887	20. Dez. 2023	36
GBP	515 000	USD	630 857	20. Dez. 2023	(2 148)
USD	52 700	CAD	71 000	20. Dez. 2023	360
USD	2 436 702	CHF	2 161 000	20. Dez. 2023	54 540
USD	320 788	DKK	2 234 000	20. Dez. 2023	2 630
USD	7 632 716	EUR	7 137 000	20. Dez. 2023	58 470
USD	15 912 993	GBP	12 828 000	20. Dez. 2023	252 647
					<b>USD 357 351</b>
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	3 154 466	USD	3 495 491	31. Okt. 2023	(38 724)
EUR	22 221 133	USD	23 690 335	31. Okt. 2023	(169 140)
GBP	4 057 376	USD	4 972 109	31. Okt. 2023	(20 821)
USD	266 371	CHF	241 998	31. Okt. 2023	1 182
USD	190 644	EUR	180 259	31. Okt. 2023	(162)
USD	50 554	GBP	41 297	31. Okt. 2023	158
					<b>USD (227 507)</b>
					<b>USD 129 844</b>
<b>Schroder GAIA Two Sigma Diversified</b>					
Absicherung des Portfolios					
AUD	12 871 001	USD	8 248 094	20. Dez. 2023	50 402
BRL	4 831 206	USD	964 148	11. Okt. 2023	(4 253)
BRL	4 831 206	USD	962 142	03. Nov. 2023	(5 299)
CAD	6 764 541	USD	4 962 246	20. Dez. 2023	24 482
CHF	4 349 094	USD	4 941 344	20. Dez. 2023	(147 152)
CNH	28 336 840	USD	3 902 307	20. Dez. 2023	(5 646)
EUR	15 481 548	USD	16 658 139	20. Dez. 2023	(228 118)
GBP	18 363 255	USD	23 061 089	20. Dez. 2023	(643 337)
ILS	532 724	USD	140 021	20. Dez. 2023	212
INR	580 429	USD	6 973	11. Okt. 2023	14
JPY	570 467 507	USD	3 941 162	20. Dez. 2023	(72 704)
MXN	164 708 751	USD	9 219 892	20. Dez. 2023	105 001
NOK	13 392 484	USD	1 252 960	20. Dez. 2023	1 860
NZD	12 220 921	USD	7 198 797	20. Dez. 2023	126 058
PLN	22 487 660	USD	5 344 162	20. Dez. 2023	(212 700)
SEK	13 828 772	USD	1 251 751	20. Dez. 2023	19 122
SGD	2 244 512	USD	1 655 866	20. Dez. 2023	(7 961)
TWD	3 409 000	USD	105 804	11. Okt. 2023	(84)
USD	4 385 933	AUD	6 846 185	20. Dez. 2023	(28 102)
USD	9 805 663	CAD	13 359 424	20. Dez. 2023	(42 723)
USD	19 388 527	CHF	17 060 027	20. Dez. 2023	582 532
USD	7 205 545	CNH	52 346 240	20. Dez. 2023	7 299
USD	1 626 998	CZK	36 861 741	20. Dez. 2023	32 698
USD	17 779 829	EUR	16 481 548	20. Dez. 2023	288 544
USD	10 417 843	GBP	8 293 167	20. Dez. 2023	293 594
USD	650 820	HUF	239 934 747	20. Dez. 2023	7 717

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)</b>					
USD	502 317	ILS	1 908 000	20. Dez. 2023	61
USD	6 968	INR	580 429	11. Okt. 2023	(19)
USD	6 963	INR	580 429	03. Nov. 2023	(16)
USD	24 304 146	JPY	3 522 754 518	20. Dez. 2023	415 620
USD	1 336 913	KRW	1 771 476 748	20. Dez. 2023	17 928
USD	3 364 683	MXN	60 323 580	20. Dez. 2023	(50 502)
USD	2 228 991	NOK	23 824 536	20. Dez. 2023	(3 268)
USD	1 600 275	NZD	2 718 759	20. Dez. 2023	(29 268)
USD	1 992 637	PLN	8 387 180	20. Dez. 2023	78 765
USD	1 601 578	SEK	17 694 924	20. Dez. 2023	(24 596)
USD	5 381 849	SGD	7 295 456	20. Dez. 2023	25 578
USD	106 488	TWD	3 409 000	11. Okt. 2023	768
USD	105 804	TWD	3 409 000	02. Nov. 2023	(199)
USD	292 507	TWD	9 291 179	20. Dez. 2023	1 799
USD	1 233 774	ZAR	23 953 911	20. Dez. 2023	(22 449)
ZAR	27 635 984	USD	1 422 890	20. Dez. 2023	26 433
					<b>USD 578 091</b>
<b>Absicherung der Anteilsklasse</b>					
CHF	2 353 213	USD	2 607 619	31. Okt. 2023	(28 888)
EUR	70 866 407	USD	75 552 094	31. Okt. 2023	(539 597)
GBP	71 717 518	USD	87 886 292	31. Okt. 2023	(368 163)
USD	2 216 637	EUR	2 105 461	31. Okt. 2023	(12 005)
					<b>USD (948 653)</b>
					<b>USD (370 562)</b>
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa</b>					
<b>Absicherung des Portfolios</b>					
AUD	23 765 000	USD	15 375 656	04. Okt. 2023	(95 419)
AUD	540 000	USD	344 578	02. Nov. 2023	3 006
AUD	12 268 000	USD	7 877 988	03. Nov. 2023	18 860
AUD	700 000	USD	450 639	20. Dez. 2023	682
BRL	74 618 000	USD	15 233 174	03. Okt. 2023	(388 400)
BRL	7 356 000	USD	1 406 367	10. Okt. 2023	55 376
BRL	4 926 000	USD	955 021	13. Okt. 2023	23 436
BRL	61 968 000	USD	12 291 448	03. Nov. 2023	(18 386)
BRL	18 178 000	USD	3 654 025	04. Dez. 2023	(67 048)
BRL	5 419 000	USD	1 112 046	29. Jan. 2024	(49 207)
BRL	3 404 000	USD	691 800	05. Feb. 2024	(24 682)
BRL	1 840 000	USD	361 671	12. Mrz. 2024	(2 493)
BRL	3 506 000	USD	685 837	03. Apr. 2024	(3 088)
CAD	23 487 000	USD	17 375 944	04. Okt. 2023	(83 597)
CAD	6 117 000	USD	4 531 673	03. Nov. 2023	(26 087)
CAD	675 000	USD	501 945	20. Dez. 2023	(4 345)
CHF	16 544 000	USD	18 573 760	04. Okt. 2023	(497 923)
CHF	6 750 000	USD	7 410 989	03. Nov. 2023	(11 652)
CLP	7 123 585 000	USD	7 890 443	04. Okt. 2023	125 358
CLP	418 500 000	USD	460 782	03. Nov. 2023	9 071
CLP	760 211 000	USD	852 176	20. Dez. 2023	(1 914)
CNH	131 100 860	USD	17 985 572	10. Okt. 2023	(16 711)
CNH	20 890 000	USD	2 860 600	03. Nov. 2023	5 297
CNH	69 951 000	USD	9 618 616	20. Dez. 2023	500

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
CNY	1 022 000	USD	140 592	20. Dez. 2023	419
COP	51 697 577 000	USD	12 743 888	04. Okt. 2023	(76 007)
COP	51 697 577 000	USD	12 522 145	03. Nov. 2023	28 831
COP	6 968 060 000	USD	1 699 320	20. Dez. 2023	(25 091)
COP	12 039 800 000	USD	2 836 231	14. Feb. 2024	22 459
COP	12 039 800 000	USD	2 793 782	14. Aug. 2024	(34 427)
COP	11 967 700 000	USD	2 726 400	16. Aug. 2024	15 387
CZK	125 415 000	USD	5 571 782	04. Okt. 2023	(136 445)
CZK	90 445 000	USD	3 921 457	03. Nov. 2023	(6 609)
CZK	42 091 000	USD	1 826 199	20. Dez. 2023	(5 728)
DKK	4 648 000	USD	676 327	04. Okt. 2023	(17 419)
DKK	1 534 000	USD	219 165	31. Okt. 2023	(1 388)
EUR	32 347 000	USD	34 994 208	04. Okt. 2023	(793 965)
EUR	5 085 000	USD	5 408 127	31. Okt. 2023	(25 625)
EUR	14 358 000	USD	15 238 157	03. Nov. 2023	(38 137)
EUR	4 533 000	USD	4 857 619	20. Dez. 2023	(46 908)
EUR	253 000	USD	277 035	17. Jan. 2024	(8 125)
EUR	251 000	USD	268 921	22. Feb. 2024	(1 690)
GBP	546 000	AUD	1 066 141	04. Okt. 2023	(19 320)
GBP	546 000	AUD	1 030 978	03. Nov. 2023	2 670
GBP	7 300 000	USD	9 129 273	04. Okt. 2023	(222 487)
GBP	45 000	USD	54 939	31. Okt. 2023	(24)
GBP	7 275 000	USD	8 881 670	03. Nov. 2023	(3 700)
GBP	1 956 000	USD	2 429 307	20. Dez. 2023	(41 434)
GBP	266 000	USD	325 318	27. Mrz. 2024	(404)
HKD	7 062 000	USD	901 510	04. Okt. 2023	314
HKD	2 740 000	USD	350 804	20. Dez. 2023	(318)
HUF	2 762 130 000	USD	7 862 820	04. Okt. 2023	(364 888)
HUF	2 396 930 000	USD	6 461 656	03. Nov. 2023	7 282
HUF	169 360 000	USD	452 834	13. Nov. 2023	3 441
HUF	952 664 000	USD	2 605 592	20. Dez. 2023	(52 143)
HUF	79 642 000	USD	219 848	27. Dez. 2023	(6 531)
IDR	40 331 000 000	USD	2 597 475	04. Okt. 2023	12 098
IDR	10 835 000 000	USD	704 308	20. Dez. 2023	(3 372)
ILS	22 090 000	USD	5 798 187	04. Okt. 2023	(6 519)
ILS	14 345 000	USD	3 753 126	30. Okt. 2023	12 537
ILS	13 805 000	USD	3 621 317	03. Nov. 2023	3 267
ILS	920 000	USD	239 896	11. Dez. 2023	2 141
ILS	15 706 000	USD	4 106 418	20. Dez. 2023	27 979
ILS	455 000	USD	124 914	07. Feb. 2024	(4 826)
ILS	59 000	USD	15 500	29. Mrz. 2024	112
INR	86 214 677	USD	1 036 000	03. Okt. 2023	2 215
INR	2 242 275 000	USD	27 070 730	04. Okt. 2023	(69 950)
INR	1 563 275 000	USD	18 760 050	03. Nov. 2023	35 600
INR	27 615 000	USD	331 831	08. Dez. 2023	(300)
INR	236 817 000	USD	2 838 243	20. Dez. 2023	3 224
JPY	3 068 158 000	USD	20 996 850	04. Okt. 2023	(462 550)
JPY	2 732 215 000	USD	18 414 974	02. Nov. 2023	(32 471)
JPY	108 500 000	USD	752 198	20. Dez. 2023	(16 437)
KRW	38 133 780 000	USD	28 394 278	05. Okt. 2023	(131 481)

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
KRW	3 696 750 000	USD	2 747 086	03. Nov. 2023	(2 811)
KRW	922 270 000	USD	698 806	20. Dez. 2023	(12 112)
KZT	288 500 000	USD	611 365	20. Dez. 2023	(18 648)
KZT	130 750 000	USD	281 002	07. Feb. 2024	(15 116)
KZT	104 550 000	USD	224 501	09. Feb. 2024	(11 981)
MXN	708 712 000	USD	40 780 552	04. Okt. 2023	(120 849)
MXN	1 713 000	USD	99 123	17. Okt. 2023	(1 065)
MXN	215 648 000	USD	12 299 847	03. Nov. 2023	7 418
MXN	46 873 000	USD	2 703 172	30. Nov. 2023	(40 422)
MXN	115 177 000	USD	6 452 962	20. Dez. 2023	67 719
MXN	200 910 000	USD	11 549 250	29. Dez. 2023	(192 233)
MXN	73 810 000	USD	4 165 350	03. Jan. 2024	3 387
MXN	200 910 000	USD	11 054 195	28. Jun. 2024	(50 346)
MXN	98 570 000	USD	5 404 205	03. Jul. 2024	(10 091)
MXN	191 220 000	USD	10 552 693	08. Jul. 2024	(97 239)
MXN	77 010 000	USD	4 192 421	13. Sep. 2024	(28 678)
NOK	116 690 000	USD	10 938 588	04. Okt. 2023	(29 256)
NOK	115 474 000	USD	10 847 003	03. Nov. 2023	(42 110)
NZD	50 354 000	USD	29 990 265	04. Okt. 2023	189 389
NZD	40 299 000	USD	24 016 733	03. Nov. 2023	136 648
NZD	650 000	USD	385 849	20. Dez. 2023	3 742
PEN	2 485 000	USD	671 658	04. Okt. 2023	(15 577)
PEN	2 485 000	USD	651 786	03. Nov. 2023	3 091
PEN	1 560 000	USD	417 783	20. Dez. 2023	(7 664)
PHP	37 390 000	USD	657 118	04. Okt. 2023	3 788
PHP	14 395 000	USD	253 536	20. Dez. 2023	881
PLN	39 605 000	USD	9 263 949	04. Okt. 2023	(198 412)
PLN	3 670 000	USD	849 086	20. Dez. 2023	(11 628)
RON	7 435 000	USD	1 598 988	20. Dez. 2023	(20 626)
SEK	54 930 000	USD	4 978 309	04. Okt. 2023	49 548
SEK	1 438 000	USD	129 738	31. Okt. 2023	2 033
SEK	120 210 000	USD	10 920 657	03. Nov. 2023	96 207
SGD	10 127 000	USD	7 475 595	04. Okt. 2023	(67 082)
SGD	3 653 000	USD	2 679 371	03. Nov. 2023	(3 339)
SGD	1 045 000	USD	769 360	20. Dez. 2023	(2 129)
THB	402 555 000	USD	11 019 847	04. Okt. 2023	36 471
THB	58 149 000	USD	1 630 328	12. Dez. 2023	(23 207)
THB	83 898 000	USD	2 342 339	20. Dez. 2023	(21 621)
THB	2 399 000	USD	65 690	26. Dez. 2023	711
THB	44 722 000	USD	1 234 155	07. Feb. 2024	8 606
TRY	154 728 000	USD	5 666 595	04. Okt. 2023	(32 587)
TRY	7 878 000	USD	272 336	20. Dez. 2023	(9 268)
TWD	263 375 000	USD	8 232 556	04. Okt. 2023	(72 486)
TWD	16 955 000	USD	528 605	31. Okt. 2023	(1 517)
TWD	33 380 000	USD	1 037 613	03. Nov. 2023	472
TWD	21 620 000	USD	677 997	20. Dez. 2023	(1 536)
USD	15 289 369	AUD	23 765 000	04. Okt. 2023	9 132
USD	5 005 069	AUD	7 760 000	03. Nov. 2023	9 997
USD	761 459	AUD	1 180 000	20. Dez. 2023	662



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
USD	14 932 832	BRL	74 618 000	03. Okt. 2023	88 058
USD	1 961 946	BRL	9 435 000	10. Okt. 2023	87 077
USD	970 534	BRL	4 710 000	13. Okt. 2023	34 981
USD	160 755	BRL	809 000	24. Nov. 2023	932
USD	2 068 685	BRL	10 296 000	04. Dez. 2023	37 025
USD	897 335	BRL	4 545 000	29. Jan. 2024	5 915
USD	538 030	BRL	2 734 000	05. Feb. 2024	2 219
USD	173 991	BRL	875 000	09. Feb. 2024	2 583
USD	18 101 077	CAD	24 487 000	04. Okt. 2023	72 481
USD	1 092 966	CAD	1 500 000	18. Okt. 2023	(11 632)
USD	634 405	CAD	860 000	20. Okt. 2023	1 084
USD	1 863 536	CAD	2 500 000	02. Nov. 2023	22 143
USD	1 778 035	CAD	2 400 000	03. Nov. 2023	10 272
USD	11 697 830	CAD	15 860 000	20. Dez. 2023	6 053
USD	1 309 495	CAD	1 750 000	31. Jan. 2024	18 557
USD	18 444 720	CHF	16 544 000	04. Okt. 2023	368 885
USD	1 834 952	CHF	1 676 000	03. Nov. 2023	(2 276)
USD	503 832	CHF	447 000	20. Dez. 2023	11 085
USD	8 258 946	CLP	7 123 585 000	04. Okt. 2023	243 145
USD	7 382 522	CLP	6 705 085 000	03. Nov. 2023	(145 333)
USD	1 589 460	CLP	1 432 300 000	20. Dez. 2023	(12 504)
USD	17 994 012	CNH	131 139 485	10. Okt. 2023	19 858
USD	6 536 291	CNH	47 828 000	03. Nov. 2023	(25 227)
USD	265 715	CNH	1 870 000	12. Dez. 2023	8 684
USD	9 439 949	CNH	68 771 000	20. Dez. 2023	(16 903)
USD	113 155	CNH	796 000	18. Jan. 2024	3 494
USD	432 617	CNH	3 120 000	05. Feb. 2024	2 260
USD	124 757	CNH	900 000	20. Feb. 2024	489
USD	25 092	CNH	181 000	23. Feb. 2024	95
USD	848 427	CNY	6 180 000	03. Nov. 2023	(195)
USD	754 378	CNY	5 458 000	18. Jan. 2024	(909)
USD	12 626 160	COP	51 697 577 000	04. Okt. 2023	(41 721)
USD	1 010 085	COP	4 146 400 000	03. Nov. 2023	3 435
USD	344 264	COP	1 404 400 000	20. Dez. 2023	6 826
USD	2 885 513	COP	12 039 800 000	14. Feb. 2024	26 824
USD	2 816 310	COP	11 967 700 000	16. Feb. 2024	(24 047)
USD	2 747 558	COP	12 039 800 000	14. Aug. 2024	(11 797)
USD	3 092 335	CZK	70 350 000	04. Okt. 2023	43 450
USD	147 191	CZK	3 390 000	03. Nov. 2023	457
USD	2 405 891	CZK	54 910 000	20. Dez. 2023	30 989
USD	681 975	DKK	4 658 000	04. Okt. 2023	21 649
USD	1 018 673	DKK	7 130 000	31. Okt. 2023	6 451
USD	1 424	DKK	10 000	03. Nov. 2023	4
USD	343 091	DKK	2 375 000	20. Dez. 2023	4 852
USD	75 000	EGP	2 370 000	27. Nov. 2023	(901)
USD	37 580 671	EUR	34 937 000	04. Okt. 2023	642 041
USD	26 746 832	EUR	25 137 000	31. Okt. 2023	139 174
USD	20 229 504	EUR	19 088 000	03. Nov. 2023	22 093
USD	10 988 043	EUR	10 236 000	20. Dez. 2023	124 937

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
USD	797 916	EUR	708 000	17. Jan. 2024	45 393
USD	716 145	EUR	653 000	22. Feb. 2024	20 917
USD	775 490	EUR	723 000	25. Mrz. 2024	4 586
USD	20 462 168	GBP	16 199 000	04. Okt. 2023	697 651
USD	2 333 556	GBP	1 908 000	31. Okt. 2023	5 191
USD	14 231 118	GBP	11 635 000	03. Nov. 2023	32 467
USD	2 979 254	GBP	2 390 000	20. Dez. 2023	61 558
USD	963 910	HKD	7 550 000	04. Okt. 2023	(231)
USD	62 369	HKD	488 000	03. Nov. 2023	7
USD	471 091	HKD	3 681 000	20. Dez. 2023	237
USD	7 476 289	HUF	2 676 200 000	04. Okt. 2023	211 618
USD	4 910 466	HUF	1 823 000 000	03. Nov. 2023	(9 526)
USD	704 601	HUF	253 621 000	13. Nov. 2023	21 316
USD	1 572 270	HUF	582 100 000	20. Dez. 2023	12 054
USD	466 829	HUF	164 394 000	27. Dez. 2023	26 510
USD	697 850	HUF	263 194 000	28. Dez. 2023	(7 029)
USD	2 638 339	IDR	40 331 000 000	04. Okt. 2023	28 765
USD	2 595 887	IDR	40 331 000 000	03. Nov. 2023	(13 535)
USD	2 071 669	IDR	31 931 000 000	20. Dez. 2023	5 994
USD	18 774 405	ILS	71 255 000	04. Okt. 2023	92 410
USD	13 008 058	ILS	49 690 000	03. Nov. 2023	(38 344)
USD	8 851 943	ILS	33 923 000	20. Dez. 2023	(77 842)
USD	1 036 000	INR	85 697 920	03. Okt. 2023	4 008
USD	26 937 691	INR	2 242 275 000	04. Okt. 2023	(63 090)
USD	604 538	INR	50 092 000	08. Dez. 2023	3 159
USD	906 844	INR	75 680 000	20. Dez. 2023	(1 208)
USD	222 487	INR	18 640 000	11. Mrz. 2024	(263)
USD	25 681 878	JPY	3 748 015 000	04. Okt. 2023	597 491
USD	4 378 687	JPY	647 900 000	31. Okt. 2023	21 216
USD	14 916 599	JPY	2 211 857 000	02. Nov. 2023	35 096
USD	797 619	JPY	115 501 000	20. Dez. 2023	14 382
USD	658 288	JPY	94 438 000	21. Mrz. 2024	8 081
USD	28 539 066	KRW	38 133 780 000	05. Okt. 2023	276 271
USD	12 452 680	KRW	16 646 120 000	03. Nov. 2023	95 462
USD	1 401 631	KRW	1 855 118 000	20. Dez. 2023	20 369
USD	612 258	KZT	288 500 000	20. Dez. 2023	19 541
USD	265 887	KZT	130 750 000	07. Feb. 2024	2
USD	212 500	KZT	104 550 000	09. Feb. 2024	(20)
USD	55 565 204	MXN	949 528 000	04. Okt. 2023	1 089 583
USD	1 145 181	MXN	20 071 000	17. Okt. 2023	(3 760)
USD	20 908 337	MXN	371 634 000	03. Nov. 2023	(301 218)
USD	556 233	MXN	10 213 000	30. Nov. 2023	(23 944)
USD	17 624 491	MXN	314 813 000	20. Dez. 2023	(198 469)
USD	11 376 557	MXN	200 910 000	29. Dez. 2023	19 540
USD	5 561 229	MXN	98 570 000	03. Jan. 2024	(5 936)
USD	10 867 090	MXN	191 220 000	08. Jan. 2024	76 566
USD	404 688	MXN	7 078 000	17. Jan. 2024	5 906
USD	4 324 666	MXN	77 010 000	13. Mrz. 2024	27 866
USD	73 348	MXN	1 332 000	27. Mrz. 2024	(792)

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
USD	11 197 669	MXN	200 910 000	28. Jun. 2024	193 820	
USD	4 039 558	MXN	73 810 000	03. Jul. 2024	402	
USD	4 868 143	NOK	52 046 000	04. Okt. 2023	2 371	
USD	5 956 323	NOK	63 621 000	03. Nov. 2023	3 312	
USD	197 959	NOK	2 110 000	20. Dez. 2023	261	
USD	29 914 713	NZD	50 354 000	04. Okt. 2023	(264 942)	
USD	16 237 856	NZD	27 210 000	03. Nov. 2023	(70 576)	
USD	370 113	NZD	625 000	20. Dez. 2023	(4 494)	
USD	652 916	PEN	2 485 000	04. Okt. 2023	(3 164)	
USD	1 120 644	PEN	4 245 000	03. Nov. 2023	1 951	
USD	5 334 039	PEN	19 899 000	20. Dez. 2023	102 664	
USD	658 367	PHP	37 390 000	04. Okt. 2023	(2 539)	
USD	656 748	PHP	37 390 000	03. Nov. 2023	(4 387)	
USD	1 761 901	PHP	100 260 000	20. Dez. 2023	(10 087)	
USD	30 446 088	PLN	127 664 000	04. Okt. 2023	1 223 954	
USD	23 248 008	PLN	101 509 000	03. Nov. 2023	33 179	
USD	1 891 995	PLN	8 207 000	20. Dez. 2023	19 238	
USD	410 934	RON	1 910 000	20. Dez. 2023	5 463	
USD	17 231 465	SEK	188 528 000	04. Okt. 2023	(24 895)	
USD	22 826 494	SEK	248 228 000	03. Nov. 2023	77 186	
USD	1 062 463	SEK	11 764 000	20. Dez. 2023	(18 656)	
USD	11 576 567	SGD	15 700 000	04. Okt. 2023	91 068	
USD	4 094 032	SGD	5 573 000	03. Nov. 2023	11 490	
USD	3 645 903	SGD	4 950 000	20. Dez. 2023	11 648	
USD	11 432 345	THB	402 555 000	04. Okt. 2023	376 028	
USD	11 039 490	THB	402 555 000	03. Nov. 2023	(45 828)	
USD	6 049 019	THB	214 171 000	20. Dez. 2023	124 797	
USD	2 784 627	TRY	76 068 000	04. Okt. 2023	14 813	
USD	202 242	TRY	5 876 000	20. Dez. 2023	6 027	
USD	8 206 215	TWD	263 375 000	04. Okt. 2023	46 146	
USD	6 177 353	TWD	198 826 000	03. Nov. 2023	(5 939)	
USD	845 957	TWD	27 085 000	20. Dez. 2023	(1 496)	
USD	164 283	ZAR	3 032 000	03. Okt. 2023	4 145	
USD	21 365 187	ZAR	399 751 000	04. Okt. 2023	253 786	
USD	23 028 265	ZAR	433 771 000	03. Nov. 2023	182 203	
USD	369 035	ZAR	7 115 000	13. Nov. 2023	(5 359)	
USD	1 829 434	ZAR	35 219 000	20. Dez. 2023	(17 569)	
UYU	14 325 000	USD	372 461	20. Dez. 2023	(5 210)	
ZAR	6 464 000	USD	341 045	03. Okt. 2023	356	
ZAR	11 910 000	USD	633 133	04. Okt. 2023	(4 150)	
ZAR	69 110 000	USD	3 634 590	03. Nov. 2023	5 330	
ZAR	13 250 000	USD	691 812	13. Nov. 2023	5 408	
ZAR	11 412 000	USD	598 269	20. Dez. 2023	214	
ZAR	13 044 000	USD	674 387	28. Dez. 2023	9 186	
					<b>USD</b>	<b>2 922 430</b>
<b>Absicherung der Anteilsklasse</b>						
BRL	110 852 741	USD	22 416 457	31. Okt. 2023	(452 789)	
CHF	11 414 698	USD	12 647 970	31. Okt. 2023	(139 369)	
EUR	160 719 193	USD	171 345 753	31. Okt. 2023	(1 223 567)	

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
GBP	84 923 882	USD	104 070 204	31. Okt. 2023	(436 121)
SGD	2 626 613	USD	1 927 270	31. Okt. 2023	(3 392)
USD	750 891	BRL	3 761 339	31. Okt. 2023	5 642
USD	610 222	EUR	580 048	31. Okt. 2023	(3 762)
USD	955 784	GBP	787 057	31. Okt. 2023	(4 675)
					<b>USD (2 258 033)</b>
					<b>USD 664 397</b>

Die Devisenterminkontrakte waren mit den folgenden Kontrahenten verbunden:

## Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Asian Equity Long Short*</b>		
	ANZ	2 366
	Canadian Imperial Bank of Commerce	(3 978)
	Citi Bank	(5 809)
	Royal Bank of Canada	(95 630)
	Standard Chartered Bank	(18 253)
	State Street	(5 227)
	The Bank of New York Mellon	(1 858)
	UBS	2 378
		<b>USD (126 011)</b>
<b>Schroder GAIA BlueTrend</b>		
	HSBC	(2 361 574)
	UBS	894 768
		<b>USD (1 466 806)</b>
<b>Schroder GAIA Cat Bond</b>		
	Brown Brothers Harriman & Co	927 421
	HSBC	5 492 926
		<b>USD 6 420 347</b>
<b>Schroder GAIA Contour Tech Equity</b>		
	HSBC	(292 727)
	Morgan Stanley	(13 714)
		<b>USD (306 441)</b>
<b>Schroder GAIA Egerton Equity</b>		
	Brown Brothers Harriman & Co	(4 031 122)
	HSBC	1 331 465
		<b>EUR (2 699 657)</b>
<b>Schroder GAIA Helix</b>		
	Goldman Sachs	(1 651 599)
	HSBC	(1 336 438)
	J.P. Morgan	(1 286)
		<b>USD (2 989 323)</b>
<b>Schroder GAIA Oaktree Credit</b>		
	HSBC	(105 479)
	State Street	1 356 187
		<b>USD 1 250 708</b>
<b>Schroder GAIA SEG US Equity*</b>		
	HSBC	(1 441 701)
		<b>USD (1 441 701)</b>

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Kontrahenten von Devisenterminkontrakten (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity	HSBC	(227 507)
	Morgan Stanley	357 351
		<b>USD 129 844</b>
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	222 618
	Deutsche Bank	(344 367)
	HSBC	(948 653)
	Morgan Stanley	19 726
	Newedge Group	680 114
		<b>USD (370 562)</b>
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Bank of America	74 386
	Barclays Bank	1 866 336
	BNP Paribas	14 277
	Citi Bank	(14 489)
	Deutsche Bank	(148 377)
	Goldman Sachs	236 711
	HSBC	(2 009 491)
	J.P. Morgan	(88 341)
	Morgan Stanley	250 519
	Standard Chartered Bank	(50 403)
UBS	533 269	
		<b>USD 664 397</b>

## Kassageschäfte

Offene Kassageschäfte sind mit Bezug auf den Kassakurs, der sich auf das Fälligkeitsdatum des betreffenden Kontrakts bezieht, zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter «Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Kassageschäften» aufgeführt.

Zum 30. September 2023 war der folgende Teilfonds in offenen Kassageschäften engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Abrechnungsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Two Sigma Diversified</b>					
Absicherung des Portfolios					
EUR	1 985 321	USD	2 086 122	02. Okt. 2023	12 860
EUR	10 896	USD	11 518	04. Okt. 2023	1
GBP	819 000	USD	998 312	02. Okt. 2023	950
THB	2 577 600	USD	70 673	03. Okt. 2023	116
USD	964 698	BRL	4 831 206	11. Okt. 2023	3 560
					<b>USD 17 487</b>

## Kontrahenten von Kassageschäften

Fonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Brown Brothers Harriman & Co	12 861
	Deutsche Bank	3 676
	Morgan Stanley	950
		<b>USD 17 487</b>

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Terminkontrakte

Terminkontrakte wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter «Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Terminkontrakten» aufgeführt. Zum 30. September 2023 hielten die folgenden Teilfonds offene Terminkontrakte auf Indizes (mit Marktwert Risiken), Rentenwerte und Währungen:

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA BlueTrend</b>							
Sep. 24	9	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(2 134 575)	94,82	1 238
Dez. 24	11	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(2 614 563)	95,09	(412)
Mrz. 25	11	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(2 622 938)	95,41	(838)
Jun. 26	115	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(27 677 238)	96,06	59 988
Sep. 26	122	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(29 374 813)	96,07	74 988
Dez. 26	121	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(29 134 863)	96,07	75 200
Mrz. 27	120	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(28 896 075)	96,06	79 575
Jun. 27	122	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(29 382 738)	96,04	92 063
Sep. 27	116	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(27 935 838)	96,01	94 388
Dez. 27	113	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(27 214 800)	95,97	103 275
Dez. 23	285	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(181 146 654)	9,90	(171 616)
Mrz. 24	277	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(176 224 238)	9,89	60 075
Jun. 24	224	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(142 375 854)	9,89	(71 381)
Sep. 24	25	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	15 904 506	9,89	(4 826)
Okt. 23	18	Amsterdam Index Future	Morgan Stanley	EUR	2 810 012	730,25	(30 607)
Dez. 23	422	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(31 008 736)	111,97	627 733
Dez. 23	1 719	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(117 248 561)	105,34	822 145
Mrz. 24	360	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(62 575 722)	94,33	74 342
Jun. 24	65	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(11 306 976)	94,39	14 228
Sep. 24	58	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(10 116 391)	94,62	15 231
Dez. 24	40	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(6 998 049)	94,82	17 007
Okt. 23	1 717	BIST 30 Index Future	Morgan Stanley	TRY	5 535 933	9 078,75	149 358
Okt. 23	42	CAC 40 Index Future	Morgan Stanley	EUR	(3 163 741)	7 151,50	(11 846)
Dez. 23	956	Canada 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	(82 955 708)	115,13	1 921 819
Okt. 23	18	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(304 450)	17,77	(15 432)
Nov. 23	27	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(479 700)	18,25	(12 950)
Dez. 23	3	Dax Index Future	Morgan Stanley	EUR	1 255 246	15 526,00	(24 132)
Dez. 23	11	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	J.P. Morgan	USD	(1 872 905)	33 725,00	18 030
Dez. 23	4	E-mini S&P 500 ESG Future	Morgan Stanley	USD	806 680	383,22	(40 240)
Dez. 23	5	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	1 119 100	4 325,50	(37 725)
Jun. 24	66	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(16 779 720)	96,19	(264)
Sep. 24	43	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(10 957 497)	96,40	1 784
Dez. 24	45	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(11 490 735)	96,62	(714)
Mrz. 26	318	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(81 585 007)	97,00	55 175
Dez. 23	36	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(4 920 103)	122,36	262 959
Dez. 23	43	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	(1 889 200)	4 204,00	(22 012)
Dez. 23	189	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(23 251 221)	115,75	122 028
Dez. 23	152	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(18 174 941)	109,73	541 111
Dez. 23	87	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(11 987 513)	128,64	155 109
Dez. 23	364	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(48 333 832)	123,20	921 668
Dez. 23	54	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	5 112 445	7 671,00	(58 376)
Okt. 23	782	FTSE China A50 Future	Morgan Stanley	USD	(9 822 160)	12 598,00	(29 476)
Dez. 23	20	FTSE MIB Index Future	Morgan Stanley	EUR	3 058 968	28 283,00	(68 748)
Okt. 23	166	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	9 458 862	1 425,00	3 138
Dez. 23	166	FTSE/JSE Top 40 Future	Morgan Stanley	ZAR	(6 067 231)	67 450,00	153 611
Okt. 23	71	Hang Seng Index Future	Morgan Stanley	HKD	(7 953 377)	17 889,00	(156 233)
Okt. 23	156	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	(6 045 544)	6 181,00	(111 027)
Okt. 23	1	IBEX 35 Index Future	Morgan Stanley	EUR	(99 001)	9 440,00	(804)
Sep. 24	59	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	17 016 872	94,74	32 988
Dez. 24	51	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	14 745 335	94,93	21 459
Mrz. 25	46	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	13 338 087	95,13	9 746

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
<b>Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)</b>								
Jun. 26	215	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(62 661 574)	95,71	(105 401)	
Okt. 23	137	IFSC Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	5 424 100	19 710,50	(23 423)	
Dez. 23	110	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	(107 208 211)	144,96	505 855	
Dez. 23	83	KOSPI2 Index Future	J.P. Morgan	KRW	(5 055 599)	329,00	(3 502)	
Dez. 23	126	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(14 544 189)	94,16	68 728	
Okt. 23	3 066	Mini Bovespa Future	Morgan Stanley	BRL	(14 264 313)	117 222,00	(35 859)	
Dez. 23	93	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(9 597 990)	2 041,50	105 015	
Dez. 23	355	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(17 410 629)	955,50	450 504	
Okt. 23	252	MSCI Singapore Index ETS Future	Morgan Stanley	SGD	(5 196 119)	285,65	(69 704)	
Dez. 23	6	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1 772 930)	14 866,50	(11 050)	
Dez. 23	17	Nikkei 225 (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	3 743 575	31 860,00	(119 244)	
Dez. 23	17	Nikkei 225 (SGX) Future	Morgan Stanley	JPY	1 870 483	32 005,00	(50 070)	
Okt. 23	125	OMXS30 Index Future	Morgan Stanley	SEK	(2 483 398)	2 160,00	12 127	
Dez. 23	66	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(6 163 745)	1 798,60	228 365	
Dez. 23	10	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(2 565 880)	2 520,40	45 480	
Dez. 23	49	S&P/TSX 60 Index Future	J.P. Morgan	CAD	(8 499 908)	1 176,30	12 708	
Dez. 23	937	SET 50 Index Future	J.P. Morgan	THB	(4 726 681)	901,60	86 521	
Dez. 23	762	Short-Term Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(84 249 301)	104,15	343 511	
Dez. 23	811	South Korea 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	(65 252 942)	107,90	404 194	
Dez. 23	2 421	South Korea 3 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	(185 034 341)	103,05	149 170	
Dez. 23	13	SPI 200 Future	Morgan Stanley	AUD	(1 476 374)	7 086,00	(4 308)	
Dez. 23	16	Stoxx Euro ESG-X Index Future	Morgan Stanley	EUR	290 934	168,90	(5 223)	
Dez. 23	58	Swiss Market Index Future	Morgan Stanley	CHF	(6 981 286)	11 002,00	10 007	
Dez. 23	75	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	11 798 452	2 323,50	(137 418)	
Dez. 23	191	WIG20 Index Future	Morgan Stanley	PLN	1 733 144	1 944,00	(33 287)	
							<b>USD</b>	<b>7 535 496</b>
<b>Schroder GAIA Helix</b>								
Okt. 23	29	CBOE VIX Future	Goldman Sachs	USD	463 314	17,77	52 051	
Dez. 23	34	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	7 248 508	4 325,50	104 843	
Dez. 23	57	Euro Stoxx 50 Future	Goldman Sachs	EUR	(2 565 458)	4 204,00	28 397	
Dez. 23	135	Euro Stoxx Future	J.P. Morgan	EUR	(3 232 904)	444,00	59 830	
Dez. 23	151	FTSE 100 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(13 938 471)	7 671,00	(199 415)	
Dez. 23	134	FTSE 250 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(6 083 011)	18 358,00	77 974	
Dez. 23	233	MSCI Asia Future	J.P. Morgan	USD	(12 439 800)	520,10	321 470	
Dez. 23	397	MSCI China Future	J.P. Morgan	USD	9 073 119	445,60	(227 959)	
Dez. 23	80	MSCI EAFE Index Future	J.P. Morgan	USD	(8 433 150)	2 041,50	267 150	
Dez. 23	128	MSCI Emerging Market Index Future	J.P. Morgan	USD	(6 354 970)	955,50	239 770	
Dez. 23	829	MSCI Europe Future	J.P. Morgan	EUR	(26 071 931)	293,65	298 160	
Dez. 23	145	MSCI Poland Future	Goldman Sachs	USD	(2 327 815)	158,40	31 014	
Dez. 23	332	MSCI World Index Future	J.P. Morgan	USD	(30 854 027)	9 019,00	910 946	
Dez. 23	142	MSCI World Small Cap Index Future	J.P. Morgan	USD	(8 621 582)	591,40	223 702	
Dez. 23	48	SPI 200 Future	J.P. Morgan	AUD	(5 483 754)	7 086,00	(4 211)	
Dez. 23	79	Topix Index Future	J.P. Morgan	JPY	(12 448 953)	2 323,50	148 299	
Dez. 23	5	US 10 Year Note Future (CBT)	Goldman Sachs	USD	(545 703)	108,06	5 391	
Dez. 23	3	US Ultra Bond Future (CBT)	Goldman Sachs	USD	(373 257)	118,69	17 194	
							<b>USD</b>	<b>2 354 606</b>
<b>Schroder GAIA Two Sigma Diversified</b>								
Jun. 24	43	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(10 174 188)	94,63	2 000	
Sep. 24	122	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(28 971 692)	94,82	53 117	
Dez. 24	95	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(22 653 638)	95,09	69 763	



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)</b>							
Mrz. 25	93	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(22 234 963)	95,41	52 138
Jun. 25	61	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(14 607 583)	95,70	14 096
Sep. 25	16	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(3 825 613)	95,89	(9 788)
Dez. 25	39	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	9 374 488	96,00	(14 975)
Mrz. 26	37	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	8 883 700	96,05	463
Dez. 23	14	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(3 567 611)	96,01	15 066
Jun. 24	63	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(16 176 348)	96,19	159 090
Sep. 24	54	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	13 895 040	96,40	(136 702)
Dez. 24	80	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	20 602 978	96,62	(173 737)
Dez. 23	24	Australia 10 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	(1 771 658)	111,97	43 828
Dez. 23	22	Australia 3 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	1 500 209	105,34	(10 168)
Dez. 23	3	Australian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	193 835	64,55	(185)
Jun. 24	7	Bankers' Acceptance Future	Citi Bank	CAD	(1 220 394)	94,39	4 251
Dez. 23	3	British Pound Future	Morgan Stanley	USD	232 706	122,10	(3 769)
Okt. 23	7	CAC 40 Index Future	Citi Bank	EUR	(534 889)	7 151,50	5 625
Dez. 23	193	Canada 10 Year Bond Future	Citi Bank	CAD	(16 863 729)	115,13	504 377
Dez. 23	3	Canadian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(222 195)	73,84	690
Okt. 23	72	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(1 261 243)	17,77	(18 283)
Nov. 23	42	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(705 002)	18,25	(61 342)
Dez. 23	3	Dax Index Future	Newedge Group	EUR	(1 228 498)	15 526,00	(2 617)
Dez. 23	182	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Morgan Stanley	USD	(31 680 531)	33 725,00	990 781
Okt. 23	2	Dubai IRD FX Future	Newedge Group	USD	48 168	120,26	(64)
Dez. 23	29	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	6 290 825	4 325,50	(18 850)
Dez. 23	6	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Newedge Group	EUR	(843 707)	122,36	67 516
Dez. 23	2	Euro FX Future	Morgan Stanley	USD	267 510	1,06	(2 198)
Dez. 23	596	Euro Stoxx 50 Future	Newedge Group	EUR	26 944 277	4 204,00	(453 991)
Dez. 23	69	Euro Stoxx Bank Future	Morgan Stanley	EUR	398 149	111,95	10 190
Dez. 23	108	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(13 397 788)	115,75	181 106
Dez. 23	97	Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	11 612 527	109,73	(359 359)
Dez. 23	319	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(44 616 139)	128,64	1 230 660
Dez. 23	130	Euro-OAT Future	Newedge Group	EUR	(17 472 874)	123,20	539 959
Dez. 23	155	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(17 279 572)	104,99	74 467
Dez. 23	199	FTSE 100 Index Future	Newedge Group	GBP	18 467 360	7 671,00	157 820
Okt. 23	180	FTSE China A50 Future	Newedge Group	USD	(2 255 897)	12 598,00	(11 743)
Dez. 23	65	FTSE/JSE Top 40 Future	Newedge Group	ZAR	(2 377 999)	67 450,00	62 425
Okt. 23	8	IBEX 35 Index Future	Newedge Group	EUR	794 883	9 440,00	3 552
Mrz. 24	9	ICE 3 Month SONIA Index Future	Newedge Group	GBP	2 594 634	94,61	2 623
Okt. 23	99	IFSC Nifty 50 Future	Newedge Group	USD	3 904 278	19 710,50	(1 599)
Dez. 23	30	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Newedge Group	JPY	29 304 202	144,96	(203 560)
Dez. 23	2	Japanese Yen Future	Morgan Stanley	USD	(172 493)	67,78	3 055
Dez. 23	41	KOSDAQ150 Index Future	Newedge Group	KRW	421 777	1 330,00	(17 672)
Dez. 23	150	KOSPI2 Index Future	Newedge Group	KRW	(9 383 911)	329,00	240 959
Dez. 23	144	Long Gilt Future	Newedge Group	GBP	16 605 426	94,16	(62 042)
Dez. 23	7	Mexican Peso Future	Morgan Stanley	USD	198 954	5,67	(434)
Dez. 23	16	MSCI EAFE Index Future	Citi Bank	USD	(1 691 965)	2 041,50	58 765
Dez. 23	169	MSCI Emerging Market Index Future	Citi Bank	USD	(8 362 618)	955,50	288 643
Okt. 23	0	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	571	282,40	(571)
Okt. 23	149	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	(3 060 951)	285,65	(52 571)
Dez. 23	9	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	2 739 095	14 866,50	(63 125)
Dez. 23	1	New Zealand Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(59 245)	60,02	(770)
Dez. 23	3	Nikkei 225 (OSE) Future	Newedge Group	JPY	662 540	31 860,00	(22 952)
Dez. 23	31	Nikkei 225 (YEN) Future	Morgan Stanley	JPY	(3 374 030)	31 825,00	73 123
Okt. 23	51	OMXS30 Index Future	Newedge Group	SEK	(1 013 091)	2 160,00	4 813
Dez. 23	239	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(22 302 080)	1 798,60	808 810

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Marktpreis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)</b>							
Dez. 23	10	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	2 605 300	2 520,40	(84 900)
Dez. 23	29	S&P/TSX 60 Index Future	Citi Bank	CAD	5 184 237	1 176,30	(161 200)
Dez. 23	22	SET 50 Index Future	Newedge Group	THB	110 989	901,60	(2 042)
Dez. 23	58	Short-Term Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	6 437 743	104,15	(51 213)
Dez. 23	150	South Korea 10 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	12 041 411	107,90	(47 191)
Dez. 23	16	South Korea 3 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	1 222 232	103,05	(356)
Dez. 23	66	SPI 200 Future	Newedge Group	AUD	7 654 159	7 086,00	(136 852)
Dez. 23	3	Stoxx 600 Bank Future	Newedge Group	EUR	(24 824)	162,05	(875)
Dez. 23	99	Stoxx Europe 600 Future	Newedge Group	EUR	2 402 334	453,20	(30 563)
Dez. 23	1	Swiss Franc Future	Morgan Stanley	USD	140 994	110,16	(3 294)
Okt. 23	71	TAIEX Future	Newedge Group	TWD	7 373 033	16 367,00	(173 287)
Dez. 23	44	Topix Index Future	Newedge Group	JPY	(6 907 388)	2 323,50	66 247
Dez. 23	1	UD Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	104 340	105,82	1 475
Dez. 23	427	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	47 281 344	108,06	(1 138 657)
Dez. 23	38	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(4 397 336)	111,56	157 961
Dez. 23	98	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	19 958 844	101,36	(93 172)
Dez. 23	4	US 3 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	832 109	103,14	(6 953)
Dez. 23	220	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(23 382 241)	105,36	203 179
Okt. 23	20	US Dollar Index Future	Newedge Group	KRW	196 532	1 349,00	3 409
Dez. 23	64	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(7 684 805)	113,78	402 805
Dez. 23	34	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(4 338 688)	118,69	303 313
Okt. 23	144	VSTOXX Mini Future	Newedge Group	EUR	(252 212)	17,70	(17 260)
Dez. 23	15	WIG20 Index Future	Newedge Group	PLN	(136 793)	1 944,00	3 296
						<b>USD</b>	<b>3 214 574</b>
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa</b>							
Okt. 23	55	30 Day Fed Funds Future	Morgan Stanley	USD	(21 686 214)	94,67	(11 303)
Dez. 23	183	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(13 515 865)	111,97	341 165
Dez. 23	24	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	1 637 996	105,34	(12 497)
Dez. 23	21	Canada 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	1 812 310	115,13	(32 277)
Dez. 23	2	Canada 5 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	(160 869)	107,98	1 870
Dez. 23	18	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	3 916 625	4 325,50	(23 675)
Dez. 23	17	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(2 218 724)	122,36	19 517
Dez. 23	36	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(4 449 701)	115,75	44 140
Dez. 23	4	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(473 130)	109,73	9 082
Dez. 23	10	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(1 383 840)	128,64	23 793
Dez. 23	40	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(5 330 506)	123,20	120 379
Dez. 23	318	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	35 330 251	104,99	(32 037)
Okt. 23	140	FTSE China A50 Future	Morgan Stanley	USD	(1 772 050)	12 598,00	8 330
Dez. 23	89	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(10 348 022)	94,16	123 291
Dez. 23	61	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(6 402 250)	2 041,50	175 675
Okt. 23	1	MSCI Singapore Index ETS Future	Morgan Stanley	SGD	(20 505)	285,65	(391)
Dez. 23	2	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(187 245)	1 798,60	7 385
Dez. 23	4	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	(629 617)	2 323,50	7 695
Dez. 23	199	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	21 818 530	108,06	(314 092)
Dez. 23	4	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	453 719	111,56	(7 469)
Dez. 23	140	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	28 357 930	101,36	21 602
Dez. 23	279	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	29 298 808	105,36	96 457
Dez. 23	61	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	7 535 914	113,78	(595 258)
Dez. 23	75	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(9 318 984)	118,69	417 422
						<b>USD</b>	<b>388 804</b>

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Optionskontrakte

Optionskontrakte wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der Marktwert ist in der Nettovermögensaufstellung unter «Optionen und Swaptions zum Marktwert» aufgeführt, sofern er nicht 0 beträgt.

Zum 30. September 2023 waren die folgenden Teilfonds in offenen Optionskontrakten auf Finanzindizes und international notierte Aktien engagiert:

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA BlueTrend</b>						
(5 006 764)	Put auf UBS ETC Linked to a Systematica Strategy Delta-1 Basket on Commodity Future Ausübungskurs 56,57 Läuft am 02. Okt. 2023 ab	UBS	USD	(26 263)	-	26 263
				<b>USD</b>	<b>-</b>	<b>26 263</b>
<b>Schroder GAIA Contour Tech Equity</b>						
(251)	Call auf Meta Platforms, Inc. Ausübungskurs 305,00 Läuft am 19. Jan. 2024 ab	Morgan Stanley	USD	(714 331)	(639 423)	74 908
(239)	Call auf Netflix, Inc. Ausübungskurs 430,00 Läuft am 19. Jan. 2024 ab	Bank of America	USD	(917 503)	(393 155)	524 348
250	Call auf NVIDIA Corp. Ausübungskurs 500,00 Läuft am 19. Jan. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	748 670	563 750	(184 920)
(250)	Call auf NVIDIA Corp. Ausübungskurs 780,00 Läuft am 17. Jan. 2025 ab	Goldman Sachs	USD	(587 750)	(583 750)	4 000
344	Call auf Zillow Group, Inc. Ausübungskurs 60,00 Läuft am 16. Feb. 2024 ab	Bank of America	USD	193 672	44 548	(149 124)
				<b>USD</b>	<b>(1 008 030)</b>	<b>269 212</b>
<b>Schroder GAIA Helix</b>						
125	Put auf Deutsche Boerse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 14.900,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	UBS	EUR	82 313	45 493	(36 820)
125	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 7.300,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	Goldman Sachs	GBP	60 304	24 793	(35 511)
61	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 7.400,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	UBS	GBP	29 993	21 778	(8 215)
80	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 7.500,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	Goldman Sachs	GBP	28 854	49 310	20 456
4	Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 14.000,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	UBS	USD	50 039	27 660	(22 379)
25	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.210,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	UBS	USD	103 417	84 750	(18 667)
30	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.300,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	UBS	USD	94 989	191 550	96 561
				<b>USD</b>	<b>445 334</b>	<b>(4 575)</b>
<b>Schroder GAIA SEG US Equity*</b>						
130	Call auf Cloudflare, Inc. Ausübungskurs 100,00 Läuft am 17. Jan. 2025 ab	Goldman Sachs	USD	191 494	102 375	(89 119)
330	Call auf Coherent Corp. Ausübungskurs 55,00 Läuft am 19. Jan. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	201 475	6 600	(194 875)
111	Call auf Estee Lauder Cos., Inc. Ausübungskurs 155,00 Läuft am 16. Jan. 2026 ab	Goldman Sachs	USD	386 907	335 220	(51 687)
47	Call auf Illumina, Inc. Ausübungskurs 200,00 Läuft am 16. Jan. 2026 ab	Goldman Sachs	USD	142 845	102 225	(40 620)

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA SEG US Equity* (Forts.)</b>						
1 813	Call auf Intel Corp. Ausübungskurs 30,00 Läuft am 17. Jan. 2025 ab	Goldman Sachs	USD	1 632 709	1 758 610	125 901
206	Call auf JPMorgan Chase & Co. Ausübungskurs 130,00 Läuft am 19. Jan. 2025 ab	Goldman Sachs	USD	649 009	669 500	20 491
176	Call auf PayPal Holdings, Inc. Ausübungskurs 70,00 Läuft am 16. Jan. 2026 ab	Goldman Sachs	USD	270 757	223 080	(47 677)
1 621	Call auf VF Corp. Ausübungskurs 32,50 Läuft am 17. Jan. 2025 ab	Goldman Sachs	USD	181 599	105 365	(76 234)
				<b>USD</b>	<b>3 302 975</b>	<b>(353 820)</b>
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa</b>						
586	Call auf Canadian Natural Resources Ltd. Ausübungskurs 67,50 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	75 805	35 160	(40 645)
9 900	Call auf China Vanke Co., Ltd. Ausübungskurs 16,11 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	CNY	834	13	(821)
(9 900)	Call auf China Vanke Co., Ltd. Ausübungskurs 19,04 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	CNY	(203)	(5)	198
217 478	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 10,50 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	EUR	89 154	211 548	122 394
1 090 000	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 94,70 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	AUD	7 569	11 614	4 045
657 000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,81 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Barclays Bank	EUR	6 228	684	(5 544)
633 000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,82 Läuft am 04. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	EUR	6 500	6	(6 494)
659 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,06 Läuft am 26. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	EUR	5 675	4 324	(1 351)
657 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,07 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Citi Bank	EUR	5 378	1 849	(3 529)
656 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,07 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Barclays Bank	EUR	9 629	6 029	(3 600)
637 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,10 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	Citi Bank	EUR	9 844	240	(9 604)
2 826 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Läuft am 21. Mrz. 2024 ab	Bank of America	EUR	20 907	16 960	(3 947)
3 095 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,14 Läuft am 12. Okt. 2023 ab	Goldman Sachs	EUR	21 650	-	(21 650)
568 000	Call auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,94 Läuft am 11. Okt. 2023 ab	Citi Bank	GBP	6 725	22	(6 703)
542 000	Call auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,95 Läuft am 04. Okt. 2023 ab	UBS	GBP	6 463	4	(6 459)
571 000	Call auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 180,48 Läuft am 26. Okt. 2023 ab	Bank of America	GBP	7 080	9 443	2 363
1 170 000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,60 Läuft am 26. Okt. 2023 ab	Citi Bank	NZD	7 702	9 211	1 509

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
1 504 000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,00 Läuft am 07. Feb. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	62 911	64 927	2 016
1 507 000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,02 Läuft am 21. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	40 901	35 576	(5 325)
971 000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,21 Läuft am 29. Sep. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	11 603	-	(11 603)
883 000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,23 Läuft am 21. Dez. 2023 ab	HSBC	USD	9 594	13 493	3 899
764 000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,49 Läuft am 08. Mrz. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	12 837	11 814	(1 023)
1 491 000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,52 Läuft am 01. Apr. 2024 ab	Barclays Bank	USD	24 870	25 497	627
693 000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,34 Läuft am 07. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	8 732	12 732	4 000
704 000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,34 Läuft am 19. Dez. 2023 ab	Bank of America	USD	7 982	11 222	3 240
684 000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,36 Läuft am 04. Okt. 2023 ab	Citi Bank	USD	4 362	1 583	(2 779)
696 000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,87 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	UBS	USD	11 000	33 632	22 632
699 000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,89 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Barclays Bank	USD	9 684	19 257	9 573
(2 621 000)	Call auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,95 Verfallstermin 23. Nov. 2023	Goldman Sachs	USD	(28 624)	(2 571)	26 053
1 502 000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,21 Läuft am 16. Feb. 2024 ab	J.P. Morgan	USD	28 163	24 700	(3 463)
753 000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,45 Läuft am 21. Feb. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	5 182	4 056	(1 126)
(1 058 000)	Call auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 3.993,00 Läuft am 23. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(18 537)	(35 290)	(16 753)
(1 061 000)	Call auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4.030,00 Läuft am 12. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(19 319)	(23 003)	(3 684)
675 000	Call auf USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 21,88 Läuft am 06. Okt. 2023 ab	Barclays Bank	USD	10 976	34 977	24 001
1 781 000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 361,05 Läuft am 19. Okt. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	25 112	46 486	21 374
1 052 000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 362,30 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Bank of America	USD	15 272	24 454	9 182
1 046 000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 364,15 Läuft am 06. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	17 333	15 169	(2 164)
1 777 000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 364,70 Läuft am 23. Okt. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	26 077	36 951	10 874
867 000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 386,45 Läuft am 06. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	11 655	5 279	(6 376)

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
(1 518 000)	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 397,40 Läuft am 22. Dez. 2023 ab	Bank of America	USD	(17 657)	(14 330)	3 327
626 000	Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 15.225,00 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	Citi Bank	USD	9 240	11 255	2 015
629 000	Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 15.382,00 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	7 907	9 348	1 441
(1 513 000)	Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,63 Läuft am 05. Feb. 2024 ab	Bank of America	USD	(43 181)	(72 877)	(29 696)
1 036 000	Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,83 Läuft am 31. Okt. 2023 ab	Bank of America	USD	12 309	9 383	(2 926)
(3 027 000)	Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,83 Läuft am 07. Dez. 2023 ab	Citi Bank	USD	(62 977)	(42 917)	20 060
(1 518 000)	Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 4,00 Läuft am 27. Mrz. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	(15 217)	(15 289)	(72)
626 000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,01 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	UBS	USD	5 471	3 662	(1 809)
629 000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,34 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	4 866	4 737	(129)
2 993 000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,74 Läuft am 06. Mrz. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	36 627	34 276	(2 351)
686 000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 142,11 Läuft am 13. Nov. 2023 ab	Barclays Bank	USD	12 883	30 606	17 723
3 390 000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 145,00 Läuft am 22. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	36 493	91 817	55 324
709 000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 145,67 Läuft am 11. Okt. 2023 ab	UBS	USD	7 912	17 389	9 477
697 000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 145,95 Läuft am 21. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	12 667	16 142	3 475
(1 052 000)	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 147,00 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Standard Chartered Bank	USD	(10 871)	(17 618)	(6 747)
(1 036 000)	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 148,50 Läuft am 31. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(11 288)	(11 500)	(212)
3 146 000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 17,44 Läuft am 15. Jan. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	100 288	107 303	7 015
(1 046 000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 17,63 Läuft am 06. Okt. 2023 ab	HSBC	USD	(16 745)	(3 820)	12 925
(2 069 000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,01 Läuft am 25. Okt. 2023 ab	Bank of America	USD	(12 718)	(10 845)	1 873
(2 173 000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,11 Läuft am 05. Okt. 2023 ab	Bank of America	USD	(18 699)	(1 083)	17 616
1 044 000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,23 Läuft am 14. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	10 983	12 905	1 922
1 518 000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,29 Läuft am 25. Mrz. 2024 ab	Bank of America	USD	20 961	22 007	1 046



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
1 061 000	Call auf USD/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,68 Läuft am 12. Okt. 2023 ab	HSBC	USD	14 615	9 187	(5 428)
1 058 000	Call auf USD/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,77 Läuft am 23. Okt. 2023 ab	Barclays Bank	USD	13 627	8 491	(5 136)
(2 833 000)	Call auf USD/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 11,25 Läuft am 10. Jan. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	(55 045)	(23 862)	31 183
618 000	Call auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 56,72 Läuft am 04. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	8 053	7 955	(98)
626 000	Call auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,34 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	Citi Bank	USD	5 974	12 944	6 970
629 000	Call auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,36 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	5 838	6 580	742
(1 502 000)	Call auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 36,50 Läuft am 22. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(25 411)	(21 099)	4 312
908 000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,71 Läuft am 25. Okt. 2023 ab	UBS	USD	11 386	20 345	8 959
871 000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 20,23 Läuft am 21. Dez. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	10 403	8 802	(1 601)
1 518 000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 20,41 Läuft am 22. Dez. 2023 ab	Citi Bank	USD	18 596	13 410	(5 186)
430	Call auf Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd. Ausübungskurs 320,65 Läuft am 29. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	346	313	(33)
(430)	Call auf Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd. Ausübungskurs 349,80 Läuft am 29. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	(133)	(117)	16
348	Call auf JD.com, Inc. Ausübungskurs 37,50 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	66 241	13 746	(52 495)
(348)	Call auf JD.com, Inc. Ausübungskurs 42,50 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(28 609)	(5 220)	23 389
782	Call auf JD.com, Inc. Ausübungskurs 145,86 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	J.P. Morgan	HKD	758	217	(541)
(782)	Call auf JD.com, Inc. Ausübungskurs 165,75 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	J.P. Morgan	HKD	(338)	(91)	247
1 470	Call auf JD.com, Inc. Ausübungskurs 165,88 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	2 579	171	(2 408)
(1 470)	Call auf JD.com, Inc. Ausübungskurs 187,52 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	(1 600)	(79)	1 521
85	Call auf Kweichow Moutai Co., Ltd. Ausübungskurs 1.988,82 Läuft am 29. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	CNY	147	58	(89)
(85)	Call auf Kweichow Moutai Co., Ltd. Ausübungskurs 2.169,62 Läuft am 29. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	CNY	(4)	(2)	2
3 571	Call auf Li Ning Co., Ltd. Ausübungskurs 47,01 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	HKD	2 168	142	(2 026)
(3 571)	Call auf Li Ning Co., Ltd. Ausübungskurs 53,73 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	HKD	(1 199)	(51)	1 148



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
1 922	Call auf Panasonic Holdings Corp. Ausübungskurs 1.938,20 Läuft am 08. Dez. 2023 ab	J.P. Morgan	JPY	444	192	(252)
4 700	Call auf Ping An Insurance Group Co. of China, Ltd. Ausübungskurs 54,89 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	1 617	343	(1 274)
(4 700)	Call auf Ping An Insurance Group Co. of China, Ltd. Ausübungskurs 62,38 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	(713)	(100)	613
2 700	Call auf Shanghai International Airport Co., Ltd. Ausübungskurs 50,90 Läuft am 30. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	CNY	411	5	(406)
(2 700)	Call auf Shanghai International Airport Co., Ltd. Ausübungskurs 57,84 Läuft am 30. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	CNY	(77)	(1)	76
540	Call auf Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd. Ausübungskurs 322,13 Läuft am 30. Okt. 2023 ab	Goldman Sachs	CNY	498	1	(497)
(540)	Call auf Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd. Ausübungskurs 381,78 Läuft am 30. Okt. 2023 ab	Goldman Sachs	CNY	(25)	-	25
460	Call auf Tencent Holdings Ltd. Ausübungskurs 332,86 Läuft am 29. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	HKD	338	359	21
(460)	Call auf Tencent Holdings Ltd. Ausübungskurs 363,12 Läuft am 29. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	HKD	(123)	(128)	(5)
1 090 000	Put auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 94,70 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	AUD	7 569	2 947	(4 622)
3 685 000	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,64 Läuft am 17. Okt. 2023 ab	Bank of America	AUD	26 829	21 972	(4 857)
3 700 000	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,64 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	HSBC	AUD	26 874	22 585	(4 289)
657 000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,81 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Barclays Bank	EUR	6 228	17 165	10 937
633 000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,82 Läuft am 04. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	EUR	6 500	21 041	14 541
3 366 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,05 Läuft am 31. Okt. 2023 ab	UBS	EUR	30 471	22 549	(7 922)
659 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,06 Läuft am 26. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	EUR	5 675	6 202	527
657 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,07 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Citi Bank	EUR	5 378	8 411	3 033
656 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,07 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Barclays Bank	EUR	9 629	12 436	2 807
3 228 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,08 Läuft am 04. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	EUR	27 355	76 583	49 228
637 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,10 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	Citi Bank	EUR	9 843	25 481	15 638
568 000	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,94 Läuft am 11. Okt. 2023 ab	Citi Bank	GBP	6 725	16 847	10 122

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
542 000	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,95 Läuft am 04. Okt. 2023 ab	UBS	GBP	6 463	19 366	12 903
571 000	Put auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 180,48 Läuft am 26. Okt. 2023 ab	Bank of America	GBP	7 080	4 995	(2 085)
1 233 000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,18 Läuft am 25. Mrz. 2024 ab	Bank of America	GBP	13 892	14 887	995
2 798 000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,25 Läuft am 10. Okt. 2023 ab	Bank of America	GBP	32 056	81 977	49 921
2 399 000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,25 Läuft am 12. Okt. 2023 ab	HSBC	GBP	26 432	73 947	47 515
4 020 000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,59 Läuft am 17. Okt. 2023 ab	UBS	NZD	27 285	9 061	(18 224)
4 040 000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,59 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Bank of America	NZD	26 902	9 257	(17 645)
1 170 000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,60 Läuft am 26. Okt. 2023 ab	Citi Bank	NZD	7 702	5 713	(1 989)
(764 000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,78 Läuft am 08. Mrz. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	(10 114)	(7 326)	2 788
(1 491 000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,80 Verfallstermin 01. Apr. 2024	Barclays Bank	USD	(19 562)	(17 740)	1 822
1 504 000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,00 Läuft am 07. Feb. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	55 504	31 970	(23 534)
1 507 000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,02 Läuft am 21. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	40 901	24 870	(16 031)
693 000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,34 Läuft am 07. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	8 732	1 239	(7 493)
704 000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,34 Läuft am 19. Dez. 2023 ab	Bank of America	USD	7 982	4 487	(3 495)
684 000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,36 Läuft am 04. Okt. 2023 ab	Citi Bank	USD	4 362	2 206	(2 156)
696 000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,87 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	UBS	USD	11 000	140	(10 860)
699 000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,89 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Barclays Bank	USD	9 684	3 574	(6 110)
(3 861 000)	Put auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,92 Verfallstermin 27. Okt. 2023	Bank of America	USD	(159 178)	(48 065)	111 113
(2 621 000)	Put auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,93 Verfallstermin 23. Nov. 2023	Goldman Sachs	USD	(111 028)	(65 840)	45 188
753 000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,99 Läuft am 21. Feb. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	5 041	2 191	(2 850)
1 502 000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,21 Läuft am 16. Feb. 2024 ab	J.P. Morgan	USD	26 495	16 489	(10 006)
(1 058 000)	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 3.993,00 Läuft am 23. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(18 537)	(6 072)	12 465

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
(1 061 000)	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4.030,00 Läuft am 12. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(19 319)	(6 175)	13 144
675 000	Put auf USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 21,88 Läuft am 06. Okt. 2023 ab	Barclays Bank	USD	10 976	1	(10 975)
1 518 000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 361,95 Läuft am 22. Dez. 2023 ab	Bank of America	USD	13 425	18 687	5 262
1 052 000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 362,30 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Bank of America	USD	15 272	4 508	(10 764)
1 046 000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 364,15 Läuft am 06. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	17 333	2 473	(14 860)
626 000	Put auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 15.225,00 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	Citi Bank	USD	9 240	1 116	(8 124)
629 000	Put auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 15.382,00 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	7 907	5 182	(2 725)
(1 513 000)	Put auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,63 Läuft am 05. Feb. 2024 ab	Bank of America	USD	(39 338)	(11 569)	27 769
(1 518 000)	Put auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,63 Läuft am 27. Mrz. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	(14 741)	(15 829)	(1 088)
1 036 000	Put auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,83 Läuft am 31. Okt. 2023 ab	Bank of America	USD	12 309	15 411	3 102
(3 027 000)	Put auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,83 Läuft am 07. Dez. 2023 ab	Citi Bank	USD	(58 316)	(63 900)	(5 584)
1 616 000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 81,34 Läuft am 06. Dez. 2023 ab	Bank of America	USD	6 459	995	(5 464)
626 000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,01 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	UBS	USD	5 472	1 863	(3 609)
629 000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,34 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	4 866	4 104	(762)
2 993 000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,74 Läuft am 06. Mrz. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	36 627	30 780	(5 847)
785 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 115,00 Läuft am 06. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	53 773	-	(53 773)
3 058 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 137,00 Läuft am 18. Mrz. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	31 161	23 828	(7 333)
686 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 142,11 Läuft am 13. Nov. 2023 ab	Barclays Bank	USD	12 876	1 485	(11 391)
709 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 145,67 Läuft am 11. Okt. 2023 ab	UBS	USD	7 912	470	(7 442)
697 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 145,95 Läuft am 21. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	12 667	8 949	(3 718)
(1 052 000)	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 147,00 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Standard Chartered Bank	USD	(10 871)	(3 043)	7 828
(1 036 000)	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 148,50 Läuft am 31. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(11 288)	(9 697)	1 591

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
1 518 000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 17,10 Läuft am 25. Mrz. 2024 ab	Bank of America	USD	19 915	18 359	(1 556)
3 146 000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 17,44 Läuft am 15. Jan. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	91 026	54 384	(36 642)
(1 046 000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 17,63 Läuft am 06. Okt. 2023 ab	HSBC	USD	(16 745)	(14 845)	1 900
(2 833 000)	Put auf USD/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 9,70 Läuft am 10. Jan. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	(55 045)	(4 686)	50 359
1 061 000	Put auf USD/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,68 Läuft am 12. Okt. 2023 ab	HSBC	USD	14 615	8 706	(5 909)
1 058 000	Put auf USD/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,77 Läuft am 23. Okt. 2023 ab	Barclays Bank	USD	13 627	17 198	3 571
618 000	Put auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 56,72 Läuft am 04. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	8 053	5 265	(2 788)
626 000	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,34 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	Citi Bank	USD	5 974	328	(5 646)
629 000	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,36 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	5 838	4 111	(1 727)
(1 502 000)	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 36,50 Läuft am 22. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(24 598)	(29 325)	(4 727)
(1 518 000)	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,45 Läuft am 22. Dez. 2023 ab	Citi Bank	USD	(15 218)	(20 457)	(5 239)
(348)	Put auf JD.com, Inc. Ausübungskurs 27,50 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(19 700)	(48 546)	(28 846)
(1 470)	Put auf JD.com, Inc. Ausübungskurs 100,97 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	(723)	(623)	100
(782)	Put auf JD.com, Inc. Ausübungskurs 106,08 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	J.P. Morgan	HKD	(218)	(478)	(260)
(3 571)	Put auf Li Ning Co., Ltd. Ausübungskurs 38,06 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	HKD	(968)	(2 757)	(1 789)
296 000	Put auf MUFG Bank Ltd. Ausübungskurs 1.253,83 Läuft am 13. Okt. 2023 ab	J.P. Morgan	JPY	48 324	41 682	(6 642)
(9)	Put auf NASDAQ-100 Reduced Value Index Ausübungskurs 2.620,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(14 235)	(2 880)	11 355
75	Put auf NASDAQ-100 Reduced Value Index Ausübungskurs 2.805,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	158 803	105 000	(53 803)
8	Put auf NASDAQ-100 Reduced Value Index Ausübungskurs 2.870,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	26 003	21 840	(4 163)
(4 700)	Put auf Ping An Insurance Group Co. of China, Ltd. Ausübungskurs 39,92 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	(470)	(649)	(179)
(2 700)	Put auf Shanghai International Airport Co., Ltd. Ausübungskurs 39,33 Läuft am 30. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	CNY	(129)	(1 313)	(1 184)
				<b>USD</b>	<b>1 476 603</b>	<b>275 180</b>

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Swaptions

Swaptions wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der Marktwert ist in der Nettovermögensaufstellung unter «Optionen und Swaptions zum Marktwert» aufgeführt.

Zum 30. September 2023 waren die folgenden Teilfonds in offenen Swaptions auf Finanzindizes und international notierte Aktien engagiert:

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa</b>								
Kauf	IRS "Zahlt Festzinssatz 7,69% Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2026", Put 7,69%, 13. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	384 124	157 510 000	412 995	28 872	
Kauf	IRS "Zahlt Festzinssatz 8,50% Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028", Put 8,50%, 06. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95 925	17 150 000	65 824	(30 101)	
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 6,80% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Feb 2025", Call 6,80%, 04. Feb. 2030	J.P. Morgan	MXN	541 676	228 495 000	13 958	(527 718)	
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 7,06% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Jun 2024", Call 7,06%, 26. Jun. 2024	J.P. Morgan	MXN	195 967	188 310 000	3 268	(192 699)	
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 7,29% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2026", Call 7,29%, 05. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	396 524	157 510 000	46 095	(350 429)	
Kauf	SWP "Erhält Festzinssatz 7,95% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2024", Call 7,95%, 13. Mrz. 2024	J.P. Morgan	MXN	210 150	332 045 000	3 648	(206 502)	
Kauf	SWP "Erhält Festzinssatz 8,05% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Jul 2028", Call 8,05%, 06. Apr. 2028"	J.P. Morgan	MXN	73 126	17 150 000	20 247	(52 879)	
Verkauf	SWP "Erhält Festzinssatz 7,20% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2024", Call 7,20%, 13. Mrz. 2024	J.P. Morgan	MXN	(61 294)	332 045 000	(675)	60 619	
						<b>USD</b>	<b>565 360</b>	<b>(1 270 837)</b>

## Total Return Swapkontrakte

Der Fonds darf Total Return Swaps abschließen. Ein Total Return Swap ist ein bilateraler finanzieller Vertrag, der es dem Fonds ermöglicht, von allen Cash-Flow-Vorteilen einer Anlage zu profitieren, ohne diese Anlage tatsächlich zu besitzen (die «Referenzanlage»). Die Teilfonds müssen eine periodische Prämie (feste oder variable Bezahlung) für ihre Rechte darauf bezahlen, die Gesamtrendite der Referenzanlagen (Coupons und/oder Kapitalgewinne und/oder -verluste) zu erhalten. Bei der Referenzanlage kann es sich um fast jede beliebige Anlage handeln, die eine für die Teilfonds zulässige Anlage darstellt. Die Teilfonds können solche Instrumente für die Aufnahme von Positionen in einem qualifizierten Markt oder zu Absicherungszwecken einsetzen.

Die Total Return Swaps wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Gewinn oder Verlust aus Total-Return-Swaps zum Ende des Geschäftsjahres ist durch die Werte der auf Grundlage der Zinssätze der jeweiligen Swap-Kontrakte zu erhaltenden (oder zu zahlenden) Zinsen, abzüglich (bzw. zuzüglich) dem Wert der zu zahlenden (bzw. zu erhaltenden) Leistung, die auf dem Gesamtertragswert der Basiswerte beruht, dargestellt. Letzterer setzt sich aus dem aktuellen beizulegenden Zeitwert der Aktien und den für diese Aktien für das betreffende Swap-Jahr ausgeschütteten Dividenden zusammen. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter «Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Total Return Swapkontrakten» aufgeführt.

Zum 30. September 2023 waren folgende Teilfonds in Total Return Swapkontrakten engagiert:

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Egerton Equity</b>						
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	GBP	3 580 246	21. Aug. 2024	847 342
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	18 163 655	28. Feb. 2025	3 286 569
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	EUR	16 970 926	21. Mrz. 2024	1 038 568
Kauf Long	Bekleidung	Morgan Stanley	EUR	4 520 431	28. Feb. 2025	49 485

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)</b>						
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	GBP	16 464 919	28. Feb. 2025	895 114
Kauf Long	Baustoffe	J.P. Morgan	GBP	5 055 136	11. Okt. 2024	225 287
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	GBP	3 329 284	15. Mai 2025	5 556
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	GBP	11 029 469	07. Aug. 2024	(2 295 308)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	CHF	8 432 807	18. Jun. 2024	(1 133 622)
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	USD	1 480 293	18. Okt. 2024	85 008
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	714 179	30. Apr. 2024	(68 975)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	373 475	28. Feb. 2025	(91 400)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	894 229	28. Apr. 2026	139 898
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1 385 657	03. Jun. 2024	387 490
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	831 111	28. Feb. 2025	(73)
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	SEK	1 063 280	12. Aug. 2026	215 746
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 100 753	24. Jul. 2024	505 768
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	925 421	26. Aug. 2025	(93 913)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	1 952 489	05. Jun. 2024	(69 596)
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Merrill Lynch	USD	1 816 316	30. Aug. 2024	11 118
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1 056 598	27. Mrz. 2024	97 013
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley	USD	1 587 109	28. Feb. 2025	274 895
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	1 628 982	28. Feb. 2025	179 691
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	726 459	04. Sep. 2024	252 354
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Merrill Lynch	USD	524 470	28. Jun. 2024	43 613
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	3 110 384	16. Jan. 2024	372 634
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	623 834	31. Okt. 2024	41 856
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Morgan Stanley	HKD	1 210 958	26. Feb. 2025	82 461
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Morgan Stanley	USD	1 596 880	28. Feb. 2025	126 126
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	1 153 630	28. Apr. 2026	123 213
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	1 106 755	18. Sep. 2025	242 049
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	1 012 113	28. Okt. 2024	18 775
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	1 041 105	31. Okt. 2024	41 547
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	796 119	26. Aug. 2024	(22 563)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	415 995	28. Feb. 2025	13 708
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	J.P. Morgan	USD	781 890	22. Jul. 2024	(112 065)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	1 999 302	28. Feb. 2025	(21 358)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Merrill Lynch	USD	784 617	28. Jun. 2024	(77 555)
Verkauf Short	Haushaltswaren	Morgan Stanley	USD	2 298 715	28. Feb. 2025	282 408
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	USD	653 625	27. Feb. 2025	(22 974)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	787 446	20. Mai 2024	(105 063)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	793 983	31. Okt. 2024	20 253
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	1 610 299	28. Feb. 2025	(123 187)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	1 447 675	28. Feb. 2025	403
Verkauf Short	Freizeit	Merrill Lynch	USD	824 720	31. Okt. 2024	(35 607)
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	Merrill Lynch	USD	607 420	31. Jul. 2024	117 945
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	SEK	1 114 591	09. Jul. 2025	149 912
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	USD	980 241	06. Mai 2024	85 741
Verkauf Short	Medien	J.P. Morgan	USD	845 169	07. Okt. 2024	63 890
Verkauf Short	Medien	Merrill Lynch	USD	2 416 312	30. Aug. 2024	144 629
Verkauf Short	Büro- und Geschäftsausstattung	Morgan Stanley	JPY	1 671 255	28. Feb. 2025	136 339
Verkauf Short	Verpackung und Behälter	J.P. Morgan	USD	1 930 976	28. Okt. 2024	412 063
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	941 150	23. Feb. 2024	(212 679)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1 641 677	28. Feb. 2025	158 867



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)</b>						
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	1 455 499	28. Feb. 2025	756 475
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	CAD	1 806 593	21. Nov. 2023	146 153
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	1 646 978	29. Dez. 2023	419 986
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	1 968 970	30. Sep. 2024	182 368
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	622 166	31. Okt. 2024	13 889
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	1 467 716	21. Okt. 2024	39 422
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	832 532	31. Okt. 2024	49 118
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	767 168	31. Okt. 2023	(162 339)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	2 486 409	31. Okt. 2024	(189 995)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	SEK	406 152	09. Sep. 2025	96 466
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	USD	1 013 480	07. Nov. 2023	95 536
Verkauf Short	Diverse*	Morgan Stanley	EUR	1 674 841	28. Feb. 2025	201 198
Verkauf Short	Diverse*	Morgan Stanley	USD	33 559 382	28. Feb. 2025	662 671
						<b>EUR 9 000 344</b>
<b>Schroder GAIA Helix</b>						
Kauf Long	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	1 705 056	09. Sep. 2024	(56 626)
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	EUR	27 839 157	09. Sep. 2024	(91 545)
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	USD	49 994 326	09. Sep. 2024	250 823
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	JPY	10 682 042	09. Sep. 2024	67 577
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	125 564 520	09. Sep. 2024	3 540 794
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	JPY	32 536 371	09. Sep. 2024	1 146 489
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	137 107 622	09. Sep. 2024	3 296 118
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	JPY	60 623 502	09. Sep. 2024	843 383
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	6 334 962	09. Sep. 2024	90 723
						<b>USD 9 087 736</b>
<b>Schroder GAIA Sirius US Equity</b>						
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	2 737 449	13. Dez. 2023	(174 472)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	3 041 688	25. Mrz. 2024	(124 474)
Kauf Long	Getränke	Merrill Lynch	USD	2 869 042	21. Nov. 2023	(562 786)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	12 818 418	25. Mrz. 2024	(359 696)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	2 700 458	24. Mai 2024	(111 417)
Kauf Long	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	2 769 888	24. Jul. 2024	(165 308)
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	USD	819 288	28. Jun. 2024	(39 556)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	880 141	07. Okt. 2024	35 639
Verkauf Short	Fluggesellschaften	Merrill Lynch	USD	1 017 651	15. Okt. 2024	83 836
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	109 308	12. Jun. 2024	83 920
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	808 045	25. Mrz. 2024	99 560
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	929 527	15. Apr. 2024	62 015
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	19 732	03. Jun. 2024	10 261
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	11 873	28. Jun. 2024	6 174
Verkauf Short	Baustoffe	Merrill Lynch	USD	96 571	24. Nov. 2023	(4 528)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	580 244	12. Jun. 2024	333 682
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	4 040 674	25. Mrz. 2024	181 504
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	276 827	01. Jul. 2024	71 307
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1 723 514	28. Okt. 2024	(10 059)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	357 137	14. Nov. 2023	(403)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	167 872	12. Sep. 2024	4 444
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	384 641	22. Apr. 2024	17 274
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	476 543	29. Apr. 2024	21 128

\* Der Kontrakt wird auf einen Korb mit verschiedenen amerikanischen Aktien gehalten.



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Wahrung	Nennbetrag	Falligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)</b>						
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	832 247	28 Mai 2024	(23 406)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	883 362	11. Okt. 2024	24 775
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Merrill Lynch	USD	265 319	24. Sep. 2024	(24 014)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	328 807	14. Nov. 2023	32 766
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	788 218	12. Jun. 2024	61 469
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1 771 922	24. Jun. 2024	53 652
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	401 445	15. Jul. 2024	6 427
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	1 381 443	12. Sep. 2024	(149 088)
Verkauf Short	Umweltschutz	Goldman Sachs	USD	796 650	13. Dez. 2023	380 910
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	1 818 178	14. Nov. 2023	195 388
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	3 042 375	13. Dez. 2023	163 374
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	17 333 575	12. Jun. 2024	898 071
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	5 157 084	12. Dez. 2024	(56 585)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	3 809 642	26. Mrz. 2024	276 970
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	8 200	24. Nov. 2023	2 629
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	337 331	24. Sep. 2024	12 625
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	72 064	30. Okt. 2023	4 699
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	495 855	14 Mai 2024	13 282
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	559 598	11. Dez. 2023	15 300
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	662 370	10. Apr. 2024	12 167
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	252 918	24. Jun. 2024	5 090
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	369 678	24. Jul. 2024	80 783
Verkauf Short	Internet	Barclays Bank	USD	1 718 925	03. Nov. 2023	33 568
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	840 360	10. Nov. 2023	(3 421)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	755 728	24. Nov. 2023	136 125
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	242 629	13 Mai 2024	24 555
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	399 236	26. Jul. 2024	(20 012)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	1 118 553	24. Sep. 2024	148 434
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	26 360	29. Okt. 2024	(158)
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Barclays Bank	USD	1 887 690	03. Nov. 2023	20 881
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	USD	878 797	12. Dez. 2024	107 513
Verkauf Short	Medien	Merrill Lynch	USD	881 366	14 Mai 2024	17 534
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	313 846	24. Nov. 2023	23 869
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	176 057	24. Sep. 2024	9 309
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	805 948	24. Okt. 2023	91 806
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	557 829	26. Dez. 2023	23 432
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	364 274	18. Sep. 2024	59 120
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	565 758	12. Jun. 2024	35 721
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	272 840	12. Sep. 2024	10 738
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	1 120 610	25. Mrz. 2024	5 042
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	663 079	01. Jul. 2024	(888)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	257 285	18. Sep. 2024	(24 354)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	295 373	05. Feb. 2024	12 501
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	86 070	01. Jul. 2024	7 563
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	327 285	24. Sep. 2024	13 972
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	703 260	18. Okt. 2024	2 148
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	USD	753 976	16 Mai 2024	22 993
<b>USD</b>						<b>2 203 320</b>

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Two Sigma Diversified</b>						
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	324 114 122	23. Okt. 2023	4 846 767
						<b>USD</b>
						<b>4 846 767</b>
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa</b>						
Kauf Long	Werbung	Goldman Sachs	EUR	37 312	24. Mai 2033	(134)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	8 532	24. Mai 2033	(469)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	158 237	18. Mai 2033	(9 986)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	GBP	46 080	24. Mai 2033	(518)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	GBP	1 575 196	18. Mai 2033	(71 818)
Kauf Long	Automobilhersteller	Goldman Sachs	HKD	140 458	24. Mai 2033	(1 378)
Kauf Long	Automobilhersteller	Goldman Sachs	JPY	338 610	24. Mai 2033	(13 418)
Kauf Long	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	104 773	24. Mai 2033	(4 936)
Kauf Long	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	280 268	18. Mai 2033	952
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	USD	410 469	25. Mai 2033	(14 057)
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	J.P. Morgan	USD	17 495	22. Sep. 2025	(2 483)
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	66 755	19. Mai 2033	(1 703)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	75 518	24. Mai 2033	(3 325)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	JPY	2 423 121	24. Mai 2033	(97 662)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	5 332 747	24. Mai 2033	(137 537)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	CAD	1 015 003	05. Mai 2028	(27 785)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	682 252	05. Mai 2028	(2 800)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	GBP	905 563	05. Mai 2028	51 852
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	17 319	20. Dez. 2024	717
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	111 031	20. Aug. 2025	10 868
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	390 966	08. Mai 2028	8 584
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	CAD	1 738 894	18. Mai 2033	(75 427)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	EUR	1 589 597	18. Mai 2033	(17 953)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	HUF	372 515	18. Mai 2033	(34 599)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	JPY	504 306	18. Mai 2033	(19 801)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	8 399 923	18. Mai 2033	(347 903)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	298 228	24. Mai 2033	(12 638)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	134 976	24. Mai 2033	4 137
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	1 962 706	24. Mai 2033	(49 684)
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	262 835	05. Mai 2028	(24 977)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	245 673	18. Mai 2033	(14 584)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	4 871 262	18. Mai 2033	(85 644)
Kauf Long	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	279 445	24. Mai 2033	(5 691)
Kauf Long	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	226 397	18. Mai 2033	(1 410)
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	EUR	402 928	24. Mai 2033	(6 947)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	110 642	24. Mai 2033	(2 481)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	223 589	18. Mai 2033	(56 872)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	977 511	18. Mai 2033	(132 252)
Kauf Long	Commodity Fund	Morgan Stanley	USD	875 583	18. Mai 2033	(14 505)
Kauf Long	Computer	Goldman Sachs	JPY	81 841	24. Mai 2033	(717)
Kauf Long	Vertrieb/Grosshandel	Goldman Sachs	JPY	126 298	24. Mai 2033	(8 340)
Kauf Long	Vertrieb/Grosshandel	Goldman Sachs	USD	242 248	24. Mai 2033	(5 951)
Kauf Long	Vertrieb/Grosshandel	Morgan Stanley	USD	389 880	18. Mai 2033	(1 962)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	525 692	24. Mai 2033	(7 623)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	383 561	05. Mai 2028	(4 142)

\* Der Kontrakt wird auf einen Korb mit verschiedenen auf USD lautenden Aktien gehalten.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	ILS	278 788	05. Mai 2028	29 099
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1 769 250	18. Mai 2033	(55 415)
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	EUR	65 413	24. Mai 2033	592
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	HKD	253 520	08. Apr. 2024	13 286
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	USD	2 404 476	24. Mai 2033	(167 546)
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	EUR	36 096	05. Mai 2028	(122)
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	GBP	75 022	22. Mai 2024	(1 494)
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	HKD	204 230	05. Mai 2028	7 738
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	USD	613 503	05. Mai 2028	(6 125)
Kauf Long	Elektrik	Morgan Stanley	USD	279 488	18. Mai 2033	(18 878)
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	165 669	05. Feb. 2025	(639)
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley	USD	426 149	18. Mai 2033	(10 648)
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	183 776	24. Mai 2033	(1 062)
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	USD	499 632	22. Jul. 2025	(14 474)
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	USD	442 982	05. Mai 2028	(25 781)
Kauf Long	Elektronik	Morgan Stanley	USD	246 436	18. Mai 2033	(5 935)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	JPY	60 497	24. Mai 2033	(1 048)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	530 956	18. Mai 2033	4 717
Kauf Long	Umweltschutz	Morgan Stanley	USD	264 107	18. Mai 2033	(13 638)
Kauf Long	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	679 552	24. Mai 2033	561
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	1 861 665	18. Mai 2033	(3 464)
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	2 009 096	18. Mai 2033	(15 211)
Kauf Long	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	198 084	18. Mai 2033	9 710
Kauf Long	Gas	Goldman Sachs	HKD	663 753	24. Mai 2033	8 240
Kauf Long	Gas	Goldman Sachs	USD	570 367	24. Mai 2033	(58 845)
Kauf Long	Gas	J.P. Morgan	HKD	382 174	05. Mai 2028	32 390
Kauf Long	Gas	Morgan Stanley	USD	251 722	18. Mai 2033	(14 018)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	CHF	62 150	24. Mai 2033	(1 319)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	HKD	2 663	24. Mai 2033	11
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	1 684 745	24. Mai 2033	(27 270)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	91 337	25. Mai 2033	2 439
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	13 008	24. Jun. 2024	(860)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	2 655 151	05. Mai 2028	(99 981)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	CHF	123 927	18. Mai 2033	(5 191)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	HKD	92 313	18. Mai 2033	(383)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	309 035	18. Mai 2033	(10 333)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 585 059	24. Mai 2033	(3 445)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	324 606	26. Aug. 2024	(15 562)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1 071 432	05. Mai 2028	(4 963)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	877 763	18. Mai 2033	6 617
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	864 229	24. Mai 2033	(30 654)
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	526 292	18. Mai 2033	(22 720)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	JPY	521 602	24. Mai 2033	(26 694)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	J.P. Morgan	JPY	177 410	08. Mai 2028	(6 802)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	22 879	18. Mai 2033	(1 269)
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	EUR	2 323 849	05. Mai 2028	20 542
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	GBP	1 112 532	05. Mai 2028	(1 518)
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	USD	70 734	05. Mai 2028	(3 296)

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
Kauf Long	Versicherung	Morgan Stanley	EUR	415 858	18. Mai 2033	(10 816)
Kauf Long	Versicherung	Morgan Stanley	JPY	396 433	18. Mai 2033	(8 886)
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	USD	499 263	24. Mai 2033	(23 488)
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	USD	389 709	05. Mai 2028	(16 955)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	EUR	536 641	18. Mai 2033	17 057
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	HKD	462 777	18. Mai 2033	(3 483)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	941 315	24. Jun. 2025	(88 974)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	2 460 473	18. Mai 2033	(69 971)
Kauf Long	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	USD	324 103	18. Mai 2033	16 937
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	GBP	408 736	05. Jun. 2024	21 821
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	253 468	24. Mai 2033	(15 719)
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	USD	189 994	05. Mai 2028	(3 117)
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	GBP	510 516	18. Mai 2033	4 875
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	JPY	160 786	18. Mai 2033	(8 801)
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	186 072	18. Mai 2033	(3 157)
Kauf Long	Medien	Morgan Stanley	USD	52 599	18. Mai 2033	(3 631)
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	GBP	95 098	24. Mai 2033	1 221
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	SEK	228 514	24. Mai 2033	672
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	GBP	188 669	05. Mai 2028	14 383
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	CAD	52 285	18. Mai 2033	(3 156)
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	386 979	08. Mai 2028	(71 136)
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	287 979	18. Mai 2033	(2 760)
Kauf Long	Öl und Gas	Goldman Sachs	GBP	724 474	01. Mai 2024	3 189
Kauf Long	Öl und Gas	Goldman Sachs	HKD	295 589	24. Mai 2033	(437)
Kauf Long	Öl und Gas	Goldman Sachs	JPY	155 537	24. Mai 2033	(711)
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	EUR	195 250	05. Mai 2028	(20 847)
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	GBP	667 700	21. Feb. 2024	36 192
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	12 604 156	05. Mai 2028	(484 055)
Kauf Long	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	4 590 709	18. Mai 2033	(103 155)
Kauf Long	Öl- und Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	133 861	05. Mai 2028	(5 718)
Kauf Long	Öl- und Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	NOK	516 728	19. Mai 2033	(34 709)
Kauf Long	Öl- und Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	191 702	18. Mai 2033	(7 882)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	384 873	24. Mai 2033	4 005
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	520 796	05. Apr. 2024	(38 932)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	354 001	24. Mai 2033	(29 983)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	383 492	05. Apr. 2024	(10 523)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	268 413	24. Mai 2033	3 700
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	1 169 406	24. Mai 2033	(6 663)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	2 113 601	24. Mai 2033	(50 799)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	168 492	05. Mai 2028	11 385
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	163 995	20. Okt. 2023	5 461
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	14 353	08. Mai 2028	(442)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1 319 438	05. Mai 2028	(55 916)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	181 595	18. Mai 2033	(14 373)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	GBP	151 148	18. Mai 2033	2 206
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	18 773	18. Mai 2033	(519)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1 697 482	18. Mai 2033	(185 491)
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	962 349	05. Mai 2028	11 591

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	485 914	18. Mai 2033	4 340
Kauf Long	Private Equity	Goldman Sachs	USD	467 459	24. Mai 2033	(14 913)
Kauf Long	Private Equity	J.P. Morgan	USD	303 075	05. Mai 2028	(12 138)
Kauf Long	Immobilien	Goldman Sachs	EUR	182 339	24. Mai 2033	(13 805)
Kauf Long	Immobilien	J.P. Morgan	EUR	158 149	05. Mai 2028	(2 029)
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	EUR	322 822	24. Mai 2033	(16 093)
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	USD	376 732	24. Mai 2033	(14 905)
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	USD	603 911	05. Mai 2028	(10 748)
Kauf Long	REITS	Morgan Stanley	EUR	185 281	18. Mai 2033	(2 493)
Kauf Long	REITS	Morgan Stanley	USD	867 882	18. Mai 2033	(28 712)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	157 393	24. Mai 2033	(12 259)
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	948 275	18. Mai 2033	(10 418)
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	308 184	24. Mai 2033	(6 679)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	239 386	05. Mai 2028	(7 564)
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	207 155	18. Mai 2033	(1 469)
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	872 845	24. Mai 2033	(8 838)
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	396 822	05. Mai 2028	(10 282)
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	152 430	19. Mai 2025	(5 423)
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	1 056 869	18. Mai 2033	(35 675)
Kauf Long	Telekommunikation	Goldman Sachs	GBP	242 722	24. Mai 2033	(12 494)
Kauf Long	Telekommunikation	J.P. Morgan	GBP	523 778	05. Mai 2028	(8 642)
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	EUR	660 921	18. Mai 2033	(4 364)
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	USD	447 449	18. Mai 2033	(21 794)
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	26 954 867	25. Mai 2033	100 126
Kauf Long	Wasser	Morgan Stanley	USD	561 712	18. Mai 2033	(60 943)
Verkauf Short	Werbung	Goldman Sachs	USD	119 311	06. Mai 2025	590
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	180 872	24. Mai 2033	5 868
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	477 238	05. Mai 2028	20 261
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	USD	372 433	18. Mai 2033	(4 708)
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	GBP	52 914	05. Apr. 2024	3 411
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	USD	330 448	05. Mai 2028	(7 845)
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	GBP	291 507	18. Mai 2033	29 962
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	EUR	753 547	05. Apr. 2024	28 779
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	1 102 004	24. Mai 2033	16 008
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	EUR	1 830 979	05. Mai 2028	(51 410)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	262 801	18. Mai 2033	(4 419)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	JPY	243 654	18. Mai 2033	11 473
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	939 132	18. Mai 2033	21 725
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	USD	285 448	24. Mai 2033	5 443
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	364 775	18. Mai 2033	2 725
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	1 752 337	24. Mai 2033	(2 670)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	GBP	466 722	11. Jan. 2024	10 943
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	GBP	895 331	24. Mai 2033	(14 212)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	JPY	1 496 345	24. Mai 2033	62 123
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	PLN	499 987	24. Mai 2033	12 662
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SEK	1 046 649	24. Mai 2033	9 400
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	4 995 039	24. Mai 2033	48 861
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	AUD	225 164	22. Jul. 2024	4 998

\* Der Kontrakt wird auf einen Korb mit verschiedenen amerikanischen Aktien gehalten.



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	CZK	368 006	05. Mai 2028	14 981
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	DKK	314 946	05. Mai 2028	(16 222)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	1 174 878	05. Mai 2028	(47 363)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	GBP	463 424	05. Mai 2028	(17 610)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	JPY	9 996	08. Mai 2028	(346)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	PLN	5 121	05. Mai 2028	330
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	1 291 457	22. Mai 2024	(48 673)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	760 796	05. Mai 2028	(23 418)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	1 824 149	05. Mai 2028	96 216
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	AUD	627 699	18. Mai 2033	19 409
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CAD	4 237 123	18. Mai 2033	202 789
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CZK	80 116	18. Mai 2033	1 794
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	EUR	1 701 959	18. Mai 2033	(77 192)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	GBP	221 896	18. Mai 2033	(5 923)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	1 311 596	28. Feb. 2025	26 595
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	289 217	18. Mai 2033	5 661
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	SEK	1 931 385	18. Mai 2033	(10 167)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	SGD	4 259	18. Mai 2033	102
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	6 585 135	18. Mai 2033	157 283
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	HKD	505	24. Mai 2033	(6)
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	USD	136 309	24. Mai 2033	5 041
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	HKD	404	05. Mai 2028	31
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	HKD	7 742	18. Mai 2033	11
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	USD	63 843	18. Mai 2033	3 692
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	CHF	242 946	24. Mai 2033	71 439
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	NOK	10 144	24. Mai 2033	1 857
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	608 144	24. Mai 2033	(24 544)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	264 916	05. Mai 2028	35 587
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	HKD	294 466	18. Mai 2033	13 632
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	NOK	148 877	19. Mai 2033	18 969
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	2 388 777	18. Mai 2033	142 585
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	SEK	87 133	12. Aug. 2026	494
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	377 461	24. Mai 2033	5 857
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	1 842 334	18. Mai 2033	13 997
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	USD	7 049	24. Mai 2033	113
Verkauf Short	Chemie	Morgan Stanley	USD	1 831 953	18. Mai 2033	89 057
Verkauf Short	Kohle	J.P. Morgan	USD	211 446	05. Mai 2028	(28 465)
Verkauf Short	Kohle	Morgan Stanley	USD	47 468	18. Mai 2033	(3 914)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	126 681	12. Jun. 2024	(7 911)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	43 938	28. Mai 2025	1 674
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 226 652	24. Mai 2033	56 253
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1 002 337	05. Mai 2028	63 117
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	3 168 863	18. Mai 2033	117 622
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	NOK	186 299	24. Mai 2033	2 569
Verkauf Short	Computer	J.P. Morgan	USD	137 841	05. Mai 2028	6 056
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	1 155 603	18. Mai 2033	16 109
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	EUR	128 933	24. Mai 2033	5 240
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	J.P. Morgan	EUR	70 921	05. Mai 2028	1 847

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	60 840	18. Mai 2033	2 469
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	JPY	3 086	18. Mai 2033	182
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Goldman Sachs	USD	660 330	24. Mai 2033	(6 603)
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	J.P. Morgan	USD	273 726	05. Mai 2028	9 911
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Morgan Stanley	USD	258 639	18. Mai 2033	(4 517)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	513 121	24. Mai 2033	7 068
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	439 161	04. Jan. 2024	10 386
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	151 585	11. Jan. 2024	914
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	4 534 471	24. Mai 2033	24 244
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	291 030	05. Mai 2028	(7 013)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	386 166	08. Mai 2028	18 210
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	SEK	437 442	05. Mai 2028	28 421
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	SGD	1 943	20. Jun. 2025	(22)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	369 137	05. Mai 2028	8 709
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	CHF	377 599	18. Mai 2033	8 245
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	655 445	18. Mai 2033	35 711
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	224 750	18. Mai 2033	10 818
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	SEK	38 835	18. Mai 2033	2 685
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	SGD	3 617	18. Mai 2033	65
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	7 714 075	18. Mai 2033	390 640
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	1 928 029	24. Mai 2033	117 244
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	EUR	872 657	22. Mai 2024	6 646
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	3 627 552	05. Mai 2028	75 613
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	30 068	20. Mai 2033	(559)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	CAD	428 612	18. Mai 2033	24 764
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	2 601 777	18. Mai 2033	151 141
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	EUR	52 667	24. Mai 2033	1 885
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	96 902	24. Mai 2033	2 336
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley	USD	488 612	18. Mai 2033	(824)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	EUR	227 896	24. Mai 2033	7 602
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	JPY	750 609	24. Mai 2033	27 992
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	208 125	24. Mai 2033	5 509
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	-	25. Mai 2033	-
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	CHF	171 098	05. Mai 2028	(1 146)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	JPY	440	08. Mai 2028	36
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	USD	263 781	05. Mai 2028	5 600
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	17 619	18. Mai 2033	466
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	230 145	18. Mai 2033	4 208
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	DKK	408 587	24. Mai 2033	17 196
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	EUR	64 355	24. Mai 2033	(667)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	NOK	54 560	24. Mai 2033	10 477
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	SEK	6 196	24. Mai 2033	897
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	502 773	24. Mai 2033	21 154
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	SEK	38 785	05. Mai 2028	9 382
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	508 743	05. Mai 2028	88 467
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	NOK	24 690	19. Mai 2033	5 284
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	SEK	20 058	18. Mai 2033	3 720
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	USD	28 653	18. Mai 2033	3 094



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	447 310	24. Mai 2033	18 624
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	EUR	16 371	05. Mai 2028	723
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	122 174	18. Mai 2033	7 167
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	186 690	18. Mai 2033	6 196
Verkauf Short	Umweltschutz	Goldman Sachs	USD	377 148	24. Mai 2033	7 814
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	4 973 967	24. Mai 2033	81 426
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	7 272 683	05. Mai 2028	11 713
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	5 710 088	18. Mai 2033	101 644
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	27 363 222	18. Mai 2033	576 228
Verkauf Short	ETC-Fonds	Morgan Stanley	USD	232 108	18. Mai 2033	2 848
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	CHF	274 335	24. Mai 2033	7 556
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	EUR	7 100	05. Apr. 2024	345
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	GBP	466 047	21. Aug. 2024	119 075
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	JPY	5 103	24. Mai 2033	159
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	338 991	24. Mai 2033	14 140
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	42 805	05. Mai 2028	2 416
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	233 809	18. Mai 2033	10 551
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	HKD	4 900	18. Mai 2033	(19)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	JPY	3 240	18. Mai 2033	154
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	767 621	18. Mai 2033	21 431
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	J.P. Morgan	USD	120 399	05. Mai 2028	5 560
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	CHF	572 223	24. Mai 2033	777
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	DKK	802 498	24. Mai 2033	34 005
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	HKD	124 268	24. Mai 2033	(2 782)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	527 185	28. Apr. 2026	7 724
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	1 900 739	24. Mai 2033	58 590
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	DKK	109 932	05. Mai 2028	11 200
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	EUR	529 476	05. Mai 2028	34 474
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	HKD	8 062	05. Mai 2028	(253)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	JPY	361 263	08. Mai 2028	14 293
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	SEK	93 619	05. Mai 2028	3 506
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	3 636	05. Mai 2028	3 622
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	HKD	155 590	18. Mai 2033	(4 586)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	SEK	203 470	18. Mai 2033	2 327
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	1 040 220	18. Mai 2033	6 954
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	719 138	24. Mai 2033	37 749
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 539 197	24. Mai 2033	92 243
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	251 450	05. Mai 2028	8 878
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	63 209	05. Mai 2028	1 386
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	944 582	18. Mai 2033	814
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	725 724	24. Mai 2033	22 942
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	808 595	18. Mai 2033	18 640
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	USD	191 165	18. Mai 2033	(244)
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	EUR	114 976	24. Mai 2033	2 153
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	CHF	1 990 275	05. Mai 2028	(61 343)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	EUR	3 009 864	05. Mai 2028	(53 979)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	GBP	356 559	05. Mai 2028	737
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	USD	349 548	05. Mai 2028	4 925

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	EUR	729 024	18. Mai 2033	17 167
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	JPY	362 121	18. Mai 2033	9 160
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	USD	795 782	18. Mai 2033	663
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	EUR	86 830	05. Mai 2028	16 043
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	1 133 348	19. Mai 2025	26 887
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	249 217	18. Mai 2033	(8 981)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Goldman Sachs	JPY	5 729	24. Mai 2033	352
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Goldman Sachs	USD	220 979	24. Mai 2033	(9 330)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	J.P. Morgan	USD	264 900	05. Mai 2028	(4 115)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	AUD	4 694	18. Mai 2033	66
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	USD	280 548	18. Mai 2033	740
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	USD	223 773	05. Mai 2028	(6 354)
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	659 871	18. Mai 2033	(4 067)
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	Goldman Sachs	SEK	288 913	24. Mai 2033	10 886
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	J.P. Morgan	SEK	700	05. Mai 2028	31
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	J.P. Morgan	USD	459 173	05. Mai 2028	22 199
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	Morgan Stanley	USD	124 854	18. Mai 2033	6 276
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	GBP	480 023	04. Jan. 2024	12 569
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	SEK	368 879	05. Apr. 2024	128
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	USD	133 317	11. Sep. 2024	9 152
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	USD	1 139 079	05. Mai 2028	74 785
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	650 458	18. Mai 2033	22 245
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	GBP	266 751	22. Mai 2024	(71)
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	285 868	18. Mai 2033	6 098
Verkauf Short	Metallprodukte/Eisenwaren	Morgan Stanley	USD	483 165	18. Mai 2033	16 121
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	1 511 818	24. Mai 2033	27 462
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	EUR	510 523	05. Mai 2028	42 188
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	431 178	18. Mai 2033	1 986
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	AUD	299 304	24. Mai 2033	(7 786)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	EUR	459 422	24. Mai 2033	(1 521)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	GBP	183 522	24. Mai 2033	4 950
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	NOK	445 855	24. Mai 2033	14 430
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	USD	1 048 589	24. Mai 2033	2 793
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	AUD	16 765	05. Mai 2028	(43)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	CAD	998 488	05. Mai 2028	26 324
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	JPY	144 011	08. Mai 2028	(8 654)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	4 557 046	05. Mai 2028	(122 256)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	AUD	62 056	18. Mai 2033	78
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	2 335 012	18. Mai 2033	81 146
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	GBP	19 661	18. Mai 2033	1 578
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	NOK	294 707	19. Mai 2033	11 601
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	1 563 042	18. Mai 2033	11 407
Verkauf Short	Öl- und Gasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 033 241	24. Mai 2033	18 878
Verkauf Short	Öl- und Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	283 917	05. Mai 2028	(19 909)
Verkauf Short	Öl- und Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	363 055	18. Mai 2033	9 098
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	270 102	24. Mai 2033	16 005
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	673 264	24. Mai 2033	21 945
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	HKD	281 403	24. Mai 2033	(3 734)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	224 460	24. Mai 2033	17 878

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>						
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	348 882	24. Mai 2033	2 002
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	235 328	08. Mai 2028	4 035
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	329 382	23. Feb. 2024	45 843
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	1 125 867	18. Mai 2033	47 562
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	HKD	421 340	18. Mai 2033	(17 340)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2 896 475	18. Mai 2033	32 034
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	510 928	24. Mai 2033	10 243
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	1 976 968	05. Mai 2028	(347)
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	CAD	296 395	18. Mai 2033	14 441
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	USD	1 008 329	18. Mai 2033	29 556
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	USD	1 646 448	24. Mai 2033	51 907
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	SEK	550 944	05. Mai 2028	18 166
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	USD	478 565	05. Mai 2028	39 043
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	SEK	360 302	18. Mai 2033	(9 966)
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	USD	2 009 060	18. Mai 2033	143 214
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	EUR	263 631	24. Mai 2033	14 303
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	USD	135 820	24. Mai 2033	7 095
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	EUR	745 907	05. Mai 2028	(5 640)
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	SEK	17 456	05. Mai 2028	572
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	USD	136 269	05. Mai 2028	18 573
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	SEK	81 102	18. Mai 2033	3 021
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	USD	105 848	18. Mai 2033	8 319
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	EUR	130 285	24. Mai 2033	7 766
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	73 448	24. Mai 2033	5 365
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	EUR	385 591	05. Mai 2028	26 394
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	380 276	18. Mai 2033	33 122
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	GBP	328 047	05. Apr. 2024	2 811
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	SEK	319 688	05. Apr. 2024	9 171
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1 700 488	24. Mai 2033	(22 699)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	542 792	05. Mai 2028	11 701
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	578 606	19. Mai 2025	29 600
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	1 943 439	18. Mai 2033	62 037
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	155 317	24. Mai 2033	(2)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	JPY	3 574	08. Mai 2028	(83)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	232 221	19. Mai 2025	(1 621)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	849 515	18. Mai 2033	8 004
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	GBP	432 345	24. Mai 2033	16 968
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	74 275	24. Mai 2033	5 619
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	314 108	24. Mai 2033	687
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	AUD	184 579	05. Mai 2028	13 410
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	317 514	19. Mai 2025	21 220
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	808 241	18. Mai 2033	59 265
Verkauf Short	Spielwaren/Spiele/Hobbys	J.P. Morgan	JPY	195 627	20. Aug. 2025	149
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	JPY	189 569	24. Mai 2033	18 424
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	JPY	83 148	08. Mai 2028	3 483
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	USD	415 086	05. Mai 2028	(9 010)
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	JPY	76 403	18. Mai 2033	4 654
<b>USD</b>						<b>1 357 944</b>

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Differenzkontrakte

Differenzkontrakte (CDF, Contract of Difference) werden auf Grundlage des Börsenschlusskurses des zugrunde liegenden Wertpapiers bewertet, der in die Basiswährung des Differenzkontrakts umgerechnet wird und von dem die den einzelnen Kontrakten zuzuschreibenden Finanzierungskosten, die separat verbucht werden, abgezogen werden. Bei Abschluss eines Differenzkontrakts muss der Fonds gegebenenfalls liquide Mittel und/oder sonstige Vermögenswerte bis zu einem Betrag, der einem bestimmten prozentualen Anteil des Kontraktbetrags entspricht («Einschusssumme»), zugunsten des Brokers verpfänden. Im weiteren Verlauf werden periodisch als «Schwankungsmargen» bezeichnete Zahlungen vom Fonds geleistet oder empfangen, die von der Schwankung des Werts des zugrunde liegenden Wertpapiers abhängen. Bei Ablauf des Kontrakts entsprechen realisierte Gewinne oder Verluste der Differenz zwischen dem Wert des Differenzkontrakts zum Zeitpunkt seiner Eröffnung (einschliesslich etwaiger Finanzierungskosten) und dem Wert zum Zeitpunkt seiner Schliessung. Auf offene Differenzkontrakte entfallende Dividenden werden (abzüglich Quellensteuern) als zum Ende des Berichtsjahres zu erhaltende Dividenden behandelt. Das Ergebnis dieser Neubewertungen ist in der Nettovermögensaufstellung unter «Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Differenzkontrakten» aufgeführt.

Zum 30. September 2023 wiesen die folgenden Teilfonds Differenzkontrakte auf Finanzindizes und Futures-Kontrakte auf:

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Asian Equity Long Short*</b>				
CFD auf australische Aktien	UBS	161 018	15 898	15 898
CFD auf chinesische Aktien	UBS	244 156	(7 166)	(7 166)
CFD auf Aktien aus Hongkong	UBS	86 115	(36 191)	(36 191)
CFD auf italienische Aktien	UBS	23 200	(7 407)	(7 407)
CFD auf Aktien aus Macau	UBS	30 000	(9 355)	(9 355)
CFD auf neuseeländische Aktien	UBS	50 794	(5 023)	(5 023)
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	63 600	(18 256)	(18 256)
CFD auf südkoreanische Aktien	UBS	(8 967)	31 051	31 051
CFD auf taiwanische Aktien	UBS	(163 000)	7 607	7 607
CFD auf US-Aktien	UBS	65 219	(34 279)	(34 279)
CFD auf den MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	UBS	(7 304)	238 680	238 680
			<b>USD</b>	<b>175 559</b>
<b>Schroder GAIA BlueTrend</b>				
CFD auf den Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Bank of America	(321)	(204 461)	(3 055)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Bank of America	8 152	1 392 093	30 210
CFD auf den Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Bank of America	(1 137)	(669 746)	(31 891)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Bank of America	251	310 878	(11 179)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Bank of America	(717)	(439 350)	(4 231)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Bank of America	2 678	1 766 967	(12 203)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Bank of America	(3 645)	(2 741 736)	129 094
CFD auf den Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Bank of America	1 651	1 851 787	(26 246)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Index	Bank of America	(980)	(712 042)	16 884
CFD auf den Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Bank of America	4 713	1 629 880	1 579
CFD auf den Stoxx Europe 600 Media Price Index	Bank of America	4 549	1 774 728	47 795
CFD auf den Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Bank of America	1 666	638 236	32 570
CFD auf den Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Bank of America	229	238 713	2 367
CFD auf den Stoxx Europe 600 Retail Price Index	Bank of America	2 878	1 122 476	(38 929)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Bank of America	(323)	(222 280)	3 029
CFD auf den Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Bank of America	(3 847)	(786 848)	16 815
CFD auf den Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Bank of America	(2 026)	(470 895)	28 903
CFD auf den Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Bank of America	(443)	(166 826)	3 085
CFD auf den S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	1 281	1 619 179	(109 817)
CFD auf den S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	(1 791)	(1 302 696)	54 495
CFD auf den S&P 500 Energy Sector Index	Goldman Sachs	1 649	1 144 721	27 540
CFD auf den S&P 500 Financials Sector Index	Goldman Sachs	4 894	2 702 273	(125 123)
CFD auf den S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	604	906 737	(29 046)
CFD auf den S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	(449)	(385 050)	2 973
CFD auf den S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	306	889 103	(67 247)
CFD auf den S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	176	87 040	(5 726)
CFD auf den S&P 500 Utilities Sector Index	Goldman Sachs	(11 733)	(3 510 509)	217 535
			<b>USD</b>	<b>6 462 372</b>
<b>Schroder GAIA Contour Tech Equity</b>				
CFD auf australische Aktien	Morgan Stanley	(19 748)	(163 524)	(163 524)
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	(188 619)	77 628	77 628

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)</b>				
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	(31 788)	161 092	161 092
CFD auf französische Aktien	Morgan Stanley	(20 150)	34 512	34 512
CFD auf deutsche Aktien	Morgan Stanley	44 017	(46 072)	(46 072)
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	(17 711)	114 413	114 413
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	(146 630)	70 927	70 927
CFD auf neuseeländische Aktien	Morgan Stanley	(12 000)	83 789	83 789
CFD auf norwegische Aktien	Morgan Stanley	285 130	(309 210)	(309 210)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(637 132)	816 696	816 696
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(1 442 609)	1 350 893	1 350 893
CFD auf den MSCOLYTS Index	Morgan Stanley	(32 500)	118 102	118 102
CFD auf den MSLYT23L Index	Morgan Stanley	32 500	(106 652)	(106 652)
			<b>USD 2 202 594</b>	<b>2 202 594</b>
<b>Schroder GAIA Helix</b>				
CFD auf argentinische Aktien	Goldman Sachs	6 771	(3 250)	(3 250)
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	920 080	132 333	132 333
CFD auf australische Aktien	J.P. Morgan	11 290 918	34 561	34 561
CFD auf österreichische Aktien	Goldman Sachs	33 440	11 952	11 952
CFD auf österreichische Aktien	J.P. Morgan	14 841	3 457	3 457
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	96 500	35 861	35 861
CFD auf brasilianische Aktien	Goldman Sachs	7 121	(38 255)	(38 255)
CFD auf brasilianische Aktien	J.P. Morgan	458	(53 059)	(53 059)
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	13 079 708	(503 679)	(502 935)
CFD auf britische Aktien	J.P. Morgan	454 601	(31 542)	(31 542)
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	53 173	(45 207)	(45 207)
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	6 627 351	(1 293 305)	(1 293 305)
CFD auf chinesische Aktien	J.P. Morgan	3 390 198	40 491	40 491
CFD auf tschechische Aktien	Goldman Sachs	(45 189)	49 170	49 170
CFD auf tschechische Aktien	J.P. Morgan	(14 095)	(8 863)	(8 863)
CFD auf dänische Aktien	Goldman Sachs	136 140	(12 014)	(12 014)
CFD auf dänische Aktien	J.P. Morgan	51 128	(35 782)	(35 782)
CFD auf niederländische Aktien	Goldman Sachs	525 974	(141 860)	(141 860)
CFD auf niederländische Aktien	J.P. Morgan	69 507	13 297	13 297
CFD auf finnische Aktien	Goldman Sachs	(32 741)	49 657	49 657
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	400 367	(4 461)	(4 461)
CFD auf französische Aktien	J.P. Morgan	46 282	(39 873)	(39 873)
CFD auf georgische Aktien	Goldman Sachs	(29 349)	(82 390)	(82 390)
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	721 299	(579 952)	(579 952)
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	143 316	(88 056)	(88 217)
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	2 856 494	(637 488)	(637 488)
CFD auf Aktien aus Hongkong	J.P. Morgan	867 876	(155 710)	(155 710)
CFD auf isländische Aktien	Goldman Sachs	17 786	(10 545)	(10 545)
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	7 324	(24 242)	(24 242)
CFD auf indische Aktien	J.P. Morgan	54 189	(237 890)	(237 890)
CFD auf indonesische Aktien	Goldman Sachs	755 100	7 350	7 350
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	10 935	(98 292)	(98 292)
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	74 000	(55 913)	(55 913)
CFD auf italienische Aktien	J.P. Morgan	193 192	(19 646)	(19 646)
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	1 509 300	(134 398)	(134 398)
CFD auf japanische Aktien	J.P. Morgan	9 877 900	(3 869 595)	(3 869 595)
CFD auf Aktien aus Jersey	Goldman Sachs	20 866	127	127



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Helix (Forts.)</b>				
CFD auf luxemburgische Aktien	Goldman Sachs	105 523	(21 244)	(21 244)
CFD auf Aktien aus Macau	Goldman Sachs	138 000	(75 695)	(75 695)
CFD auf Aktien aus Macau	J.P. Morgan	177 000	(85 979)	(85 979)
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	34 312	(3 252)	(3 252)
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P. Morgan	299 464	(8 062)	(8 062)
CFD auf norwegische Aktien	Goldman Sachs	207 245	67 528	67 528
CFD auf norwegische Aktien	J.P. Morgan	145 853	11 866	11 866
CFD auf polnische Aktien	Goldman Sachs	(44 736)	73 071	73 071
CFD auf polnische Aktien	J.P. Morgan	(12 325)	(641)	(641)
CFD auf portugiesische Aktien	Goldman Sachs	4 072	(7 588)	(7 588)
CFD auf portugiesische Aktien	J.P. Morgan	64 971	344	344
CFD auf russische Aktien	Goldman Sachs	6 978	-	-
CFD auf saudi-arabische Aktien	J.P. Morgan	67 971	84 284	84 284
CFD auf Aktien aus Singapur	Goldman Sachs	757 040	4 210	4 210
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	394 400	(100 370)	(100 370)
CFD auf südafrikanische Aktien	Goldman Sachs	179 224	282 514	282 514
CFD auf südafrikanische Aktien	J.P. Morgan	32 379	(988)	(988)
CFD auf südkoreanische Aktien	Goldman Sachs	(53 910)	217 671	217 671
CFD auf südkoreanische Aktien	J.P. Morgan	(3 121)	101 707	101 707
CFD auf spanische Aktien	Goldman Sachs	307 538	82 941	82 941
CFD auf spanische Aktien	J.P. Morgan	119 626	(16 276)	(16 276)
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	265 870	186 162	185 697
CFD auf schwedische Aktien	J.P. Morgan	87 980	20 911	20 911
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	70 363	(83 514)	(83 514)
CFD auf Schweizer Aktien	J.P. Morgan	2 094	(6 933)	(6 933)
CFD auf taiwanische Aktien	Goldman Sachs	(940 162)	87 993	87 993
CFD auf taiwanische Aktien	J.P. Morgan	(23 000)	(2 612)	(2 612)
CFD auf türkische Aktien	Goldman Sachs	523 651	(819)	(819)
CFD auf ukrainische Aktien	Goldman Sachs	264 895	(10 294)	(10 294)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	871 093	(1 764 595)	(1 760 684)
CFD auf US-Aktien	J.P. Morgan	502 220	(566 603)	(566 603)
CFD auf den FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(466)	246 252	246 252
CFD auf den GSCBTUK2 Index	Goldman Sachs	(25 074)	78 652	78 652
CFD auf den HXE EU Banks Index	Goldman Sachs	111 903	98 543	98 543
CFD auf den HXE EU Value Long Index	Goldman Sachs	60 192	(4 490)	(4 490)
CFD auf den HXE EU Value Short Index	Goldman Sachs	(60 268)	256 486	256 486
CFD auf den HXE JP Value Long Index	Goldman Sachs	7 983 859	10 038	10 038
CFD auf den HXE JP Value Short Index	Goldman Sachs	(8 928 652)	354 850	354 850
CFD auf den HXE Pharma Index	Goldman Sachs	50 683	(139 977)	(139 977)
CFD auf den HXE Staples Index	Goldman Sachs	132 614	(477 023)	(477 023)
CFD auf den HXE US Value Long Index	Goldman Sachs	44 205	(76 475)	(76 475)
CFD auf den HXE US Value Short Index	Goldman Sachs	(42 867)	282 922	282 922
CFD auf den HXE World Size Index	Goldman Sachs	83 737	17 946	17 946
CFD auf den MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(42 437)	1 509 640	1 509 640
CFD auf den MSCI EM Europe 10/40 Index	Goldman Sachs	(592)	25 930	30 432
CFD auf den MSCI EM Latin America 10-40 Gross Total Return Index	Goldman Sachs	(11 875)	114 485	132 766
CFD auf den MSCI PROV Saudi Arabia Gross Total Return Index	J.P. Morgan	(449)	(381)	(381)
CFD auf den MXJPLC Index	Goldman Sachs	685 162	(131 513)	(131 513)
			<b>USD (7 195 389)</b>	<b>(7 168 577)</b>
<b>Schroder GAIA SEG US Equity*</b>				
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	28 043	183 850	176 059
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	188 035	(1 678 815)	(1 686 146)
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	(37 518)	1 088	5 634

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA SEG US Equity* (Forts.)</b>				
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	9 144	(105 733)	(104 230)
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	15 202	(136 192)	(135 913)
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	(121 937)	(124 972)	(125 419)
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	132 907	(1 555 878)	(1 555 164)
CFD auf mexikanische Aktien	Goldman Sachs	48 090	(29 571)	(33 410)
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	147 029	(272 881)	(278 001)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(753 771)	3 842 304	4 194 115
CFD auf GS Commercial Real Estate Basket	Goldman Sachs	(24 836)	(191 810)	(196 458)
CFD auf GS CSDN Basket	Goldman Sachs	(12 786)	193 121	191 566
CFD auf GS Energy Basket	Goldman Sachs	(32 303)	(310 505)	(310 935)
CFD auf GS Flagship Basket	Goldman Sachs	(39 139)	372 153	411 106
CFD auf GS Healthcare Basket	Goldman Sachs	(21 472)	148 100	181 268
CFD auf GS Holt Defense Basket	Goldman Sachs	(24 153)	124 761	126 123
CFD auf GS Info Tech Basket	Goldman Sachs	(12 869)	16 558	47 632
CFD auf GS MAMA Basket	Goldman Sachs	(9 754)	(11 392)	(11 392)
CFD auf GS OZVT Index	Goldman Sachs	(51 473)	264 225	474 633
CFD auf GS PEVC Basket	Goldman Sachs	(52 453)	(16 303)	(16 891)
CFD auf GS Regiaufal Banks Basket	Goldman Sachs	(3 927)	(268)	(3 146)
CFD auf den GS SHIF Index	Goldman Sachs	(43 532)	(127 232)	(45 389)
CFD auf GS SPAC Basket	Goldman Sachs	(31 706)	77 041	206 060
CFD auf GS STHK Basket	Goldman Sachs	(21 955)	47 734	47 699
CFD auf GS Utilities Basket	Goldman Sachs	(17 787)	211 993	208 120
			<b>USD</b>	<b>921 376</b>
				<b>1 767 521</b>

## Credit Default Index-Swapkontrakte

Ein Credit Default Index Swap ermöglicht die Übertragung von Ausfallrisiken. Dadurch kann der Fonds einen effektiven Versicherungsschutz in Bezug auf eine von ihm gehaltene Referenzindexanleihe (Absicherung der Anlage) oder einen Schutz in Bezug auf eine Referenzindexanleihe erwerben, die er nicht physisch besitzt, in der Erwartung, dass die Qualität des Kredits abnimmt. Eine Vertragspartei, der Sicherungsnehmer, leistet regelmässige Zahlungen an den Sicherungsgeber und erhält dafür bei Eintritt eines Kreditereignisses (ein Rückgang der Kreditqualität, der zuvor von den Parteien vertraglich festlegt wird) eine Ausgleichszahlung. Tritt das Kreditereignis nicht ein, zahlt der Sicherungsnehmer alle erforderlichen Prämien und das Swapgeschäft endet am Fälligkeitstermin ohne weitere Zahlungen. Das Risiko des Sicherungsnehmers beschränkt sich somit auf den Wert der gezahlten Prämien. Falls ein Kreditereignis eintritt und der Fonds die zugrunde liegende Referenzanleihe nicht hält, kann zusätzlich ein Marktrisiko bestehen, da der Fonds möglicherweise Zeit benötigt, um die Referenzindexanleihe zu erhalten und an die Gegenpartei zu liefern. Darüber hinaus besteht die Möglichkeit, dass der Fonds den ihm von der Gegenpartei geschuldeten Betrag nicht wiedererlangt, wenn die Gegenpartei insolvent wird. Der Markt für Credit Default Indizes kann mitunter weniger liquide sein als die Rentenmärkte. Die Gesellschaft verringert dieses Risiko, indem sie den Abschluss derartiger Geschäfte in angemessener Weise überwacht.

Credit Default Indizes wurden zu ihrem inneren Wert bewertet. Die Bewertungsmethode beinhaltet den aktuellen Wert der Zinsserie und den aktuellen Wert des Credit-Spread, der zum Schlussstermin auf dem Markt gehandelt wurde. Das Ergebnis dieser Neubewertungen ist zusammen mit allen ausstehenden/ zahlbaren Zinsen in Verbindung mit Credit Default Indizes in der Nettovermögensaufstellung unter «Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Credit Default Index-Swapkontrakten» aufgeführt.

Am 30. September 2023 waren die folgenden Teilfonds in Credit Default Index-Swapkontrakten auf Finanzindizes engagiert:

Schutz- position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten %	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA BlueTrend</b>							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 40 20/12/2028	J.P. Morgan	EUR	39 000 000	5,00	20. Dez. 2028	1 295 893
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 40 20/12/2028	J.P. Morgan	EUR	153 000 000	1,00	20. Dez. 2028	1 621 849
Verkauf	CDX North America High Yield Series 41 20/12/2028	J.P. Morgan	USD	45 000 000	5,00	20. Dez. 2028	428 482
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 41 20/12/2028	J.P. Morgan	USD	197 000 000	1,00	20. Dez. 2028	2 414 461
						<b>USD</b>	<b>5 760 685</b>
<b>Schroder GAIA Two Sigma Diversified</b>							
Kauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 40 20/12/2028	Citi Bank	EUR	10 000 000	1,00	20. Dez. 2028	25 334
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 40 20/12/2028	Citi Bank	EUR	56 000 000	1,00	20. Dez. 2028	(141 618)

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Credit Default Index-Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt/ erhalten %)	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)</b>							
Verkauf	CDX North America High Yield Series 41 20/12/2028	Citi Bank	USD	20 000 000	5,00	20. Dez. 2028	(41 341)
Kauf	CDX North America Investment Grade Series 41 20/12/2028	Citi Bank	USD	20 000 000	1,00	20. Dez. 2028	49 997
<b>USD</b>							<b>(107 628)</b>
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa</b>							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	6 980 000	1,00	20. Dez. 2027	76 186
Kauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 39 20/06/2028	Morgan Stanley	EUR	18 193 000	1,00	20. Jun. 2028	(118 441)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 39 20/06/2028	Morgan Stanley	EUR	12 375 000	1,00	20. Jun. 2028	(18 729)
Kauf	CDX iTraxx Europe Subordinated Financial Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	3 970 000	1,00	20. Dez. 2027	(193 652)
Kauf	CDX North America High Yield Series 41 20/12/2028	Morgan Stanley	USD	7 555 000	5,00	20. Dez. 2028	15 851
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 41 20/12/2028	Morgan Stanley	USD	16 500 000	1,00	20. Dez. 2028	(14 099)
<b>USD</b>							<b>(252 884)</b>

## Credit Default Swapkontrakte

Ein Credit Default Swap ermöglicht die Übertragung des Ausfallrisikos. Dadurch kann der Fonds einen effektiven Versicherungsschutz in Bezug auf eine von ihm gehaltene Referenzanleihe (Absicherung der Anlage) oder einen Schutz in Bezug auf eine Referenzanleihe erwerben, die er nicht physisch besitzt, in der Erwartung, dass die Qualität des Kredits abnimmt. Eine Vertragspartei, der Sicherungsnehmer, leistet regelmässige Zahlungen an den Sicherungsgeber und erhält dafür bei Eintritt eines Kreditereignisses (ein Rückgang der Kreditqualität, der zuvor von den Parteien vertraglich festgelegt wird) eine Ausgleichszahlung. Tritt das Kreditereignis nicht ein, zahlt der Sicherungsnehmer alle erforderlichen Prämien und das Swapgeschäft endet am Fälligkeitstermin ohne weitere Zahlungen. Das Risiko des Sicherungsnehmers beschränkt sich somit auf den Wert der gezahlten Prämien. Falls ein Kreditereignis eintritt und der Teilfonds die zugrunde liegende Referenzanleihe nicht hält, kann zusätzlich ein Marktrisiko bestehen, da der Teilfonds möglicherweise Zeit benötigt, um die Referenzanleihe zu erhalten und an die Gegenpartei zu liefern. Darüber hinaus besteht die Möglichkeit, dass der Teilfonds den ihm von der Gegenpartei geschuldeten Betrag nicht wiedererlangt, wenn die Gegenpartei insolvent wird. Der Markt für Credit Default Swaps kann mitunter weniger liquide sein als die Rentenmärkte. Die Gesellschaft verringert dieses Risiko, indem sie den Abschluss derartiger Geschäfte in angemessener Weise überwacht.

Credit Default Swaps wurden zu ihrem inneren Wert bewertet. Die Bewertungsmethode beinhaltet den aktuellen Wert der Zinsserie und den aktuellen Wert des Credit-Spread, der zum Schlussstermin auf dem Markt gehandelt wurde. Das Ergebnis dieser Neubewertungen ist zusammen mit allen ausstehenden/zahlbaren Zinsen in Verbindung mit Credit Default Swaps in der Nettovermögensaufstellung unter «Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Credit Default Swapkontrakten» aufgeführt.

Zum 30. September 2023 war der folgende Teilfonds in Credit Default Swap-Kontrakten engagiert:

Schutz- position	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa</b>							
Kauf	Belgien	Chemie	Morgan Stanley	EUR	1 990 000	20. Jun. 2028	(9 813)
Kauf	China	Banken	Goldman Sachs	USD	2 070 000	20. Jun. 2028	5 072
Kauf	China	Banken	Morgan Stanley	USD	5 470 000	20. Jun. 2028	15 982
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	7 460 000	20. Jun. 2028	(23 804)
Kauf	Finnland	Verpackung und Behälter	Morgan Stanley	EUR	2 100 000	20. Jun. 2028	32 579
Kauf	Frankreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1 380 000	20. Jun. 2028	(5 747)
Kauf	Frankreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	3 780 000	20. Jun. 2028	(55 469)
Kauf	Frankreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	3 150 000	20. Jun. 2028	(35 573)
Kauf	Frankreich	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	EUR	1 640 000	20. Jun. 2028	(26 941)
Kauf	Frankreich	REITS	Morgan Stanley	EUR	3 760 000	20. Jun. 2028	(57 629)
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Barclays Bank	EUR	1 440 000	20. Jun. 2027	35 397
Kauf	Deutschland	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1 440 000	20. Jun. 2027	(12 329)
Kauf	Deutschland	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	4 920 000	20. Jun. 2028	(468)
Kauf	Deutschland	Chemie	Morgan Stanley	EUR	2 710 000	20. Jun. 2028	67 740
Kauf	Italien	Banken	BNP Paribas	EUR	1 530 000	20. Jun. 2028	(4 638)
Verkauf	Luxemburg	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	EUR	950 000	20. Jun. 2028	(12 752)

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Credit Default-Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>							
Verkauf	Malaysia	Banken	Morgan Stanley	EUR	6 375 000	20. Jun. 2028	(257 852)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1 220 000	20. Jun. 2028	(6 133)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Luft- und Raumfahrt/ Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	2 220 000	20. Jun. 2028	(97 110)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	410 000	20. Dez. 2025	(34 527)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	805 000	20. Jun. 2027	(101 475)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	475 000	20. Dez. 2027	(55 958)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	660 000	20. Jun. 2028	(71 532)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Banken	Goldman Sachs	EUR	1 710 000	20. Jun. 2028	(21 246)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	2 380 000	20. Jun. 2028	(41 235)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	1 650 000	20. Jun. 2028	481
Kauf	Vereinigtes Königreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	1 800 000	20. Jun. 2028	(8 856)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	620 000	20. Jun. 2028	(17 921)
Verkauf	USA	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	2 150 000	20. Jun. 2028	23 551
Verkauf	USA	Automobilindustrie	Morgan Stanley	USD	1 340 000	20. Jun. 2028	(18 307)
Verkauf	USA	Banken	J.P. Morgan	EUR	2 050 000	20. Jun. 2028	42 775
Verkauf	USA	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	1 500 000	20. Jun. 2028	2 045
Verkauf	USA	Chemie	Morgan Stanley	USD	1 745 000	20. Jun. 2028	7 394
Verkauf	USA	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	1 025 000	20. Jun. 2028	(2 923)
Verkauf	USA	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	885 000	20. Jun. 2028	2 059
Verkauf	USA	Internet	Morgan Stanley	USD	1 700 000	20. Jun. 2028	11 629
Verkauf	USA	Medien	Morgan Stanley	USD	3 810 000	20. Jun. 2028	(5 045)
Verkauf	USA	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	795 000	20. Jun. 2028	4 630
Verkauf	USA	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	800 000	20. Jun. 2028	168
Kauf	USA	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	630 000	20. Dez. 2027	(38 400)
Verkauf	USA	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	960 000	20. Dez. 2027	(58 514)
Verkauf	USA	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	1 100 000	20. Jun. 2028	1 416
Kauf	USA	Öffentliche Hand	Barclays Bank	EUR	1 280 000	20. Jun. 2024	(20 778)
Verkauf	USA	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	1 135 000	20. Jun. 2028	(4 262)
<b>USD</b>							<b>(854 319)</b>

## Cross-Currency Swapkontrakte

Die Cross-Currency Swaps wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter «Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Cross-Currency Swapkontrakten» aufgeführt. Ein Cross-Currency Swap ist ein Vertrag, mit dem sich zwei Parteien dazu verpflichten, in einem bestimmten Jahr auf zwei verschiedene Währungen lautende Zinszahlungen auszutauschen.

Zum 30. September 2023 war der folgende Teilfonds in Cross-Currency Swapkontrakten engagiert:

Kontrahent	Zu zahlende Währung	Nennwert	Erhaltene Währung	Nennwert	Fälligkeit	Zu zahlender Satz	Erhaltener Satz	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa</b>								
Morgan Stanley	USD	21 907 219	AUD	30 014 000	20. Mrz. 2029	USD SOFR 1 Tag	AUD BBR 3 Monate	(8 887)
Morgan Stanley	USD	23 258 410	NOK	205 816 000	20. Mrz. 2029	USD SOFR 1 Tag	NOK NIBOR 3 Monate	3 919
Morgan Stanley	USD	22 173 842	NZD	32 647 000	20. Mrz. 2029	USD SOFR 1 Tag	NZD BBR 3 Monate	6 397
Morgan Stanley	USD	22 240 726	SEK	215 288 000	20. Mrz. 2029	USD SOFR 1 Tag	SEK STIBOR 3 Monate	18 015
<b>USD</b>								<b>19 444</b>

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Inflations-Swapkontrakte

Ein Inflations-Swap ermöglicht die Übertragung von Inflationsrisiken. Eine Vertragspartei versucht, ihr Risiko (durch Absicherung) zu reduzieren, während die andere das Risiko (durch Spekulation) erhöht. Die Partei, die ihr Inflationsrisiko absichern möchte, zahlt den an einen Inflationsindex gebundenen variablen Zinssatz und erhält gleichzeitig Zahlungen zu einem festen Zinssatz. Durch den Tausch einer variablen Verzinsung gegen eine feste verringert die absichernde Partei ihr Inflationsrisiko und erhöht ihre Sicherheit hinsichtlich künftiger Zahlungsströme. Inflations-Swaps wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter «Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Inflations-Swapkontrakten» aufgeführt.

Zum 30. September 2023 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Inflationsraten engagiert:

Nennbetrag	Währung	Kontrahent	Wertpapierbeschreibung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa</b>					
5 675 000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,43%, erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Jahre	15. Mrz. 2033	64 064
5 112 000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,45%, erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Jahre	15. Feb. 2033	46 240
5 675 000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,46%, erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Jahre	15. Mrz. 2033	47 452
5 675 000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,49%, erhält variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Mrz. 2028	13 215
9 519 000	USD	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,63%, erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Jahre	15. Sep. 2033	(74 921)
5 112 000	EUR	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,48%, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Feb. 2028	(15 276)
5 675 000	EUR	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,53%, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Mrz. 2028	(1 973)
2 710 000	USD	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,60%, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Sep. 2028	(7 055)
6 809 000	USD	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,61%, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Sep. 2028	20 952
6 155 000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,32%, erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Jahre	15. Feb. 2033	129 493
6 463 000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,40%, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	91 828
3 730 000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,61%, erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Jahre	15. Sep. 2033	(23 467)
6 155 000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,31%, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Feb. 2028	(70 678)
6 463 000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,40%, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Feb. 2028	(43 867)
3 730 000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,62%, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Sep. 2028	14 752
<b>USD</b>					<b>190 759</b>

## Zins-Swapkontrakte

Zur Absicherung gegen Zinsschwankungen kann die Gesellschaft Zinsswap-Geschäfte abschliessen, sofern:

- die hieraus entstehenden Verpflichtungen nicht den Wert der abzusichernden Vermögenswerte übersteigen, und
- der Gesamtbetrag dieser Transaktionen nicht das Niveau überschreitet, das zur Abdeckung von Wertschwankungsrisiken des jeweiligen Vermögens erforderlich ist.

Diese Kontrakte müssen auf die Währungen lauten, in denen die Vermögenswerte des jeweiligen Fonds denominated sind oder auf Währungen, die aller Voraussicht nach in ähnlicher Weise schwanken, und sie müssen entweder an einer Börse notiert sein oder an einem geregelten Markt gehandelt werden.

Zinsswaps wurden anhand ihres inneren Werts zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Die Bewertungsmethode beinhaltet den aktuellen Wert jeder Zins- und Kapitalserie, der zum Schlussstermin in die Währung des Fonds umgerechnet wird. Das Ergebnis dieser Neubewertungen ist zusammen mit allen ausstehenden/zahlbaren Zinsen in Verbindung mit den Zinsswaps in der Nettovermögensaufstellung unter «Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Zins-Swapkontrakten» aufgeführt.

Zum 30. September 2023 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Zinssätze engagiert:

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA BlueTrend</b>					
Erhält Festzinssatz 1,67%					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	3 000 000	CHF	20. Dez. 2028	(1 340)
Erhält Festzinssatz 9,73%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	172 042 513	BRL	02. Jan. 2025	(245 506)
Erhält Festzinssatz 9,48%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	111 423 583	BRL	02. Jan. 2026	(372 897)
Zahlt Festzinssatz 13,48%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	31 423 583	BRL	02. Jan. 2026	(359 490)
Zahlt Festzinssatz 13,60%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	82 042 513	BRL	02. Jan. 2025	(463 397)
Zahlt Festzinssatz 10,62%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	40 000 000	BRL	02. Jan. 2026	(5 347)

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)</b>					
Erhält Festzinssatz 9,22%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	94 883 101	ZAR	20. Dez. 2033	(238 901)
Zahlt Festzinssatz 10,72%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	94 883 101	ZAR	20. Dez. 2033	(236 677)
Zahlt Festzinssatz 3,02%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	36 000 000	SEK	20. Dez. 2028	75 500
Zahlt Festzinssatz 3,02%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	216 000 000	SEK	20. Dez. 2028	453 002
Zahlt Festzinssatz 1,84%					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	15 000 000	CHF	20. Dez. 2028	(127 527)
Zahlt Festzinssatz 2,00%					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	4 626 600	CHF	20. Dez. 2033	(92 977)
Erhält Festzinssatz 1,56%					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	1 426 600	CHF	20. Dez. 2033	(35 447)
Zahlt Festzinssatz 3,00%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	80 000 000	SEK	20. Dez. 2033	264 943
Zahlt Festzinssatz 3,00%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	40 000 000	SEK	20. Dez. 2033	132 471
Zahlt Festzinssatz 10,00%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	40 000 000	ZAR	20. Dez. 2033	(3 691)
Erhält Festzinssatz 1,44%					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	120 000 000	JPY	20. Dez. 2043	(465)
Zahlt Festzinssatz 8,83%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	110 397 756	MXN	07. Dez. 2033	229 124
Erhält Festzinssatz 7,85%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	10 397 756	MXN	07. Dez. 2033	(58 151)
Zahlt Festzinssatz 9,73%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	8 071 545	MXN	17. Dez. 2025	5 163
Zahlt Festzinssatz 8,22%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	241 005 128	MXN	13. Dez. 2028	661 083
Erhält Festzinssatz 7,77%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	81 005 128	MXN	13. Dez. 2028	(303 545)
Zahlt Festzinssatz 8,50%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	331 928 455	MXN	17. Dez. 2025	624 862
Zahlt Festzinssatz 3,93%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	96 000 000	USD	20. Dez. 2025	1 587 555
Zahlt Festzinssatz 3,39%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	56 000 000	EUR	20. Dez. 2025	335 944
Erhält Festzinssatz 7,81%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	304 824 014	ZAR	20. Dez. 2025	(195 442)
Zahlt Festzinssatz 3,57%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	40 000 000	USD	20. Dez. 2027	1 164 170
Zahlt Festzinssatz 3,57%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	12 000 000	USD	20. Dez. 2027	349 251
Zahlt Festzinssatz 9,29%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	454 824 014	ZAR	20. Dez. 2025	(344 908)
Zahlt Festzinssatz 3,31%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	344 000 000	SEK	20. Dez. 2025	361 999

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)</b>					
Zahlt Festzinssatz 3,31%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	344 000 000	SEK	20. Dez. 2025	361 998
Zahlt Festzinssatz 3,13%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	5 400 000	USD	20. Dez. 2048	796 632
Zahlt Festzinssatz 1,30%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	2 280 000 000	JPY	20. Dez. 2043	410 304
Zahlt Festzinssatz 1,30%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	2 160 000 000	JPY	20. Dez. 2043	388 706
Zahlt Festzinssatz 3,13%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	7 200 000	USD	20. Dez. 2048	1 062 177
Zahlt Festzinssatz 3,30%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	16 000 000	USD	20. Dez. 2043	1 919 087
Zahlt Festzinssatz 9,86%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	172 299 493	ZAR	20. Dez. 2028	(320 162)
Erhält Festzinssatz 8,23%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	172 299 493	ZAR	20. Dez. 2028	(265 295)
Zahlt Festzinssatz 3,41%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	4 000 000	USD	20. Dez. 2030	199 826
Zahlt Festzinssatz 3,41%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	30 000 000	USD	20. Dez. 2030	1 498 698
Zahlt Festzinssatz 3,74%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	8 000 000	EUR	20. Dez. 2025	(8 926)
Erhält Festzinssatz 4,25%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	3 000 000	USD	20. Dez. 2043	17 061
Erhält Festzinssatz 4,32%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	2 000 000	USD	20. Dez. 2030	6 941
Zahlt Festzinssatz 9,05%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	70 000 000	ZAR	20. Dez. 2028	(11 296)
Erhält Festzinssatz 4,14%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	900 000	USD	20. Dez. 2048	5 355
				<b>USD</b>	<b>9 220 465</b>
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa</b>					
Zahlt Festzinssatz 2,50%					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	75 366 000	CNY	20. Mrz. 2029	20 067
Erhält Festzinssatz 2,84%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	13 073 000	USD	18. Jun. 2028	(397 907)
Erhält Festzinssatz 4,70%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 318 049 000	CLP	21. Jun. 2033	(75 342)
Zahlt Festzinssatz 10,45%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	12 555 000	ZAR	21. Jun. 2033	16 257
Zahlt Festzinssatz 10,51%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	37 771 000	ZAR	21. Jun. 2033	46 047
Erhält Festzinssatz 8,26%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20 091 000	MXN	25. Jan. 2033	(85 836)
Erhält Festzinssatz 3,22%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	8 342 000	SGD	17. Sep. 2028	(22 058)
Zahlt Festzinssatz 3,97%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	6 467 000	MYR	17. Sep. 2028	(51)

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Erhält Festzinssatz 3,22%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	1 451 000	GBP	20. Sep. 2033	(13 037)
Erhält Festzinssatz 12,20%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	29 269 294	BRL	02. Jan. 2025	60 642
Erhält Festzinssatz 12,26%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	2 700 448	BRL	02. Jan. 2026	17 086
Erhält Festzinssatz 12,05%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	10 023 811	BRL	02. Jan. 2025	15 903
Erhält Festzinssatz 12,16%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	1 275 963	BRL	02. Jan. 2026	7 454
Erhält Festzinssatz 11,85%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	750 995	BRL	02. Jan. 2029	3 248
Erhält Festzinssatz 11,12%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	19 733 691	BRL	02. Jan. 2026	15 977
Zahlt Festzinssatz 3,38%					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 3 Months	Morgan Stanley	33 181 000	NOK	18. Sep. 2025	25 258
Erhält Festzinssatz 2,94%					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 6 Months	Morgan Stanley	2 720 000	CAD	17. Sep. 2028	(48 678)
Erhält Festzinssatz 3,81%					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 6 Months	Morgan Stanley	6 573 000	CAD	18. Sep. 2025	(41 779)
Erhält Festzinssatz 4,34%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	3 213 000	GBP	20. Dez. 2028	13 146
Erhält Festzinssatz 2,91%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5 692 000	EUR	20. Dez. 2033	(81 203)
Erhält Festzinssatz 4,19%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	273 933 000	CLP	17. Sep. 2028	(8 054)
Erhält Festzinssatz 4,59%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	2 041 000	GBP	18. Dez. 2025	(1 967)
Zahlt Festzinssatz 3,41%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	28 934 000	MYR	20. Dez. 2025	38 291
Zahlt Festzinssatz 6,02%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	484 770 000	INR	20. Dez. 2025	79 651
Erhält Festzinssatz 5,99%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	573 370 000	INR	20. Dez. 2028	(220 595)
Zahlt Festzinssatz 9,23%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	299 581 000	MXN	14. Dez. 2033	243 050
Erhält Festzinssatz 4,02%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	63 237 000	CZK	20. Dez. 2033	(43 415)
Zahlt Festzinssatz 4,79%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	983 347 000	CLP	20. Dez. 2033	67 245
Erhält Festzinssatz 5,75%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	57 732 000	PLN	20. Dez. 2024	163 214
Erhält Festzinssatz 4,95%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	65 988 000	PLN	20. Dez. 2028	306 206
Erhält Festzinssatz 5,38%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12 713 000	PLN	20. Dez. 2033	(24 421)
Erhält Festzinssatz 8,89%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	426 266 000	MXN	17. Dez. 2025	(645 423)



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Zahlt Festzinssatz 8,28%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	24 730 206 000	COP	20. Dez. 2025	94 307
Erhält Festzinssatz 10,36%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	5 718 932	BRL	01. Jul. 2026	(19 384)
Erhält Festzinssatz 11,02%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	10 489 203	BRL	02. Jan. 2025	(7 733)
Erhält Festzinssatz 11,02%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	10 489 691	BRL	02. Jan. 2025	(7 656)
Erhält Festzinssatz 6,16%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	28 262 000	INR	20. Dez. 2028	(8 229)
Zahlt Festzinssatz 8,45%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	67 600 000	MXN	19. Jul. 2028	174 412
Erhält Festzinssatz 3,22%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	14 667 000	USD	20. Dez. 2033	(210 960)
Zahlt Festzinssatz 8,88%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	64 700 000	MXN	09. Aug. 2028	105 116
Zahlt Festzinssatz 8,35%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	67 760 000	ZAR	20. Dez. 2025	8 532
Zahlt Festzinssatz 2,30%					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	2 694 000	CNY	20. Dez. 2028	3 618
Zahlt Festzinssatz 8,26%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	23 145 000	ZAR	20. Dez. 2025	5 013
Erhält Festzinssatz 11,32%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	290 430 000	MXN	01 Mai 2024	(13 808)
Erhält Festzinssatz 3,67%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2 676 906 000	KRW	20. Dez. 2028	(11 852)
Zahlt Festzinssatz 3,66%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	904 231 000	KRW	20. Dez. 2033	8 851
Erhält Festzinssatz 7,99%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	404 285 000	HUF	20. Dez. 2025	(6 578)
Erhält Festzinssatz 7,59%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2 553 735 000	COP	20. Dez. 2028	(27 612)
Zahlt Festzinssatz 7,87%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3 812 650 000	COP	20. Dez. 2033	62 976
Erhält Festzinssatz 7,61%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6 402 800 000	COP	20. Dez. 2028	(67 973)
Zahlt Festzinssatz 7,84%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1 520 715 000	COP	20. Dez. 2033	25 928
Erhält Festzinssatz 7,63%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	445 200 000	COP	20. Dez. 2028	(4 617)
Erhält Festzinssatz 7,62%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3 730 575 000	COP	20. Dez. 2028	(38 982)
Zahlt Festzinssatz 7,87%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2 221 375 000	COP	20. Dez. 2033	36 656
Zahlt Festzinssatz 7,90%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2 221 290 000	COP	20. Dez. 2033	35 723
Zahlt Festzinssatz 8,10%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	55 360 000	ZAR	20. Dez. 2026	35 128



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Erhält Festzinssatz 4,50%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12 113 000	PLN	20. Dez. 2025	10 033
Zahlt Festzinssatz 3,84%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	12 760 000	ILS	20. Dez. 2033	129 654
Erhält Festzinssatz 3,73%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	23 500 000	ILS	20. Dez. 2028	(148 682)
Erhält Festzinssatz 3,36%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	1 500 000	SGD	20. Dez. 2025	(3 349)
Zahlt Festzinssatz 8,54%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	98 005 000	ZAR	20. Dez. 2028	87 109
Zahlt Festzinssatz 8,00%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6 581 830 000	COP	20. Dez. 2030	62 921
Erhält Festzinssatz 4,00%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14 391 000	PLN	20. Dez. 2025	(17 825)
Erhält Festzinssatz 6,74%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 133 394 000	HUF	20. Dez. 2033	(66 605)
Erhält Festzinssatz 8,16%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	9 219 320 000	COP	20. Dez. 2028	(47 626)
Erhält Festzinssatz 8,20%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	8 921 435 000	COP	20. Dez. 2028	(42 580)
Zahlt Festzinssatz 8,37%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	5 619 345 000	COP	20. Dez. 2033	47 746
Zahlt Festzinssatz 3,88%					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	19 570 000	CAD	20. Mrz. 2029	224 753
Zahlt Festzinssatz 5,31%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	5 657 760 000	CLP	20. Dez. 2028	75 888
Zahlt Festzinssatz 8,54%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2 754 890 000	COP	20. Dez. 2025	7 384
Erhält Festzinssatz 8,24%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1 585 259 000	COP	20. Dez. 2033	(16 797)
Zahlt Festzinssatz 8,56%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6 845 838 000	COP	20. Dez. 2025	17 741
Zahlt Festzinssatz 8,55%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2 755 270 000	COP	20. Dez. 2025	7 201
Erhält Festzinssatz 8,25%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	633 979 000	COP	20. Dez. 2033	(6 564)
Zahlt Festzinssatz 4,69%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	41 063 000	ILS	20. Dez. 2024	11 199
Erhält Festzinssatz 6,66%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	106 340 000	INR	20. Mrz. 2029	(2 087)
Zahlt Festzinssatz 6,69%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	906 981 000	INR	20. Mrz. 2026	5 378
Erhält Festzinssatz 8,15%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	12 758 545 000	COP	20. Dez. 2028	(67 163)
Zahlt Festzinssatz 8,74%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	4 114 233 000	COP	20. Dez. 2025	7 369
Zahlt Festzinssatz 8,76%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	10 323 695 000	COP	20. Dez. 2025	17 343

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Zahlt Festzinssatz 8,72%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	17 963 552 000	COP	20. Dez. 2025	33 173
Zahlt Festzinssatz 8,36%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	7 776 430 000	COP	20. Dez. 2033	67 330
Erhält Festzinssatz 8,33%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	604 022 000	COP	20. Dez. 2033	(5 474)
Zahlt Festzinssatz 8,87%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6 229 814 000	COP	20. Dez. 2025	7 418
Zahlt Festzinssatz 8,83%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2 657 297 000	COP	20. Dez. 2025	3 637
Zahlt Festzinssatz 5,44%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	7 362 838 000	CLP	20. Dez. 2025	85 928
Zahlt Festzinssatz 8,53%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	7 306 960 000	COP	20. Dez. 2033	42 611
Erhält Festzinssatz 10,68%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	4 387 025	BRL	02. Jan. 2029	(28 058)
Erhält Festzinssatz 10,67%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	4 389 121	BRL	02. Jan. 2029	(28 504)
Erhält Festzinssatz 8,34%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	11 952 445 000	COP	20. Dez. 2028	(40 598)
Erhält Festzinssatz 4,96%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4 738 120 000	CLP	20. Mrz. 2029	(110 334)
Erhält Festzinssatz 8,41%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	906 029 000	COP	20. Dez. 2033	(7 040)
Zahlt Festzinssatz 8,98%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3 985 945 000	COP	20. Dez. 2025	2 795
Erhält Festzinssatz 8,22%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	8 366 715 000	COP	20. Dez. 2028	(38 288)
Zahlt Festzinssatz 8,41%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2 746 765 000	COP	20. Dez. 2033	21 342
Zahlt Festzinssatz 3,82%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	25 996 000	PLN	19. Mrz. 2026	12 058
Zahlt Festzinssatz 4,76%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	22 466 000	CZK	20. Dez. 2025	4 691
Erhält Festzinssatz 4,19%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1 285 000	USD	20. Dez. 2030	(3 999)
Zahlt Festzinssatz 8,80%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	54 146 000	ZAR	20. Dez. 2028	19 244
Erhält Festzinssatz 10,21%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	8 814 810	BRL	02. Jan. 2026	(14 966)
Erhält Festzinssatz 10,86%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	5 230 223	BRL	02. Jan. 2029	(23 410)
Erhält Festzinssatz 10,16%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	6 035 388	BRL	02. Jan. 2026	(11 362)
Erhält Festzinssatz 4,13%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	29 505 000	USD	18. Dez. 2026	15 927
Erhält Festzinssatz 4,31%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2 555 000	USD	20. Dez. 2030	9 305

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Erhält Festzinssatz 8,34%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	528 630 000	HUF	20. Dez. 2025	187
Erhält Festzinssatz 4,51%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	59 587 000	CZK	20. Dez. 2028	(286)
Zahlt Festzinssatz 9,17%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	96 402 000	MXN	17. Sep. 2027	109 082
Zahlt Festzinssatz 3,68%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3 465 000	ILS	19. Mrz. 2028	10 350
Erhält Festzinssatz 4,28%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	560 542 000	CLP	19. Mrz. 2028	(15 066)
Erhält Festzinssatz 4,43%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 163 627 000	CLP	19. Mrz. 2028	(26 456)
Zahlt Festzinssatz 8,80%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3 305 356 000	COP	18. Jun. 2028	(9 260)
Zahlt Festzinssatz 8,50%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	162 505 000	MXN	30. Nov. 2027	391 487
Erhält Festzinssatz 4,67%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 322 717 000	CLP	21. Jun. 2033	(78 106)
Erhält Festzinssatz 4,67%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	376 657 000	CLP	21. Jun. 2033	(12 736)
Erhält Festzinssatz 3,00%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	17 563 000	CNY	18. Jun. 2028	23 980
Zahlt Festzinssatz 10,54%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	21 600 000	ZAR	21. Jun. 2033	25 471
Zahlt Festzinssatz 2,94%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	216 506 000	KRW	21. Jun. 2033	5 393
Zahlt Festzinssatz 6,49%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	46 765 000	INR	18. Jun. 2028	5 684
Zahlt Festzinssatz 9,10%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1 103 405 000	HUF	19. Jun. 2025	(38 108)
Zahlt Festzinssatz 8,45%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	31 091 000	MXN	15. Jun. 2033	35 453
Zahlt Festzinssatz 8,47%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	24 215 000	MXN	15. Jun. 2033	26 885
Zahlt Festzinssatz 3,26%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	442 479 000	KRW	21. Jun. 2033	7 096
Zahlt Festzinssatz 3,23%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	884 281 000	KRW	21. Jun. 2033	14 926
Zahlt Festzinssatz 9,33%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	65 960 000	MXN	24. Feb. 2028	47 760
Erhält Festzinssatz 9,01%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19 725 000	MXN	17. Feb. 2033	(32 334)
Zahlt Festzinssatz 7,83%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	84 094 000	ZAR	20. Jun. 2025	23 410
Erhält Festzinssatz 8,97%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	10 706 700 000	COP	20. Sep. 2033	(21 274)
Erhält Festzinssatz 4,68%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 495 436 000	CLP	20. Sep. 2033	(50 467)

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Erhält Festzinssatz 3,14%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	20 479 000	CNY	17. Sep. 2028	35 163
Erhält Festzinssatz 3,23%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	9 229 000	CNY	17. Sep. 2028	19 133
Zahlt Festzinssatz 6,68%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	766 308 000	INR	17. Sep. 2028	29 676
Zahlt Festzinssatz 3,16%					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	62 981 100	NOK	20. Sep. 2033	40 364
Zahlt Festzinssatz 3,69%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7 993 000	AUD	18. Sep. 2025	25 052
Zahlt Festzinssatz 3,88%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	18 530 000	AUD	17. Sep. 2028	128 799
Zahlt Festzinssatz 4,59%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	19 785 000	AUD	20. Sep. 2033	256 900
Zahlt Festzinssatz 10,61%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	65 897 000	ZAR	21. Jun. 2033	70 965
Zahlt Festzinssatz 10,82%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32 368 000	ZAR	21. Jun. 2033	25 846
Zahlt Festzinssatz 10,77%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	54 142 000	ZAR	21. Jun. 2033	46 938
Zahlt Festzinssatz 2,72%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	42 693 000	SEK	20. Sep. 2033	12 553
Erhält Festzinssatz 3,82%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4 885 000	NZD	18. Jun. 2028	(79 758)
Erhält Festzinssatz 3,81%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4 885 000	NZD	18. Jun. 2028	(80 679)
Erhält Festzinssatz 8,32%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19 365 000	MXN	30. Mrz. 2033	(79 618)
Zahlt Festzinssatz 8,76%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	92 490 000	MXN	11. Apr. 2028	174 650
Erhält Festzinssatz 11,19%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	90 745 000	MXN	07 Mai 2024	(9 682)
Erhält Festzinssatz 9,07%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	17 140 000	MXN	05. Mai 2026	(26 918)
Zahlt Festzinssatz 2,63%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6 488 000	EUR	18. Sep. 2025	45 108
Erhält Festzinssatz 11,17%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	290 982 000	MXN	20 Mai 2024	(34 688)
Erhält Festzinssatz 9,11%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	100 492 000	MXN	18. Mai 2026	(151 274)
Erhält Festzinssatz 11,16%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	291 030 000	MXN	24 Mai 2024	(36 050)
Erhält Festzinssatz 9,22%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	100 530 000	MXN	22. Mai 2026	(137 097)
Zahlt Festzinssatz 3,31%					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	2 880 000	CAD	20. Sep. 2033	9 929
Zahlt Festzinssatz 4,94%					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	3 771 000	GBP	20. Dez. 2025	(27 498)

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Zahlt Festzinssatz 2,91%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 225 000	EUR	20. Dez. 2028	1 614
Erhält Festzinssatz 5,35%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	10 628 000	NZD	20. Dez. 2024	(33 636)
Zahlt Festzinssatz 3,73%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	23 987 000	CZK	17. Dez. 2028	11 516
Zahlt Festzinssatz 3,54%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	48 481 000	ILS	18. Dez. 2025	74 085
Zahlt Festzinssatz 3,28%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	13 694 000	ILS	17. Dez. 2028	76 538
Erhält Festzinssatz 3,60%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	14 069 000	ILS	20. Dez. 2028	(110 675)
Erhält Festzinssatz 3,77%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	16 303 000	ILS	20. Dez. 2033	(94 394)
Zahlt Festzinssatz 3,67%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	12 443 000	ILS	20. Dez. 2033	170 335
Zahlt Festzinssatz 7,10%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	58 256 000	HUF	20. Dez. 2033	(574)
Zahlt Festzinssatz 8,61%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	107 586 000	ZAR	18. Dez. 2025	(9 572)
Erhält Festzinssatz 3,47%					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	12 633 000	MYR	20. Dez. 2028	(52 215)
Zahlt Festzinssatz 5,16%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	56 160 000	PLN	20. Dez. 2033	(179 408)
Erhält Festzinssatz 5,32%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	62 280 000	PLN	20. Dez. 2025	266 130
Zahlt Festzinssatz 8,78%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	65 728 000	ZAR	20. Dez. 2025	(18 544)
Zahlt Festzinssatz 9,21%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	357 904 000	ZAR	20. Dez. 2028	(174 607)
Erhält Festzinssatz 10,12%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	342 140 000	ZAR	20. Dez. 2033	169 216
Zahlt Festzinssatz 7,90%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	180 999 000	MXN	17. Dez. 2025	147 301
Zahlt Festzinssatz 9,81%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	178 877 000	MXN	18. Dez. 2024	127 381
Erhält Festzinssatz 2,29%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	27 607 000	CNY	20. Dez. 2025	7 938
Zahlt Festzinssatz 5,40%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 349 310 000	CLP	20. Dez. 2025	16 867
Zahlt Festzinssatz 5,41%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 269 317 000	CLP	20. Dez. 2025	15 506
Erhält Festzinssatz 4,81%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3 034 187 000	CLP	20. Dez. 2028	(113 855)
Erhält Festzinssatz 3,00%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	219 055 000	SEK	20. Dez. 2028	(297 438)
Zahlt Festzinssatz 2,72%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	167 540 000	SEK	17. Dez. 2028	171 835

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Zahlt Festzinssatz 4,08%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5 984 000	CZK	20. Dez. 2033	8 524
Erhält Festzinssatz 3,45%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3 810 129 000	CLP	20. Dez. 2033	(302 924)
Zahlt Festzinssatz 11,50%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20 090 000	ZAR	20. Dez. 2033	2 750
Erhält Festzinssatz 8,12%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	180 607 000	MXN	07. Dez. 2033	(843 216)
Zahlt Festzinssatz 8,45%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	36 765 000	MXN	14. Jun. 2028	94 000
Erhält Festzinssatz 4,04%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6 133 960	CZK	20. Dez. 2028	(5 636)
Erhält Festzinssatz 3,58%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 131 100 000	KRW	20. Dez. 2025	(4 760)
Erhält Festzinssatz 3,37%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3 845 000	ILS	20. Dez. 2028	(39 982)
Erhält Festzinssatz 3,66%					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	1 062 000	MYR	20. Dez. 2028	(2 457)
Erhält Festzinssatz 8,23%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20 005 000	MXN	13. Jul. 2033	(90 454)
Zahlt Festzinssatz 3,45%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 071 774 000	KRW	20. Dez. 2033	11 665
Erhält Festzinssatz 4,48%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 680 571 000	CLP	23. Sep. 2025	(16 916)
Erhält Festzinssatz 4,49%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3 160 047 000	CLP	23. Sep. 2025	(31 490)
Erhält Festzinssatz 4,50%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 341 308 000	CLP	23. Sep. 2025	(22 978)
Zahlt Festzinssatz 10,97%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	9 374 000	ZAR	20. Dez. 2033	7 760
Erhält Festzinssatz 9,58%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	943 887 000	HUF	20. Dez. 2024	5 644
Erhält Festzinssatz 9,58%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	943 717 000	HUF	20. Dez. 2024	5 643
Zahlt Festzinssatz 11,12%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	5 847 000	ZAR	20. Dez. 2033	3 692
Erhält Festzinssatz 3,27%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2 031 000	SGD	20. Dez. 2025	(6 912)
Zahlt Festzinssatz 3,64%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	860 926 000	KRW	20. Dez. 2033	4 708
Erhält Festzinssatz 8,55%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	532 058 000	HUF	20. Dez. 2025	5 494
Erhält Festzinssatz 8,29%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	521 039 000	HUF	20. Dez. 2025	(1 053)
Erhält Festzinssatz 4,88%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 670 694 000	CLP	18. Sep. 2025	(10 247)
Erhält Festzinssatz 4,88%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 670 693 000	CLP	23. Sep. 2025	(10 062)



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Erhält Festzinssatz 4,69%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	90 412 000	USD	20. Sep. 2025	(114 269)
Erhält Festzinssatz 6,86%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	240 879 000	HUF	20. Dez. 2033	(1 264)
Erhält Festzinssatz 11,30%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	404 630 000	MXN	26. Apr. 2024	(21 729)
Erhält Festzinssatz 6,86%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	141 911 000	HUF	20. Dez. 2033	(745)
Erhält Festzinssatz 6,82%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	267 763 232	HUF	20. Dez. 2033	(2 277)
Erhält Festzinssatz 6,80%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	321 315 878	HUF	20. Dez. 2033	(3 256)
Zahlt Festzinssatz 8,34%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	67 634 000	ZAR	20. Dez. 2025	9 155
Erhält Festzinssatz 6,80%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	267 763 231	HUF	20. Dez. 2033	(2 713)
Erhält Festzinssatz 4,88%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	33 635 000	PLN	20. Dez. 2025	81 229
Zahlt Festzinssatz 5,32%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	32 635 000	PLN	20. Dez. 2024	(62 145)
Zahlt Festzinssatz 4,72%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11 515 000	PLN	20. Dez. 2026	(30 585)
Erhält Festzinssatz 8,47%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	794 043 544	HUF	20. Dez. 2025	5 088
Erhält Festzinssatz 8,45%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	433 114 656	HUF	20. Dez. 2025	2 416
Erhält Festzinssatz 9,54%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1 980 143 220	HUF	20. Dez. 2024	9 906
Zahlt Festzinssatz 3,67%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	514 354 000	KRW	20. Dez. 2033	4 800
Zahlt Festzinssatz 3,69%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	3 159 599 000	KRW	20. Dez. 2033	26 122
Erhält Festzinssatz 3,66%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	4 049 080 000	KRW	20. Dez. 2028	(19 950)
Erhält Festzinssatz 5,04%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	264 959 000	CLP	20. Dez. 2028	(7 075)
Zahlt Festzinssatz 3,53%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	4 368 000	SGD	20. Dez. 2024	3 250
Zahlt Festzinssatz 3,25%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	506 000	SGD	20. Dez. 2033	5 394
Zahlt Festzinssatz 5,33%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	551 725 000	CLP	20. Dez. 2033	12 928
Zahlt Festzinssatz 4,21%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	38 390 000	CZK	20. Dez. 2033	36 930
Erhält Festzinssatz 8,09%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	11 402 030 000	HUF	20. Dez. 2025	(131 356)
Zahlt Festzinssatz 6,73%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 638 730 000	HUF	20. Dez. 2028	72 761

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Erhält Festzinssatz 6,76%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	263 290 000	HUF	20. Dez. 2030	(10 624)
Erhält Festzinssatz 6,65%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	958 286 000	HUF	20. Dez. 2033	(72 752)
Erhält Festzinssatz 3,92%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	124 475 000	PLN	20. Dez. 2025	(197 315)
Zahlt Festzinssatz 3,99%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5 685 000	PLN	20. Dez. 2028	26 212
Erhält Festzinssatz 4,47%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5 560 000	PLN	20. Dez. 2033	(47 270)
Zahlt Festzinssatz 8,22%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	598 620 000	ZAR	20. Dez. 2024	98 557
Erhält Festzinssatz 8,06%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	353 300 000	ZAR	20. Dez. 2025	(141 927)
Zahlt Festzinssatz 8,09%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	107 850 000	ZAR	20. Dez. 2026	69 020
Erhält Festzinssatz 9,01%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13 315 000	ZAR	20. Dez. 2030	(15 551)
Erhält Festzinssatz 9,55%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	114 735 000	ZAR	20. Dez. 2033	(160 255)
Erhält Festzinssatz 5,32%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4 726 330 000	CLP	20. Dez. 2030	(78 079)
Erhält Festzinssatz 5,01%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	206 095 000	CZK	20. Dez. 2025	(519)
Erhält Festzinssatz 4,30%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	124 040 000	CZK	20. Dez. 2028	(51 693)
Erhält Festzinssatz 3,53%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11 265 000	EUR	20. Dez. 2025	(5 805)
Zahlt Festzinssatz 3,09%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4 560 000	EUR	20. Dez. 2030	48 420
Erhält Festzinssatz 3,13%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 530 000	EUR	20. Dez. 2033	(17 003)
Zahlt Festzinssatz 4,01%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	116 680 000	PLN	20. Dez. 2028	516 504
Erhält Festzinssatz 4,46%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	35 350 000	PLN	20. Dez. 2033	(305 962)
Erhält Festzinssatz 11,32%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	31 170 000	ZAR	20. Dez. 2033	(11 951)
Erhält Festzinssatz 4,53%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	22 270 000	USD	20. Dez. 2025	(88 236)
Zahlt Festzinssatz 3,94%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	18 970 000	USD	20. Dez. 2028	244 833
Erhält Festzinssatz 3,84%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3 180 000	USD	20. Dez. 2033	(86 573)
Zahlt Festzinssatz 6,84%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	5 867 775 000	HUF	20. Dez. 2028	192 649
Zahlt Festzinssatz 4,61%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 954 000	PLN	20. Dez. 2033	18 214

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Zahlt Festzinssatz 4,95%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	37 322 000	CZK	20. Dez. 2025	2 076
Zahlt Festzinssatz 3,87%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3 520 000	ILS	20. Dez. 2033	33 660
Erhält Festzinssatz 8,03%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	160 105 000	ZAR	20. Dez. 2025	(68 476)
Zahlt Festzinssatz 8,20%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	153 340 000	ZAR	20. Dez. 2024	26 375
Zahlt Festzinssatz 5,30%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 187 925 000	CLP	20. Dez. 2028	16 503
Zahlt Festzinssatz 3,24%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	495 000	SGD	20. Dez. 2028	3 221
Erhält Festzinssatz 4,21%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7 451 000	PLN	20. Dez. 2025	(2 695)
Erhält Festzinssatz 4,16%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	22 249 000	PLN	20. Dez. 2025	(13 158)
Zahlt Festzinssatz 4,31%					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	5 398 000	GBP	20. Mrz. 2034	(6 682)
Erhält Festzinssatz 3,79%					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	8 691 000	MYR	20. Mrz. 2029	(11 117)
Erhält Festzinssatz 3,78%					
Zahlt variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	12 927 000	CAD	20. Mrz. 2034	(284 318)
Erhält Festzinssatz 4,81%					
Zahlt variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	8 159 000	CAD	20. Mrz. 2025	(12 015)
Zahlt Festzinssatz 4,56%					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	24 029 000	CAD	20. Mrz. 2026	87 568
Zahlt Festzinssatz 7,99%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	178 074 000	ZAR	20. Mrz. 2026	80 505
Zahlt Festzinssatz 8,54%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	155 722 000	ZAR	20. Mrz. 2029	164 440
Zahlt Festzinssatz 6,54%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	113 431 000	HUF	20. Mrz. 2034	7 362
Zahlt Festzinssatz 6,47%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	165 967 000	HUF	20. Mrz. 2034	12 797
Zahlt Festzinssatz 6,50%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	284 108 000	HUF	20. Mrz. 2034	20 573
Erhält Festzinssatz 7,30%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	768 940 000	HUF	20. Mrz. 2026	(10 465)
Erhält Festzinssatz 6,44%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 389 309 000	HUF	20. Mrz. 2029	(57 462)
Erhält Festzinssatz 4,03%					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	20 625 000	NOK	20. Mrz. 2034	(5 999)
Zahlt Festzinssatz 4,69%					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	412 419 000	NOK	20. Mrz. 2026	(108 677)
Zahlt Festzinssatz 3,94%					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	313 588 000	NOK	18. Mrz. 2029	25 650
Erhält Festzinssatz 4,25%					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	198 160 000	NOK	20. Mrz. 2029	29 508

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Zahlt Festzinssatz 4,25%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	21 912 000	AUD	20. Mrz. 2029	124 410
Erhält Festzinssatz 3,98%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5 100 000	PLN	20. Dez. 2025	(6 849)
Erhält Festzinssatz 3,90%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4 794 000	PLN	20. Dez. 2025	(7 940)
Erhält Festzinssatz 3,88%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10 506 000	PLN	20. Dez. 2025	(18 496)
Zahlt Festzinssatz 3,86%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	9 667 000	MYR	18. Mrz. 2029	10 033
Erhält Festzinssatz 2,21%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	27 009 000	CNY	20. Mrz. 2026	(2 063)
Erhält Festzinssatz 2,72%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	42 071 000	CNY	18. Mrz. 2029	(9 064)
Erhält Festzinssatz 9,02%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	41 245 000	MXN	26. Aug. 2033	(68 979)
Zahlt Festzinssatz 11,28%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	337 554 000	ZAR	21. Mrz. 2034	179 918
Erhält Festzinssatz 9,61%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	148 530 000	ZAR	20. Mrz. 2034	(218 249)
Erhält Festzinssatz 9,61%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	87 231 000	ZAR	20. Mrz. 2034	(127 324)
Zahlt Festzinssatz 4,91%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4 226 000	USD	20. Mrz. 2025	8 471
Zahlt Festzinssatz 4,38%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	44 220 000	USD	20. Mrz. 2026	190 403
Zahlt Festzinssatz 3,97%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	19 110 000	USD	20. Mrz. 2029	223 414
Erhält Festzinssatz 3,88%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	11 624 000	USD	20. Mrz. 2034	(312 187)
Erhält Festzinssatz 4,12%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12 811 000	CZK	20. Mrz. 2029	(6 047)
Zahlt Festzinssatz 4,16%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	27 389 000	CZK	20. Mrz. 2034	23 655
Zahlt Festzinssatz 3,81%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3 901 000	USD	19. Mrz. 2026	8 933
Zahlt Festzinssatz 3,78%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	120 978 000	SEK	20. Mrz. 2026	(9 124)
Zahlt Festzinssatz 3,25%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	115 091 000	SEK	20. Mrz. 2034	97 101
Erhält Festzinssatz 0,91%					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	42 772 000	JPY	20. Mrz. 2034	(2 479)
Zahlt Festzinssatz 1,31%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	53 475 000	JPY	21. Mrz. 2034	1 321
Erhält Festzinssatz 3,63%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	708 534 000	KRW	18. Mrz. 2029	(1 825)
Erhält Festzinssatz 3,29%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	9 955 000	SGD	20. Mrz. 2026	(24 825)

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Zahlt Festzinssatz 3,21%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	4 491 000	SGD	20. Mrz. 2029	31 145
Zahlt Festzinssatz 3,22%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	125 000	SGD	20. Mrz. 2034	1 491
Erhält Festzinssatz 4,47%					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	38 487 000	AUD	20. Mrz. 2034	(458 787)
Zahlt Festzinssatz 4,06%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	42 390 000	AUD	20. Mrz. 2026	89 829
Zahlt Festzinssatz 3,78%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4 256 000	EUR	20. Mrz. 2025	3 820
Zahlt Festzinssatz 3,41%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	48 851 000	EUR	20. Mrz. 2026	49 233
Erhält Festzinssatz 3,09%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 684 000	EUR	21. Mrz. 2034	(22 839)
Erhält Festzinssatz 10,27%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	22 564 891 000	COP	20. Dez. 2024	(19 233)
Erhält Festzinssatz 4,04%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	12 265 000	ILS	21. Mrz. 2034	(42 054)
Zahlt Festzinssatz 3,93%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3 802 000	ILS	20. Mrz. 2034	30 556
Zahlt Festzinssatz 5,12%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4 674 490 000	CLP	20. Mrz. 2034	160 869
Erhält Festzinssatz 6,34%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	7 564 357 000	CLP	20. Dez. 2024	(34 678)
Erhält Festzinssatz 4,97%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4 286 871 000	CLP	20. Mrz. 2029	(97 295)
Erhält Festzinssatz 3,99%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6 342 000	PLN	20. Dez. 2028	(29 057)
Zahlt Festzinssatz 8,74%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	406 081 000	MXN	14. Mrz. 2029	500 255
Zahlt Festzinssatz 8,86%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18 873 000	MXN	15. Mrz. 2034	12 546
Erhält Festzinssatz 8,83%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	135 334 000	MXN	08. Mrz. 2034	(242 419)
Zahlt Festzinssatz 10,76%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	128 834 000	MXN	18. Dez. 2024	25 683
Zahlt Festzinssatz 9,18%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	204 773 000	MXN	17. Dez. 2025	37 245
Erhält Festzinssatz 9,87%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	93 339 000	MXN	17. Dez. 2025	(47 693)
Zahlt Festzinssatz 4,49%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4 235 000	PLN	20. Dez. 2033	35 139
Erhält Festzinssatz 4,12%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12 695 000	CZK	20. Dez. 2028	(9 720)
Erhält Festzinssatz 3,92%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	88 086 000	PLN	20. Mrz. 2026	(61 254)
Erhält Festzinssatz 5,32%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	25 223 000	PLN	21. Mrz. 2034	(67 698)

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Erhält Festzinssatz 9,27%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20 915 000	MXN	31. Aug. 2033	(15 894)
Zahlt Festzinssatz 9,38%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	69 200 000	MXN	06. Sep. 2028	34 822
Zahlt Festzinssatz 3,29%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	1 248 000	SGD	20. Dez. 2028	6 083
Erhält Festzinssatz 9,02%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20 725 000	MXN	01. Sep. 2033	(35 101)
Erhält Festzinssatz 4,22%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10 964 000	PLN	20. Dez. 2028	(26 655)
Zahlt Festzinssatz 5,19%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 805 195 000	CLP	20. Dez. 2033	62 547
Erhält Festzinssatz 5,25%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	8 834 240 000	CLP	20. Dez. 2026	(135 837)
Zahlt Festzinssatz 4,84%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	10 798 000	NZD	20. Dez. 2028	80 087
Zahlt Festzinssatz 4,63%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7 717 000	NZD	20. Dez. 2033	71 764
Erhält Festzinssatz 5,03%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5 945 000	NZD	18. Dez. 2025	(9 150)
Erhält Festzinssatz 4,75%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1 224 000	NZD	20. Dez. 2033	(20 661)
Zahlt Festzinssatz 3,41%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	1 477 000	SGD	20. Dez. 2028	1 118
Zahlt Festzinssatz 6,56%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	240 751 000	HUF	20. Dez. 2033	22 407
Zahlt Festzinssatz 6,56%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	140 549 000	HUF	20. Dez. 2033	12 981
Erhält Festzinssatz 6,53%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	431 661 000	HUF	20. Dez. 2028	(28 777)
Erhält Festzinssatz 6,53%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	247 199 000	HUF	20. Dez. 2028	(16 480)
Erhält Festzinssatz 6,80%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	156 708 000	HUF	20. Dez. 2033	(1 588)
Erhält Festzinssatz 4,88%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4 105 000	USD	20. Dez. 2025	7 738
Zahlt Festzinssatz 4,28%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3 470 000	USD	20. Dez. 2028	(639)
Zahlt Festzinssatz 8,73%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	BNP Paribas	18 097 210 000	HUF	25. Jun. 2024	60 801
Erhält Festzinssatz 6,76%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	839 697 000	HUF	20. Dez. 2033	(11 245)
Erhält Festzinssatz 4,33%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	39 765 000	CZK	20. Dez. 2028	(14 259)
Zahlt Festzinssatz 4,41%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7 650 000	PLN	20. Dez. 2028	4 518
Zahlt Festzinssatz 3,79%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 487 625 000	KRW	20. Dez. 2033	2 794



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Erhält Festzinssatz 3,85%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	5 970 000 000	KRW	20. Dez. 2025	(1 482)
Erhält Festzinssatz 9,84%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	35 702 000	ZAR	20. Dez. 2033	(15 598)
Erhält Festzinssatz 9,83%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	21 198 000	ZAR	20. Dez. 2033	(9 969)
Zahlt Festzinssatz 8,80%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32 816 000	ZAR	20. Dez. 2028	12 004
Zahlt Festzinssatz 8,91%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32 224 000	ZAR	20. Dez. 2028	3 947
Erhält Festzinssatz 9,93%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20 919 000	ZAR	20. Dez. 2033	(2 574)
Erhält Festzinssatz 9,93%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20 962 000	ZAR	20. Dez. 2033	(2 720)
Zahlt Festzinssatz 8,91%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32 379 000	ZAR	20. Dez. 2028	4 101
Zahlt Festzinssatz 3,97%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6 881 000	USD	18. Dez. 2034	56 630
Erhält Festzinssatz 5,63%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5 115 000	NZD	20. Dez. 2025	(2 939)
Erhält Festzinssatz 8,17%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 474 758 000	HUF	20. Dez. 2025	(11 387)
Erhält Festzinssatz 4,27%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3 862 000	ILS	20. Dez. 2028	(914)
Zahlt Festzinssatz 5,10%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	54 219 000	CZK	20. Dez. 2025	(3 850)
Zahlt Festzinssatz 3,44%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3 195 000	EUR	20. Dez. 2028	(22 721)
Erhält Festzinssatz 9,73%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	44 926 000	MXN	07. Dez. 2033	50 993
Erhält Festzinssatz 9,70%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	44 927 000	MXN	07. Dez. 2033	46 159
Erhält Festzinssatz 9,60%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	22 463 000	MXN	07. Dez. 2033	15 626
Erhält Festzinssatz 6,98%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	870 347 000	HUF	20. Dez. 2033	4 082
Erhält Festzinssatz 7,05%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	419 282 000	HUF	20. Dez. 2033	4 288
Erhält Festzinssatz 9,50%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	22 463 000	MXN	07. Dez. 2033	7 568
Erhält Festzinssatz 9,50%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	22 463 000	MXN	07. Dez. 2033	7 568
Zahlt Festzinssatz 11,25%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	89 860 000	MXN	18. Dez. 2024	(6 432)
Erhält Festzinssatz 10,52%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	45 521 000	MXN	17. Dez. 2025	7 153

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)</b>					
Erhält Festzinssatz 9,60%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	42 185 000	MXN	16. Sep. 2033	18 040
Erhält Festzinssatz 9,49%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	22 463 000	MXN	07. Dez. 2033	6 762
Erhält Festzinssatz 5,13%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	18 947 000	GBP	20. Dez. 2025	11 626
Erhält Festzinssatz 5,61%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12 534 000	PLN	20. Dez. 2033	(2 481)
				<b>USD</b>	<b>(614 430)</b>

## Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

Zum 30. September 2023 bestand das folgende Risiko bei in Bezug auf Derivatkontrakte einzufordernden Sicherheiten je Kontrahent:

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
<b>Schroder GAIA Asian Equity Long Short*</b>				
	UBS	Barmittel	AUD	10 000
			<b>USD</b>	<b>6 430</b>
<b>Schroder GAIA BlueTrend</b>				
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	2 694 217
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	93 478 379
	J.P. Morgan	Barmittel	MXN	20 430 039
	J.P. Morgan	Barmittel	SEK	19 044 543
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	44 321 061
			<b>USD</b>	<b>50 710 454</b>
<b>Schroder GAIA Egerton Equity</b>				
	HSBC	Barmittel	EUR	3 290 000
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	3
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	3 520 941
			<b>EUR</b>	<b>6 810 943</b>
<b>Schroder GAIA Helix</b>				
	Barclays Bank	Barmittel	USD	710 000
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	3 093 346
	Goldman Sachs	Barmittel	GBP	4 705 250
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	2 655 432
	J.P. Morgan	Barmittel	AUD	267 417
	J.P. Morgan	Barmittel	CAD	13 484
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	7 393 563
	J.P. Morgan	Barmittel	GBP	162 624
	J.P. Morgan	Barmittel	HKD	2 685 884
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	594 153 183
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	24 444 596
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	90 000
			<b>USD</b>	<b>49 427 316</b>
<b>Schroder GAIA Sirios US Equity</b>				
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	2 200 000
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	560 000
			<b>USD</b>	<b>2 760 000</b>

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	Barmittel	EUR	2 669 366	
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	214 000	
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	1 442 810	
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	14 331 697	
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	40 625 461	
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	310 597	
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	4 257 819	
	Société Générale	Barmittel	CAD	54	
	Société Générale	Barmittel	CHF	15	
	Société Générale	Barmittel	CZK	1	
	Société Générale	Barmittel	EUR	47	
	Société Générale	Barmittel	GBP	3 463 705	
	Société Générale	Barmittel	JPY	761 831 712	
	Société Générale	Barmittel	MXN	1	
	Société Générale	Barmittel	USD	899 680	
	Société Générale	Barmittel	ZAR	398 713	
				<b>USD</b>	<b>34 175 923</b>
	Schroder GAIA Wellington Pagosa	Barclays Bank	Barmittel	USD	3 760 000
		BNP Paribas	Barmittel	USD	690 000
		Deutsche Bank	Barmittel	USD	350 000
Goldman Sachs		Barmittel	USD	1 305 064	
HSBC		Barmittel	USD	490 000	
J.P. Morgan		Barmittel	USD	764 000	
Morgan Stanley		Barmittel	AUD	294 913	
Morgan Stanley		Barmittel	CAD	44 309	
Morgan Stanley		Barmittel	CZK	130	
Morgan Stanley		Barmittel	EUR	117 695	
Morgan Stanley		Barmittel	GBP	33 279	
Morgan Stanley		Barmittel	HUF	177 010	
Morgan Stanley		Barmittel	ILS	268	
Morgan Stanley		Barmittel	MXN	226 519	
Morgan Stanley		Barmittel	NOK	1 169	
Morgan Stanley		Barmittel	PLN	41 958	
Morgan Stanley		Barmittel	THB	95 588	
Morgan Stanley		Barmittel	USD	1 560 496	
Morgan Stanley		Barmittel	ZAR	5 170	
UBS		Barmittel	USD	920 000	
			<b>USD</b>	<b>10 252 999</b>	

## Ausweis von Transaktionskosten

Die Transaktionskosten sind Provisionsgebühren der Broker sowie Steuern in Zusammenhang mit dem Kauf und Verkauf von übertragbaren Wertpapieren. Rententeilfonds weisen im Allgemeinen die Angabe Null aus, da die Provisionsgebühren der Broker in der Spanne enthalten sind, die gemäss Anhang I, Schema B, Kapitel V der Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments von der Berechnung ausgeschlossen wird. Der auf die Transaktionskosten entfallende Teil der Anschaffungskosten bzw. des Verkaufspreises der jeweiligen Vermögenswerte und die Transaktionskosten der Depotbank sind in dieser Tabelle nicht enthalten. Die Kosten für strukturierte Produkte sind im Marktwert enthalten.

Die Transaktionskosten für das Berichtsjahr fielen wie folgt aus:

Teilfonds	Währung	Provisionen
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	USD	21 666
Schroder GAIA BlueTrend	USD	198 227
Schroder GAIA Cat Bond	USD	21 080
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	516 929

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Ausweis von Transaktionskosten (Forts.)

Teilfonds	Währung	Provisionen
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	247 064
Schroder GAIA Helix	USD	1 122 683
Schroder GAIA Oaktree Credit	USD	-
Schroder GAIA SEG US Equity*	USD	22 057
Schroder GAIA Sirios US Equity	USD	338 262
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return*	GBP	31 963
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	168 375
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	1 210 769

## Dividenden

Während des Berichtsjahres haben die folgenden Teilfonds Dividendenausschüttungen vorgenommen:

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
14. Okt. 2022	21. Okt. 2022	28. Okt. 2022	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	474,49	USD	2,934929
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	995,43	SGD	3,892037
11. Nov. 2022	18. Nov. 2022	25. Nov. 2022	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1 009,86	USD	6,246428
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2 069,24	SGD	8,089599
09. Dez. 2022	16. Dez. 2022	23. Dez. 2022	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	985,14	USD	6,093138
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2 056,68	SGD	8,038289
29. Dez. 2022	30. Dez. 2022	09. Jan. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF, Aussch.	206 175,84	USD	19,220378
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch.	17,86	USD	1,172043
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in CHF abgesichert	104,27	CHF	1,026639
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in EUR abgesichert	109,72	EUR	1,087351
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in GBP-abgesichert	106,85	GBP	1,051469
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch.	19,71	USD	1,290452
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in CHF abgesichert	115,77	CHF	1,137699
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in EUR abgesichert	121,93	EUR	1,206733
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in GBP-abgesichert	118,69	GBP	1,165501
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch.	20,63	USD	1,348226
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in CHF abgesichert	119,12	CHF	1,169785
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in EUR abgesichert	125,45	EUR	1,241205
13. Jan. 2023	20. Jan. 2023	27. Jan. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1 312,42	USD	8,116879
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2 711,64	SGD	10,595244
10. Feb. 2023	17. Feb. 2023	24. Feb. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1 211,32	USD	7,491177
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2 578,76	SGD	10,072484
10. Mrz. 2023	17. Mrz. 2023	24. Mrz. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1 145,61	USD	7,084338
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2 436,26	SGD	9,512930
30. Mrz. 2023	31. Mrz. 2023	11. Apr. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF, Aussch.	344 750,77	USD	28,503106
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch.	20,16	USD	1,307328
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in CHF abgesichert	120,07	CHF	1,169563

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Ausschüttungen (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in EUR abgesichert	126,00	EUR	1,235247
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in GBP-abgesichert	121,03	GBP	1,178142
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch.	21,99	USD	1,421332
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in CHF abgesichert	132,51	CHF	1,286792
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in EUR abgesichert	139,16	EUR	1,360962
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in GBP-abgesichert	133,68	GBP	1,296884
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch.	22,47	USD	1,448996
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in CHF abgesichert	136,30	CHF	1,322120
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in EUR abgesichert	143,13	EUR	1,399021
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in GBP-abgesichert	23 340,52	GBP	1,320451
14. Apr. 2023	21. Apr. 2023	28. Apr. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1 415,94	USD	8,755496
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2 971,26	SGD	11,597893
12. Mai 2023	19. Mai 2023	26. Mai 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1 292,48	USD	7,991583
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2 735,90	SGD	10,675431
09. Jun. 2023	16. Jun. 2023	23. Jun. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1 277,48	USD	7,898350
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2 682,26	SGD	10,462469
29. Jun. 2023	30. Jun. 2023	10. Jul. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF, Aussch.	385 042,63	USD	30,890249
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch.	21,44	USD	1,371519
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in CHF abgesichert	131,26	CHF	1,262809
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in EUR abgesichert	139,77	EUR	1,353716
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in GBP-abgesichert	133,88	GBP	1,287427
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch.	23,31	USD	1,484906
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in CHF abgesichert	143,99	CHF	1,379355
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in EUR abgesichert	153,41	EUR	1,480392
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in GBP-abgesichert	147,10	GBP	1,408018
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch.	23,54	USD	1,495616
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in CHF abgesichert	148,04	CHF	1,416141
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in EUR abgesichert	157,48	EUR	1,518192
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in GBP-abgesichert	28 087,82	GBP	1,441910
14. Jul. 2023	21. Jul. 2023	28. Jul. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1 670,00	USD	9,641455
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	3 640,64	SGD	12,563895
11. Aug. 2023	18. Aug. 2023	25. Aug. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1 490,40	USD	7,808478
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	3 040,30	SGD	10,488479
08. Sep. 2023	15. Sep. 2023	22. Sep. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1 596,94	USD	7,999915
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	3 093,12	SGD	10,667394
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF, Aussch.	372 898,01	USD	31,902791
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse PI, Aussch.	2 883 251,59	USD	80,858568
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse PI, Aussch., in GBP abgesichert	410 619,58	GBP	8,004205

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
28. Sep. 2023	29. Sep. 2023	06. Okt. 2023	Schroder GAIA BlueTrend, Klasse C, Aussch., in GBP abgesichert	31 258,65	GBP	0,977911
			Schroder GAIA BlueTrend, Klasse E, Aussch., in GBP abgesichert	122 254,42	GBP	1,018715
			Schroder GAIA Helix, Klasse S, Aussch.	1 013,72	USD	8,064603
			Schroder GAIA Helix, Klasse S, Aussch., in EUR abgesichert	722,58	EUR	7,506553
			Schroder GAIA Helix, Klasse S, Aussch., in GBP abgesichert	17 668,30	GBP	7,843513
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch.	24,18	USD	1,525340
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in CHF abgesichert	155,57	CHF	1,476841
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in EUR abgesichert	165,64	EUR	1,582994
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in GBP-abgesichert	162,22	GBP	1,539421
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch.	26,21	USD	1,644311
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in CHF abgesichert	169,56	CHF	1,600691
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in EUR abgesichert	180,51	EUR	1,716643
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in GBP-abgesichert	176,89	GBP	1,668780
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch.	26,34	USD	1,648202
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in CHF abgesichert	173,79	CHF	1,637674
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in EUR abgesichert	184,98	EUR	1,756720
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in GBP-abgesichert	31 324,89	GBP	1,702888

## Gegenseitige Anlagen der Teilfonds

Zum 30. September 2023 belaufen sich die gegenseitigen Anlagen der Teilfonds auf insgesamt 10.041.145 EUR, daher würde der kombinierte Gesamt-NIW am Jahresende ohne gegenseitige Anlagen 4.920.504.270 EUR betragen. Die Einzelheiten zu den gegenseitigen Anlagen der Teilfonds sind in der folgenden Tabelle angegeben:

Anlage	Währung des Teilfonds	Marktwert	Nettovermögen	%
<b>Schroder GAIA Helix</b>				
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*		10 616 000		3,58
	<b>USD</b>	<b>10 616 000</b>		<b>3,58</b>

## Wechselkurs

Der folgende Wechselkurs wurde für die Berechnung des im Abschluss zum 30. September 2023 in EUR ausgewiesenen Gesamtbetrags verwendet:

1 Euro = 0,94585 US-Dollar

1 Euro = 1,15403 Pfund Sterling

## Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Zum Zeitpunkt der Genehmigung des Abschlusses waren keine wesentlichen Ereignisse nach dem Bilanzstichtag eingetreten.



# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW	Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
<b>Schroder GAIA Asian Equity Long Short*</b>			<b>Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)</b>		
Klasse A Thes.	13	0,84%	Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes.	15	0,96%	Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse Y1 Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse IZ Thes.	15	0,99%	Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#
<b>Schroder GAIA BlueTrend</b>			Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse A Thes.	20	0,00%	Klasse Y2 Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes.	99	0,00%	Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	0	0,00%	<b>Schroder GAIA Contour Tech Equity</b>		
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse A Thes.	0	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	114	0,00%	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	23	0,00%	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse A Thes., in SGD abgesichert	0	0,00%
Klasse E Thes.	0	0,00%	Klasse A1 Thes.	0	0,00%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes.	0	0,00%
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	209	0,00%	Klasse C Thes., in SEK abgesichert	0	0,00%
<b>Schroder GAIA Cat Bond</b>			Klasse E Thes.	0	0,00%
Klasse A Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse E Thes., in SEK abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes.	n. z.#	n. z.#	<b>Schroder GAIA Egerton Equity</b>		
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse A Thes.	0	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse A Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse A Thes., in USD abgesichert	0	0,00%
Klasse F Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse A Aussch. GBP	0	0,00%
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse A1 Thes.	0	0,00%
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	0	0,00%
Klasse F Aussch.	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes.	0	0,00%
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%
Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes., in USD abgesichert	0	0,00%
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse C Aussch.	0	0,00%
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse C Aussch. GBP	0	0,00%
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse E Thes.	0	0,00%
Klasse IF Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse X Thes.	0	0,00%
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	n. z.#	n. z.#	<b>Schroder GAIA Helix</b>		
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse A Thes.	0	0,00%
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse IF Aussch.	n. z.#	n. z.#	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	128 370	0,50%	Klasse A Thes., in SEK abgesichert	0	0,00%
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	265 721	0,70%	Klasse A Thes., in SGD abgesichert	0	0,00%
Klasse PI Aussch.	457 402	0,97%	Klasse C Thes.	0	0,00%
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	76 419	0,90%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse Y Thes.	n. z.#	n. z.#			

# Für die Anteilsklasse wird keine Performancegebühr erhoben.

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

## Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse (Forts.)

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW	Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
<b>Schroder GAIA Helix (Forts.)</b>			<b>Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)</b>		
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes.	418 849	0,81%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	11 570	0,42%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	128 487	0,55%
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	34 776	0,55%
Klasse C1 Thes.	0	0,00%	Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	65	0,21%
Klasse E Thes.	0	0,00%	Klasse E Thes.	713	0,65%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	4 054	0,30%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse X Thes.	15	0,89%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse X Thes., in EUR abgesichert	48	0,43%
Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#	<b>Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund*</b>		
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes.	0	0,00%
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse S Aussch.	0	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in USD abgesichert	0	0,00%
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
<b>Schroder GAIA SEG US Equity*</b>			Klasse K Thes., in USD abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes.	0	0,00%	Klasse R Thes.	0	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse R Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse R Thes., in USD abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	<b>Schroder GAIA Two Sigma Diversified</b>		
Klasse IZ Thes.	32	0,00%	Klasse C Thes.	2 229 443	0,93%
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	632 889	0,63%
Klasse K Thes.	0	0,00%	Klasse K Thes.	375 787	0,66%
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse K Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa</b>		
Klasse R1 Thes.	0	0,00%	Klasse A Thes.	0	0,00%
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse R2 Thes.	0	0,00%	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	464	0,00%
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse A Thes., in SGD abgesichert	22	0,00%
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes.	14 550	0,01%
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in BRL abgesichert	567	0,00%
Klasse R3 Thes.	0	0,00%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	367	0,00%
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	2 331	0,00%
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	285	0,00%
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	1	0,00%
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse E Thes.	50	0,00%
<b>Schroder GAIA Sirios US Equity</b>			Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse A Thes.	477 988	0,53%	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	917	0,01%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse E Thes., in GBP abgesichert	219	0,00%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	12 705	0,10%			

Für den Schroder GAIA Oaktree Credit wird keine Performancegebühr erhoben.

# Für die Anteilsklasse wird keine Performancegebühr erhoben.

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Gesamtkostenquote (die «TER»)<sup>^</sup> für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr	Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr
<b>Schroder GAIA Asian Equity Long Short*</b>			<b>Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)</b>		
Klasse A Thes.	3,14%	0,84%	Klasse Y Thes.	1,07%	n. z.#
Klasse C Thes.	2,52%	0,96%	Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	1,10%	n. z.#
Klasse I Thes.	0,14%	n. z.#	Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	1,10%	n. z.#
Klasse IZ Thes.	2,26%	0,99%	Klasse Y1 Thes.	1,48%	n. z.#
<b>Schroder GAIA BlueTrend</b>			Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	1,52%	n. z.#
Klasse A Thes.	2,00%	0,00%	Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	1,52%	n. z.#
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,03%	0,00%	Klasse Y2 Thes.	0,42%	n. z.#
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,03%	0,00%	Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	0,45%	n. z.#
Klasse C Thes.	1,40%	0,00%	Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	0,45%	n. z.#
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,43%	0,00%	Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	0,44%	n. z.#
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,43%	0,00%	<b>Schroder GAIA Contour Tech Equity</b>		
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,43%	0,00%	Klasse A Thes.	2,42%	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,43%	0,00%	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,43%	0,00%	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,45%	0,00%
Klasse E Thes.	1,40%	0,00%	Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,45%	0,00%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,43%	0,00%	Klasse A1 Thes.	2,92%	0,00%
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	1,43%	0,00%	Klasse C Thes.	1,67%	0,00%
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	1,43%	0,00%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,70%	0,00%
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	1,42%	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,70%	0,00%
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	1,45%	0,00%	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,70%	0,00%
<b>Schroder GAIA Cat Bond</b>			Klasse C Thes., in SEK abgesichert	1,70%	0,00%
Klasse A Thes.	1,77%	n. z.#	Klasse E Thes.	1,42%	0,00%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	1,82%	n. z.#	Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,46%	0,00%
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	1,81%	n. z.#	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,45%	0,00%
Klasse C Thes.	1,37%	n. z.#	Klasse E Thes., in SEK abgesichert	1,44%	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,40%	n. z.#	<b>Schroder GAIA Egerton Equity</b>		
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,41%	n. z.#	Klasse A Thes.	2,42%	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,41%	n. z.#	Klasse A Thes., in GBP abgesichert	2,45%	0,00%
Klasse F Thes.	1,72%	n. z.#	Klasse A Thes., in USD abgesichert	2,45%	0,00%
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	1,73%	n. z.#	Klasse A Aussch. GBP	2,43%	0,00%
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	1,73%	n. z.#	Klasse A1 Thes.	2,92%	0,00%
Klasse F Aussch.	1,72%	n. z.#	Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	2,96%	0,00%
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	1,73%	n. z.#	Klasse C Thes.	1,67%	0,00%
Klasse I Thes.	0,14%	n. z.#	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,69%	0,00%
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	0,15%	n. z.#	Klasse C Thes., in USD abgesichert	1,70%	0,00%
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	0,13%	n. z.#	Klasse C Aussch.	1,68%	0,00%
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,16%	n. z.#	Klasse C Aussch. GBP	1,67%	0,00%
Klasse IF Thes.	1,32%	n. z.#	Klasse E Thes.	1,68%	0,00%
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	1,33%	n. z.#	Klasse X Thes.	1,57%	0,00%
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	1,33%	n. z.#	<b>Schroder GAIA Helix</b>		
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	1,33%	n. z.#	Klasse A Thes.	2,43%	0,00%
Klasse IF Aussch.	1,32%	n. z.#	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,47%	0,00%
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	1,11%	0,50%	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	1,31%	0,70%	Klasse A Thes., in SEK abgesichert	2,43%	0,00%
Klasse PI Aussch.	1,57%	0,97%	Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	1,51%	0,90%			

Beachten Sie bitte, dass die Transaktionskosten – wie in den Anmerkungen zum Abschluss angegeben – sowie Transaktionskosten in Verbindung mit dem zugrunde liegenden Portfolio strukturierter Produkte nicht in der oben aufgeführten TER berücksichtigt werden.

Legende:

<sup>^</sup> Die Gesamtkostenquote (TER) wurde in auf der Grundlage der Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der Gesamtkostenquote (TER) von kollektiven Kapitalanlagen vom 16. Mai 2008 der Asset Management Association Switzerland AMAS berechnet. Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufspreis der Effekten (sofern zutreffend) enthalten. Diese Kosten, die nicht als Betriebsaufwand behandelt werden, werden bei der Berechnung der TER nicht berücksichtigt. Die TER wird für die letzten zwölf Monate berechnet. Die Gesamtkostenquote wird für Zeiträume von weniger als einem Jahr annualisiert.

# Performancegebühr wird der Anteilsklasse/dem Teilfonds nicht berechnet.

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Gesamtkostenquote («TER»)<sup>^</sup> für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr	Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr
<b>Schroder GAIA Helix (Forts.)</b>			<b>Schroder GAIA SEG US Equity* (Forts.)</b>		
Klasse C Thes.	1,38%	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,84%	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,41%	0,00%	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,82%	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,40%	0,00%	Klasse IZ Thes.	1,41%	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,41%	0,00%	Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	1,46%	0,00%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	1,06%	0,00%	Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	1,43%	0,00%
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	1,40%	0,00%	Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	1,42%	0,00%
Klasse C1 Thes.	1,29%	0,00%	Klasse K Thes.	1,99%	0,00%
Klasse E Thes.	1,00%	0,00%	Klasse K Thes., in CHF abgesichert	2,24%	0,00%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0,97%	0,00%	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	2,23%	0,00%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0,98%	0,00%	Klasse K Thes., in GBP abgesichert	2,21%	0,00%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0,99%	0,00%	Klasse R1 Thes.	2,04%	0,00%
Klasse I Thes.	0,15%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	2,06%	0,00%
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,15%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse R2 Thes.	1,43%	0,00%
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	1,15%	0,00%	Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	1,46%	0,00%
Klasse S Aussch.	0,55%	0,00%	Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	1,47%	0,00%
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0,58%	0,00%	Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	1,47%	0,00%
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0,58%	0,00%	Klasse R3 Thes.	1,68%	0,00%
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0,78%	0,00%	Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	1,72%	0,00%
<b>Schroder GAIA Oaktree Credit</b>			Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse A2 Thes.	1,36%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	1,72%	0,00%
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	1,58%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	2,62%	0,00%
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	1,58%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	1,46%	0,00%
Klasse A2 Aussch.	1,38%	n. z. <sup>#</sup>	<b>Schroder GAIA Sirius US Equity</b>		
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	1,58%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse A Thes.	2,95%	0,53%
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	1,59%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	1,57%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,55%	0,10%
Klasse C Thes.	1,05%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse C Thes.	2,49%	0,81%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,08%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	2,12%	0,42%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,08%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	2,25%	0,55%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,07%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	2,25%	0,55%
Klasse C Aussch.	0,90%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,92%	0,21%
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	1,08%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse E Thes.	2,01%	0,65%
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	1,08%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,70%	0,30%
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,06%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse X Thes.	2,42%	0,89%
Klasse E Thes.	0,90%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse X Thes., in EUR abgesichert	2,03%	0,43%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0,93%	n. z. <sup>#</sup>	<b>Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund*</b>		
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0,93%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse C Thes.	1,12%	0,00%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0,92%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,15%	0,00%
Klasse E Aussch.	0,80%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,14%	0,00%
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	0,93%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse C Thes., in USD abgesichert	1,14%	0,00%
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	0,93%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse I Thes.	0,05%	n. z. <sup>#</sup>
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	0,93%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	1,67%	0,00%
Klasse I Thes.	0,14%	n. z. <sup>#</sup>	Klasse K Thes., in USD abgesichert	1,67%	0,00%
<b>Schroder GAIA SEG US Equity*</b>			Klasse R Thes.	1,12%	0,00%
Klasse C Thes.	1,52%	0,00%	Klasse R Thes., in EUR abgesichert	1,15%	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,79%	0,00%	Klasse R Thes., in USD abgesichert	1,15%	0,00%

Beachten Sie bitte, dass die Transaktionskosten – wie in den Anmerkungen zum Abschluss angegeben – sowie Transaktionskosten in Verbindung mit dem zugrunde liegenden Portfolio strukturierter Produkte nicht in der oben aufgeführten TER berücksichtigt werden.

Legende:

<sup>^</sup> Die Gesamtkostenquote (TER) wurde in auf der Grundlage der Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der Gesamtkostenquote (TER) von kollektiven Kapitalanlagen vom 16. Mai 2008 der Asset Management Association Switzerland AMAS berechnet. Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufspreis der Effekten (sofern zutreffend) enthalten. Diese Kosten, die nicht als Betriebsaufwand behandelt werden, werden bei der Berechnung der TER nicht berücksichtigt. Die TER wird für die letzten zwölf Monate berechnet. Die Gesamtkostenquote wird für Zeiträume von weniger als einem Jahr annualisiert.

<sup>#</sup> Performancegebühr wird der Anteilsklasse/dem Teilfonds nicht berechnet.

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

# Gesamtkostenquote (die «TER»)<sup>^</sup> für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr
<b>Schroder GAIA Two Sigma Diversified</b>		
Klasse C Thes.	2,74%	0,93%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,85%	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,84%	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	2,46%	0,63%
Klasse K Thes.	2,98%	0,66%
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	2,35%	0,00%
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	2,35%	0,00%
<b>Schroder GAIA Wellington Pagosa</b>		
Klasse A Thes.	2,43%	0,00%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse C Thes.	1,68%	0,01%
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	1,70%	0,00%
Klasse E Thes.	1,18%	0,00%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,21%	0,00%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,22%	0,01%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	1,21%	0,00%

Beachten Sie bitte, dass die Transaktionskosten – wie in den Anmerkungen zum Abschluss angegeben – sowie Transaktionskosten in Verbindung mit dem zugrunde liegenden Portfolio strukturierter Produkte nicht in der oben aufgeführten TER berücksichtigt werden.

Legende:

<sup>^</sup> Die Gesamtkostenquote (TER) wurde in auf der Grundlage der Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der Gesamtkostenquote (TER) von kollektiven Kapitalanlagen vom 16. Mai 2008 der Asset Management Association Switzerland AMAS berechnet. Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufspreis der Effekten (sofern zutreffend) enthalten. Diese Kosten, die nicht als Betriebsaufwand behandelt werden, werden bei der Berechnung der TER nicht berücksichtigt. Die TER wird für die letzten zwölf Monate berechnet. Die Gesamtkostenquote wird für Zeiträume von weniger als einem Jahr annualisiert.

# Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)

## 1. Commitment-Ansatz

Dieser Ansatz wird für die Fonds verwendet, die nur in geringem Umfang Derivate einsetzen, oder für Fonds, deren Derivateinsatz auf maximal 100% des Nettoinventarwerts beschränkt ist.

### Teilfonds

Schroder GAIA Sirios US Equity  
Schroder GAIA Cat Bond  
Schroder GAIA Oaktree Credit

## 2. Absoluter VaR-Ansatz

Dieser Ansatz wird für die Fonds verwendet, die anhand eines absoluten Ertragsziels, eines absoluten Volatilitäts-Limits oder einer angestrebten Outperformance gegenüber einer Zins-Benchmark verwaltet werden.

### Teilfonds

Schroder GAIA Asian Equity Long Short\*  
Schroder GAIA BlueTrend  
Schroder GAIA Contour Tech Equity  
Schroder GAIA Egerton Equity  
Schroder GAIA Helix  
Schroder GAIA Two Sigma Diversified  
Schroder GAIA SEG US Equity\*  
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund\*  
Schroder GAIA Wellington Pagosa

### Ausschöpfung des regulatorischen VaR-Limits

Teilfonds	Niedrigstes	Höchstes	Durchschnitt	Durchschnittliche Hebelung
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	11,70%	19,00%	15,63%	225,42%
Schroder GAIA BlueTrend	13,04%	62,62%	34,21%	1280,95%
Schroder GAIA Contour Tech Equity	23,36%	45,74%	34,45%	118,70%
Schroder GAIA Egerton Equity	30,65%	50,69%	41,96%	142,77%
Schroder GAIA Helix	9,00%	15,97%	12,48%	705,63%
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	16,93%	28,95%	23,23%	538,49%
Schroder GAIA SEG US Equity*	34,52%	51,37%	45,14%	125,34%
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund*	7,87%	17,78%	13,52%	111,52%
Schroder GAIA Wellington Pagosa	6,13%	14,20%	9,01%	857,44%

## Angaben zum VaR-Modell

Teilfonds	Modelltyp	Konfidenzintervall	Haltedauer	Beobachtungszeitraum
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	Parameter-Simulation	99%	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA BlueTrend	MonteCarlo-Simulation	99%	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA Contour Tech Equity	MonteCarlo-Simulation	99%	20 Tage	3 Jahre
Schroder GAIA Egerton Equity	MonteCarlo-Simulation	99%	20 Tage	3 Jahre
Schroder GAIA Helix	Parameter-Simulation	99%	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	MonteCarlo-Simulation	99%	20 Tage	3 Jahre
Schroder GAIA SEG US Equity*	MonteCarlo-Simulation	99%	20 Tage	3 Jahre
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund*	MonteCarlo-Simulation	99%	20 Tage	3 Jahre
Schroder GAIA Wellington Pagosa	MonteCarlo-Simulation	99%	20 Tage	3 Jahre

\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.



# Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft) (Forts.)

## OGAW-Vergütungsangaben für die Schroder Investment Management Europe S.A. («SIM Europe») für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Diese Angaben sind Bestandteil des ungeprüften Teils dieses Jahresberichts und Abschlusses und sollten in Verbindung mit dem Vergütungsbericht der Schroders plc auf den Seiten 76 bis 107 des Jahresberichts und Abschlusses für 2022 (verfügbar auf der Website der Gruppe – <https://www.schroders.com/en/investor-relations/results-and-reports/annual-report-and-accounts-2022/>) gelesen werden, der weitere Informationen zu den Aktivitäten unseres Vergütungsausschusses und zu unseren Vergütungsgrundsätzen und -richtlinien bietet.

Die wesentlichen Risikoübernehmer (Material Risk Takers) des OGAW («OGAW-MRTs») der SIM Europe sind natürliche Personen, deren Rollen bei der Schroders-Gruppe einen erheblichen Einfluss auf das Risiko der SIM Europe oder der von ihr verwalteten OGAW-Fonds haben können. Diese Funktionen werden im Einklang mit den Anforderungen der OGAW-Richtlinie und Leitlinien der European Securities and Markets Authority identifiziert.

Der Vergütungsausschuss der Schroders plc hat eine Vergütungsrichtlinie aufgestellt, um sicherzustellen, dass die Anforderungen der OGAW-Richtlinie für alle OGAW-MRTs eingehalten werden. Der Vergütungsausschuss und der Verwaltungsrat der Schroders plc prüfen die Vergütungsstrategie mindestens jährlich. Der Verwaltungsrat der SIM Europe ist für die Verabschiedung der Vergütungsrichtlinie, die Prüfung ihrer allgemeinen Grundsätze mindestens einmal jährlich, und für die Beaufsichtigung ihrer Umsetzung und für die Sicherstellung der Einhaltung der massgeblichen lokalen Rechtsvorschriften verantwortlich. Die Vergütungspolitik wurde im Jahr 2022 überprüft, um sicherzustellen, dass sie mit den OGAW/AIFMD-Vergütungsanforderungen konform ist, und es wurden keine erheblichen Änderungen vorgenommen.

Die Umsetzung der Vergütungsrichtlinie unterliegt mindestens einmal jährlich einer unabhängigen internen Prüfung der Einhaltung der vom Verwaltungsrat der SIM Europe und vom Vergütungsausschuss eingeführten Vergütungsrichtlinien und -verfahren. Die letzte Prüfung ergab keine grundlegenden Probleme, sondern vielmehr eine Reihe geringfügiger Empfehlungen überwiegend in Bezug auf die Verbesserung der Prozess- und Richtliniendokumentation.

Die gesamten Vergütungsausgaben werden auf der Grundlage eines Gewinnbeteiligungsverhältnisses bestimmt, bei dem die variablen Vergütungskosten am Gewinn vor Bonuszahlungen gemessen werden, und anhand eines Gesamtvergütungsverhältnisses, bei dem der Gesamtvergütungsaufwand am Nettoertrag gemessen wird. Dies stellt sicher, dass die Interessen der Mitarbeitenden am Finanzergebnis von Schroders ausgerichtet sind. Im Rahmen der Bestimmung der Vergütungsausgaben für jedes Jahr werden die zugrunde liegende Stärke und Nachhaltigkeit des Unternehmens sowie Berichte zu Risiko-, Rechts-, Compliance- und Innenrevisionsangelegenheiten von den Leitern dieser Bereiche berücksichtigt.

Die nachstehenden Vergütungsdaten spiegeln die im Jahr 2022 gezahlten leistungsabhängigen Vergütungen wider.

- Der Gesamtbetrag der von der SIM Europe an ihre 326 Mitarbeitenden gezahlten Vergütung belief sich auf 60,53 Mio. EUR, wovon 37,29 Mio. EUR auf Festvergütungen (z. B. Gehälter, Sachleistungen) und 23,24 Mio. EUR auf variable Vergütungen (z. B. Jahresbonuszahlungen oder aufgeschobene Bonuszahlungen) entfielen. Mitarbeitende anderer Unternehmen der Schroders-Gruppe, die im Verwaltungsrat der SIM Europe sitzen, erhalten für ihre Rolle als Verwaltungsratsmitglieder der SIM Europe keine zusätzliche Vergütung.
- Die nachstehenden Angaben beziehen sich auf OGAW-MRTs der SIM Europe. Die meisten dieser OGAW-MRTs waren bei anderen Unternehmen der Schroders-Gruppe beschäftigt. Dazu gehören auch Anlageverwaltungsdienste oder andere Aufgaben, die von der SIM Europe an andere Unternehmen der Schroders-Gruppe oder Dritte übertragen wurden. Viele dieser OGAW-MRTs erbringen Leistungen für andere Unternehmen der Schroders-Gruppe und andere Kunden. Im Interesse der Transparenz spiegeln die nachstehenden Gesamtvergütungszahlen die vollständige Vergütung für jeden OGAW-MRT der SIM Europe wider. Die an die 224 OGAW-MRTs der SIM Europe in Bezug auf das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 gezahlte und der SIM Europe oder den von ihr verwalteten OGAW-Fonds zugerechnete Gesamtvergütung beträgt 185,04 Mio. EUR, wovon 43,86 Mio. EUR an Mitglieder der oberen Führungsebene, 132,29 Mio. EUR an MRTs, die Risiken für die SIM Europe oder die von ihr verwalteten OGAW-Fonds übernehmen, und 8,89 Mio. EUR an andere OGAW-MRTs, einschliesslich MRTs mit Kontrollfunktionen, gezahlt wurden. Diese Gesamtvergütungswerte umfassen Beträge, die ggf. von Beauftragten gezahlt wurden.

Zusätzliche qualitative Informationen zu den Vergütungsrichtlinien und -praktiken finden Sie auf [www.schroders.com/rem-disclosures](http://www.schroders.com/rem-disclosures).

# Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)

Die Teilfonds gehen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte ein (Securities Financing Transactions, SFT) (gemäss Definition in Artikel 3 der EU-Verordnung 2015/2365; hiernach umfassen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte unter anderem Pensionsgeschäfte, das Ver- oder Entleihen von Wertpapieren oder Rohstoffen, Buy-Sell-Back-Geschäfte oder Sell-Buy-Back-Geschäfte sowie Lombardgeschäfte). Gemäss Artikel 13 der Verordnung ist die Beteiligung der Teilfonds in Verbindung mit ihrem Engagement in Total-Return-Swaps für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 nachfolgend detailliert aufgeführt:

## Schroder GAIA Egerton Equity

### Globale Daten

#### Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
7 498 620	1,82%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
8 365 595	2,04%
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt EUR	% des verwalteten Vermögens
15 864 215	3,86%

### Konzentrationsdaten

#### Die zehn grössten Emittenten von Sicherheiten (gilt für alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps)

Zum 30. September 2023 wurden keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten.

#### Die zehn grössten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen EUR
Goldman Sachs	5 367 989
Morgan Stanley	5 218 125
J.P. Morgan	3 592 181
Merrill Lynch	1 685 920
	<b>15 864 215</b>

Der Teilfonds handelt für seine Total Return Swaps mit allen vorgenannten Kontrahenten.

### Aggregierte Transaktionsdaten

#### Art und Qualität der Sicherheiten

Die kumulierten Transaktionsdaten für auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten stellen sich wie folgt dar:

Art	Marktwert EUR
Barmittel	3 520 941
	<b>3 520 941</b>

#### Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert EUR
Weniger als 1 Tag	3 520 941
1 bis 7 Tage	–
1 bis 4 Wochen	–
1 bis 3 Monate	–
3 bis 12 Monate	–
Mehr als 1 Jahr	–
Unbegrenzte Laufzeit	–
	<b>3 520 941</b>

# Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

## Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

### Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert EUR
EUR	3 520 941
	<b>3 520 941</b>

### Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen EUR	Short-Positionen EUR	Summe EUR
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	161 620	161 620
1 bis 3 Monate	-	627 098	627 098
3 bis 12 Monate	5 109 799	2 503 538	7 613 337
Mehr als 1 Jahr	2 388 821	5 073 339	7 462 160
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	<b>7 498 620</b>	<b>8 365 595</b>	<b>15 864 215</b>

### Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Goldman Sachs	USA
Morgan Stanley	USA
J.P. Morgan	Vereinigtes Königreich
Merrill Lynch	USA

### Abrechnung und Clearing

Die Abrechnung und das Clearing des Teilfonds mit seinem Kontrahenten für Total Return Swaps erfolgt bilateral.

### Wiederverwendung von Sicherheiten

Auf Total Return Swaps gegebenenfalls erhaltene Sicherheiten werden vom Teilfonds nicht wiederverwendet oder erneut angelegt.

## Verwahrung von Sicherheiten

### Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert EUR
Morgan Stanley	3 520 941
	<b>3 520 941</b>

### Gestellte Sicherheiten

Der Anteil der in getrennten Konten, gepoolten Konten oder sonstigen Konten in Bezug auf Total Return Swaps gehaltenen Sicherheiten gestaltet sich wie folgt:

Kontoart	Marktwert EUR
Getrennt	25 102 046
Gepoolt	-
Sonstige	-
	<b>25 102 046</b>

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu Sicherheitszwecken miteinander verrechnet.

Daher beziehen sich die vorstehenden Angaben zu den Sicherheiten auf alle Geschäfte mit OTC-Derivaten und nicht nur auf Total Return Swaps.

# Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

## Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

### Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter «Nettogewinne aus Swaps», «Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps» und «Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps» ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teilfonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut – in Teilfondswährung
An den Teilfonds	48 865 498

### Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

## Schroder GAIA Helix

### Globale Daten

#### Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
56 626	0,02%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
9 485 612	3,20%
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
9 542 238	3,22%

### Konzentrationsdaten

#### Die zehn grössten Emittenten von Sicherheiten (gilt für alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps)

Zum 30. September 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

#### Die zehn grössten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
J.P. Morgan	4 538 119
Goldman Sachs	3 716 881
Morgan Stanley	934 106
Barclays Bank	353 132
	<b>9 542 238</b>

Der Teilfonds handelt für seine Total Return Swaps mit allen vorgenannten Kontrahenten.

### Aggregierte Transaktionsdaten

#### Art und Qualität der Sicherheiten

Die kumulierten Transaktionsdaten für auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten stellen sich wie folgt dar:

Art	Marktwert USD
Barmittel	9 360 000
	<b>9 360 000</b>

# Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

## Schroder GAIA Helix (Forts.)

### Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	9 360 000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	<b>9 360 000</b>

### Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	9 360 000
	<b>9 360 000</b>

### Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	56 626	9 485 612	9 542 238
Mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	<b>56 626</b>	<b>9 485 612</b>	<b>9 542 238</b>

### Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
J.P. Morgan	Vereinigtes Königreich
Goldman Sachs	USA
Morgan Stanley	USA
Barclays Bank	Vereinigtes Königreich

### Abrechnung und Clearing

Die Abrechnung und das Clearing des Teilfonds mit seinem Kontrahenten für Total Return Swaps erfolgt bilateral.

### Wiederverwendung von Sicherheiten

Auf Total Return Swaps gegebenenfalls erhaltene Sicherheiten werden vom Teilfonds nicht wiederverwendet oder erneut angelegt.

### Verwahrung von Sicherheiten

#### Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
J.P. Morgan	8 980 000
Goldman Sachs	380 000
	<b>9 360 000</b>

# Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

## Schroder GAIA Helix (Forts.)

### Gestellte Sicherheiten

Zum 30. September 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu Sicherheitszwecken miteinander verrechnet.

Daher beziehen sich die vorstehenden Angaben zu den Sicherheiten auf alle Geschäfte mit OTC-Derivaten und nicht nur auf Total Return Swaps.

### Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter «Nettogewinne aus Swaps», «Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps» und «Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps» ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teilfonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut - in Teilfondswährung
An den Teilfonds	108 990 284

### Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

## Schroder GAIA Sirios US Equity

### Globale Daten

#### Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
1 537 709	0,90%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
4 411 914	2,57%
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
5 949 623	3,47%

### Konzentrationsdaten

#### Die zehn grössten Emittenten von Sicherheiten (gilt für alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps)

Zum 30. September 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

#### Die zehn grössten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Merrill Lynch	2 847 093
Goldman Sachs	2 688 544
Morgan Stanley	345 693
Barclays Bank	68 293
	<b>5 949 623</b>

Der Teilfonds handelt für seine Total Return Swaps mit allen vorgenannten Kontrahenten.

### Aggregierte Transaktionsdaten

#### Art und Qualität der Sicherheiten

Die kumulierten Transaktionsdaten für auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten stellen sich wie folgt dar:

Art	Marktwert USD
Barmittel	560 000
	<b>560 000</b>



# Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

## Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

### Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	560 000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	<b>560 000</b>

### Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	560 000
	<b>560 000</b>

### Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	96 505	96 505
1 bis 3 Monate	737 258	1 050 438	1 787 696
3 bis 12 Monate	800 451	2 944 258	3 744 709
Mehr als 1 Jahr	-	320 713	320 713
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	<b>1 537 709</b>	<b>4 411 914</b>	<b>5 949 623</b>

### Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Merrill Lynch	USA
Goldman Sachs	USA
Morgan Stanley	USA
Barclays Bank	Vereinigtes Königreich

### Abrechnung und Clearing

Die Abrechnung und das Clearing des Teilfonds mit seinem Kontrahenten für Total Return Swaps erfolgt bilateral.

### Wiederverwendung von Sicherheiten

Auf Total Return Swaps gegebenenfalls erhaltene Sicherheiten werden vom Teilfonds nicht wiederverwendet oder erneut angelegt.

### Verwahrung von Sicherheiten

#### Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	560 000
	<b>560 000</b>

# Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

## Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

### Gestellte Sicherheiten

Zum 30. September 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu Sicherheitszwecken miteinander verrechnet.

Daher beziehen sich die vorstehenden Angaben zu den Sicherheiten auf alle Geschäfte mit OTC-Derivaten und nicht nur auf Total Return Swaps.

### Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter «Nettogewinne aus Swaps», «Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps» und «Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps» ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teilfonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut – in Teilfondswährung
An den Teilfonds	9 803 568

### Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

## Schroder GAIA Two Sigma Diversified

### Globale Daten

#### Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
4 846 767	1,28%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
–	–
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
4 846 767	1,28%

### Konzentrationsdaten

#### Die zehn grössten Emittenten von Sicherheiten (gilt für alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps)

Zum 30. September 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

#### Die zehn grössten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	4 846 767
	4 846 767

Der Teilfonds handelt für seine Total Return Swaps nur mit Morgan Stanley.

### Aggregierte Transaktionsdaten

#### Art und Qualität der Sicherheiten

Die kumulierten Transaktionsdaten für auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten stellen sich wie folgt dar:

Art	Marktwert USD
Barmittel	1 700 000
	1 700 000

# Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

## Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

### Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	1 700 000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	<b>1 700 000</b>

### Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	1 700 000
	<b>1 700 000</b>

### Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	4 846 767	-	4 846 767
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	-	-	-
Mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	<b>4 846 767</b>	<b>-</b>	<b>4 846 767</b>

### Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Morgan Stanley	USA

### Abrechnung und Clearing

Die Abrechnung und das Clearing des Teilfonds mit seinem Kontrahenten für Total Return Swaps erfolgt bilateral.

### Wiederverwendung von Sicherheiten

Auf Total Return Swaps gegebenenfalls erhaltene Sicherheiten werden vom Teilfonds nicht wiederverwendet oder erneut angelegt.

### Verwahrung von Sicherheiten

#### Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	1 700 000
	<b>1 700 000</b>

#### Gestellte Sicherheiten

Zum 30. September 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu Sicherheitszwecken miteinander verrechnet.

Daher beziehen sich die vorstehenden Angaben zu den Sicherheiten auf alle Geschäfte mit OTC-Derivaten und nicht nur auf Total Return Swaps.

# Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

## Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

### Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter «Nettogewinne aus Swaps», «Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps» und «Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps» ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teilfonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut – in Teilfondswährung
An den Teilfonds	77 710 587

### Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

## Schroder GAIA Wellington Pagosa

### Globale Daten

#### Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
4 718 349	0,97%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
7 086 001	1,47%
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
11 804 350	2,44%

### Konzentrationsdaten

#### Die zehn grössten Emittenten von Sicherheiten (gilt für alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps)

Zum 30. September 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

#### Die zehn grössten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	5 743 491
Goldman Sachs	3 072 330
J.P. Morgan	2 988 529
	11 804 350

Der Teilfonds handelt für seine Total Return Swaps mit allen vorgenannten Kontrahenten.

### Aggregierte Transaktionsdaten

#### Art und Qualität der Sicherheiten

Die kumulierten Transaktionsdaten für auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten stellen sich wie folgt dar:

Art	Marktwert USD
Barmittel	961 363
	961 363

# Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

### Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	961 363
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	<b>961 363</b>

### Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	961 363
	<b>961 363</b>

### Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	5 461	-	5 461
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	141 859	322 034	463 893
Mehr als 1 Jahr	4 571 029	6 763 967	11 334 996
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	<b>4 718 349</b>	<b>7 086 001</b>	<b>11 804 350</b>

### Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Morgan Stanley	USA
Goldman Sachs	USA
J.P. Morgan	Vereinigtes Königreich

### Abrechnung und Clearing

Die Abrechnung und das Clearing des Teilfonds mit seinem Kontrahenten für Total Return Swaps erfolgt bilateral.

### Wiederverwendung von Sicherheiten

Auf Total Return Swaps gegebenenfalls erhaltene Sicherheiten werden vom Teilfonds nicht wiederverwendet oder erneut angelegt.

### Verwahrung von Sicherheiten

#### Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
J.P. Morgan	487 000
Goldman Sachs	474 363
	<b>961 363</b>

# Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

## Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

### Gestellte Sicherheiten

Der Anteil der in getrennten Konten, gepoolten Konten oder sonstigen Konten in Bezug auf Total Return Swaps gehaltenen Sicherheiten gestaltet sich wie folgt:

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	521 000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	<b>521 000</b>

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu Sicherheitszwecken miteinander verrechnet.

Daher beziehen sich die vorstehenden Angaben zu den Sicherheiten auf alle Geschäfte mit OTC-Derivaten und nicht nur auf Total Return Swaps.

### Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter «Nettogewinne aus Swaps», «Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps» und «Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps» ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teilfonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut – in Teilfondswährung
An den Teilfonds	13 085 021

### Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.



# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft)

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

**Produkt:** Schroder GAIA Cat Bond

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 549300MYKDUYVX3W6F39

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

**Eine nachhaltige Investition** ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält**. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

### Hatte dieses Finanzprodukt ein nachhaltiges Investitionsziel?

Ja

Nein

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: \_\_%

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von \_\_% an nachhaltigen Investitionen

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: \_\_%

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)



## Inwieweit wurden die von diesem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden erfüllt. Der Fonds investierte:

- mindestens 80% seines Vermögens in Anlagen im Zusammenhang mit Naturkatastrophen und/oder Lebensrisiken mit dem Ziel, die negativen Folgen solcher Ereignisse zu verringern, zum Wiederaufbau von Volkswirtschaften und Gesellschaften nach einem solchen Ereignis beizutragen und damit deren künftige Widerstandsfähigkeit zu erhöhen;
- mindestens 50% seines Vermögens in Anlagen im Zusammenhang mit meteorologischen Risiken, um die negativen Folgen solcher Ereignisse zu verringern, zum Wiederaufbau von Volkswirtschaften und Gesellschaften nach einem solchen Ereignis beizutragen und damit deren künftige Widerstandsfähigkeit zu erhöhen sowie möglicherweise die negativen Folgen des Klimawandels zu mildern;
- mindestens 5% seines Vermögens in Anlagen, die dazu bestimmt sind, die Nichtverfügbarkeit eines bezahlbaren Versicherungsschutzes gegen Naturkatastrophen zu beheben.

Der Fonds wies ausserdem basierend auf dem Ratingsystem des Anlageverwalters einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert auf. Dies bedeutet, dass der gewichtete Durchschnittswert des Fonds auf Basis der zum Monatsende verfügbaren Daten über einen gleitenden Sechsmontatszeitraum bis zum Ende des Referenzzeitraums höher als Null war.

Der Nachhaltigkeitswert wird mit einem von Schroders entwickelten Tool gemessen, das eine Schätzung der Nettoauswirkungen liefert, die ein Transaktionssponsor in Form von sozialen und ökologischen «Kosten» oder «Nutzen» verursachen kann. Dazu werden bestimmte Indikatoren in Bezug auf diesen Sponsor verwendet und diese positiv und negativ quantifiziert, um eine fiktive Gesamtkennzahl der Auswirkung zu ermitteln, die der jeweilige zugrunde liegende Sponsor möglicherweise auf die Gesellschaft und die Umwelt hat. Dabei werden sowohl Daten Dritter als auch eigene Schätzungen und Annahmen von Schroders verwendet, und das Ergebnis kann von anderen Nachhaltigkeits-Tools und -Massstäben abweichen. Beispiele für solche Indikatoren sind Treibhausgasemissionen, Wasserverbrauch und Löhne im Vergleich zum existenzsichernden Lohn.

Das Ergebnis wird als Gesamtwert der Nachhaltigkeitsindikatoren für jeden Sponsor ausgedrückt, und zwar als fiktiver Prozentsatz (positiv oder negativ) des Umsatzes des jeweiligen zugrunde liegenden Sponsors. Ein Wert von +2% würde beispielsweise bedeuten, dass ein Sponsor pro 100 USD Umsatz eine relative fiktive positive Auswirkung (d. h. einen Nutzen für die Gesellschaft) von 2 USD hat. Der Nachhaltigkeitswert des Fonds ergibt sich aus den Werten aller Sponsoren im Portfolio des Fonds, die mit dem proprietären Tool von Schroders gemessen werden.

Der Referenzzeitraum für diesen Fonds ist der Zeitraum zwischen 1. Oktober 2022 und 30. September 2023.

### • *Wie haben sich die Nachhaltigkeitsindikatoren entwickelt?*

Der Anlageverwalter überwachte die Einhaltung des Merkmals, um mindestens wie folgt zu investieren: 80% seines Vermögens in mit Naturkatastrophen und/oder Lebensrisiken verbundene Anlagen; 50% seines Vermögens in mit meteorologischen Risiken verbundene Anlagen; und 5% seines Vermögens in Anlagen, die dazu bestimmt sind, die Nichtverfügbarkeit eines bezahlbaren Versicherungsschutzes gegen Naturkatastrophen zu beheben, durch den Einsatz eines Betriebssystems eines Drittanbieters für Anlageexperten, das von einem internen Portfolio-Compliance-Team überwacht wird.

Der positive absolute Nachhaltigkeitswert des Fonds für den Referenzzeitraum betrug 0,9%.

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Der Nachhaltigkeitswert wird wie vorstehend beschrieben als fiktiver Prozentsatz berechnet.

Während des Referenzzeitraums handelte es sich bei den Top-5-Indikatoren im proprietären Tool von Schroders, die positiv zum Nachhaltigkeitswert des Fonds beitragen, um folgende:

- **Finanzielle Inklusion:** geschätzter gesellschaftlicher Nutzen aus der Erbringung von Finanzdienstleistungen für die lokale Bevölkerung. Zuweisung im Verhältnis zum Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz;
- **Hohe Gehälter:** geschätzter gesellschaftlicher Nutzen durch Bezahlung des Personals über dem örtlichen existenzsichernden Lohn (in den Regionen, in denen die Unternehmen tätig sind). Zuweisung im Verhältnis zum Differenzbetrag zwischen den von den Unternehmen gezahlten Löhnen und den durchschnittlichen existenzsichernden Löhnen vor Ort;
- **Infrastruktur:** geschätzter gesellschaftlicher Nutzen von Infrastrukturinvestitionen. Berechnung nach den Infrastrukturausgaben eines Landes anhand von Daten über Bruttoinvestitionen;-  
**Medizin:** geschätzter gesellschaftlicher und gesamtwirtschaftlicher Nutzen durch das Angebot von medizinischen Produkten und Dienstleistungen. Berechnung nach dem Stellenwert des betreffenden Unternehmens innerhalb der Wertschöpfungskette des Gesundheitswesens und seinem weltweiten Marktanteil innerhalb des Teilsektors; und
- **Medizin:** geschätzter gesellschaftlicher und gesamtwirtschaftlicher Nutzen durch das Angebot von medizinischen Produkten und Dienstleistungen. Berechnung nach dem Stellenwert des betreffenden Unternehmens innerhalb der Wertschöpfungskette des Gesundheitswesens und seinem weltweiten Marktanteil innerhalb des Teilsektors; und
- **Soziale und politische Stabilität:** geschätzter gesellschaftlicher Nutzen von politischer und sozialer Stabilität eines Landes, indem ein günstiges Umfeld für Unternehmen, ein attraktives Investitionsklima und damit die Voraussetzungen für langfristiges Wirtschaftswachstum geschaffen werden.

Der Anlageverwalter überwachte die Einhaltung des Merkmals, einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert aufrechtzuerhalten, anhand des gewichteten Durchschnitts des Nachhaltigkeitswerts des Fonds in dem proprietären Tool von Schroders über einen gleitenden Sechsmonatszeitraum zum Ende des Referenzzeitraums, basierend auf den Daten zum Monatsende. Der Gesamtnachhaltigkeitswert fasst die Auswirkung von Nachhaltigkeitsindikatoren zusammen, insbesondere Treibhausgasemissionen, Wassernutzung und Vergütungen verglichen mit dem Existenzminimum.

Der Fonds wandte auch bestimmte Ausschlüsse an, deren Einhaltung der Anlageverwalter über seinen Portfolio-Compliance-Rahmen laufend überwachte.

## • ... und im Vergleich zu früheren Zeiträumen?

### Nachhaltigkeitswert

Diese Tabelle zeigt die Entwicklung des Nachhaltigkeitswerts des Fonds gegenüber dem Vorjahr

Zeitraum	Fonds (%)
Okt. 2022 - Sep. 2023	0,9
Okt. 2021 - Sep. 2022	0,8

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

- **Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?**

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet, ist die Frage für diesen Fonds nicht relevant.

## Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen

handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

- **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

## **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

## **Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz «Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen» festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz «Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen» findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Wie in den vorvertraglichen Informationen zum Fonds angegeben, ist der Anlageverwalter derzeit nicht in der Lage, die wichtigsten negativen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren zu berücksichtigen, da diese Kennzahlen nur für Anlagen in Unternehmen, Staatsanleihen und Immobilien gelten.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Aufgrund der Art der Vermögenswerte des Fonds, bei denen es sich um versicherungsgebundene Wertpapiere und derivative Finanzinstrumente handelt, die Katastrophenrisiken ausgesetzt sind, kann der Anlageverwalter nur nachteilige Auswirkungen berücksichtigen, die für diese Anlageklasse massgeblich sind. Der Anlageverwalter hat bestimmte Transaktionssponsoren und bestimmte Risikoklassen, die nach Ansicht des Anlageverwalters das Potenzial haben, erhebliche nachteilige Auswirkungen auf die Gesellschaft zu haben, von der Aufnahme in seine Portfolios ausgeschlossen.

Der Fonds hat ausserdem ILS-Transaktionen ausgeschlossen, die von den folgenden Unternehmen auf eigenständiger Basis gesponsert werden:

- Umwelt: Unternehmen, die in der Förderung und Produktion fossiler Brennstoffe (einschliesslich unter anderem Ölbohrungen und Kohlebergwerke) oder in der Stromerzeugung aus Öl und Gas tätig sind.
- Soziales: Unternehmen aus folgenden Sektoren: Alkohol, Tabak, Glücksspiel, Erwachsenenunterhaltung, konventionelle Waffen, zivile Schusswaffen und Kernwaffen.

Darüber hinaus hat der Fonds bestimmte Risikoklassen von der Aufnahme in sein Portfolio ausgeschlossen: Lotterie, Hypothekenversicherung, Lebensversicherungen und Terror auf eigenständiger Basis.



## Welches waren die wichtigsten Investitionen dieses Finanzprodukts?

Die 15 wichtigsten Investitionen im Bezugszeitraum waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der grösste Anteil der im Referenzzeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: **1. Okt. 2022 bis 30. Sep. 2023**

Grösste Investitionen	Sektor	In% der Vermögenswerte	Land
VOUSSOIRRE_JULY_2022_SIDEAR	Finanzwesen	1,74	Bermuda
URSA RE II LIMITED FRN 144A 9.3859% 07 Dec 2023	Finanzwesen	1,71	Bermuda
NAKAMA RE LTD 1 FRN 144A 7.4829% 13 Oct 2026	Finanzwesen	1,58	Singapur
ALAMO RE LTD A FRN 144A 12.6154% 07 Jun 2024	Finanzwesen	1,48	Bermuda
FLOODSMART RE LTD 19.0129% 01 Mar 2024	Finanzwesen	1,28	Bermuda
MYSTIC RE IV LTD 15.1854% 10 Jan 2028	Finanzwesen	1,19	Bermuda
SUSSEX CAP UK PCC LTD 13.8154% 08 Jan 2025	Finanzwesen	1,18	Vereinigtes Königreich
EVERGLADES RE II LTD 11.3329% 15 May 2028	Finanzwesen	1,11	Bermuda
CAPE LOOKOUT RE LTD 9.1354% 22 Mar 2024	Finanzwesen	0,99	Bermuda
KILIMANJARO III RE LTD A FRN 144A 5.25% 25 Jun 2025	Finanzwesen	0,96	Bermuda
EVERGLADES RE II LTD 11.0929% 15 May 2028	Finanzwesen	0,95	Bermuda
MERNA REINSURANCE II LTD 10.9459% 08 Jul 2024	Finanzwesen	0,94	Bermuda
GALILEO RE LTD 15.3159% 08 Jan 2024	Finanzwesen	0,92	Bermuda
MONA LISA RE LTD 12.4354% 08 Jul 2025	Finanzwesen	0,91	Bermuda
FLOODSMART RE LTD 11.25% 25 Feb 2025	Finanzwesen	0,91	Bermuda

Aufgrund der Struktur dieser Vermögenswerte stellt das in der obigen Tabelle angegebene «Land» den Sitz des Anlagevehikels dar. Die Länderrisikopositionen der zugrunde liegenden Anlagen werden in der Regel vom Sitzland abweichen.

Der dargestellte «Sektor» stellt die Tatsache dar, dass es sich um Zweckgesellschaften handelt, die zum Zwecke der Risikominderung errichtet wurden.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Die obige Liste stellt den Durchschnitt der Fondsbeteiligungen an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums dar.

Die Daten zu den grössten Investitionen und Prozentanteilen der oben genannten Vermögenswerte stammen aus dem Schroders Investment Book of Record (IBOR). Die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht genannten grössten Investitionen und prozentualen Anteile an Vermögenswerten sind dem Accounting Book of Record (ABoR) des Administrators entnommen. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen mit unterschiedlichen Berechnungsmethoden können Angaben zu den grössten Investitionen und Prozentsätzen der Vermögenswerte geringfügig voneinander abweichen.



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

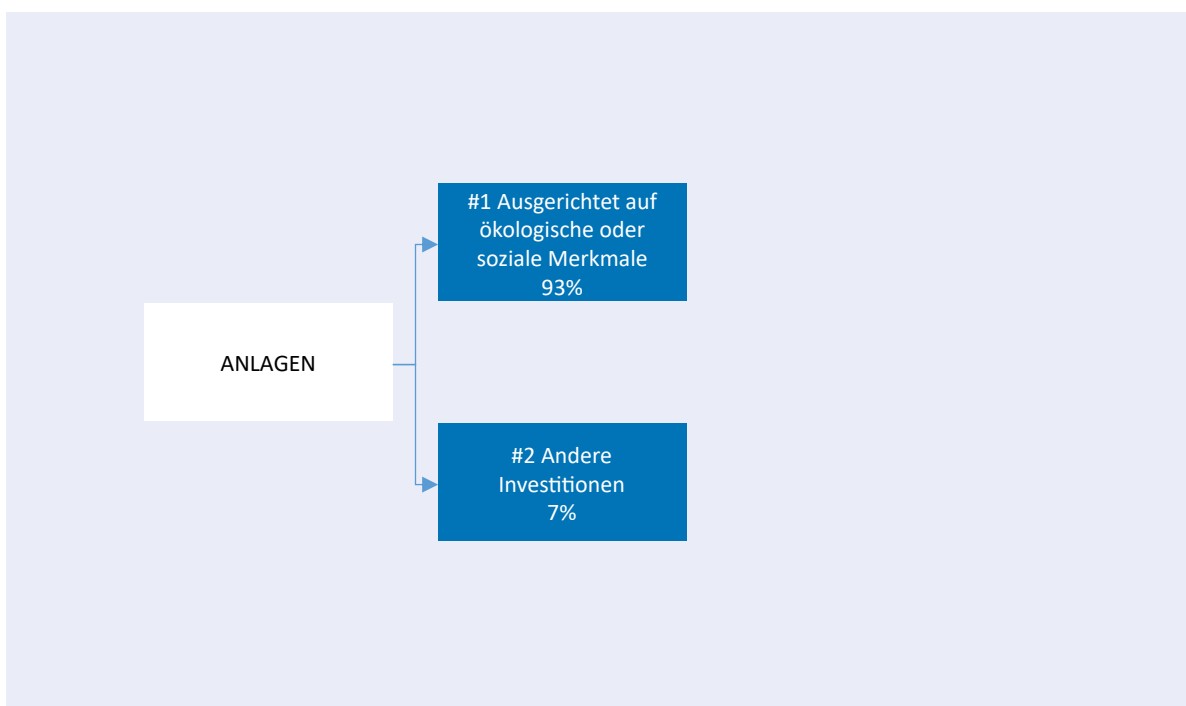
**Die Vermögensallokation** definiert den Anteil der Anlagen in bestimmten Vermögenswerten.

### • *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

Die Anlagen des Fonds, die genutzt werden, um seine ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen, sind nachstehend zusammengefasst.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst den Anteil des Fondsvermögens, der zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale eingesetzt wird. Dieser Anteil beträgt 93%. Dieser Prozentsatz entspricht dem Anteil der Vermögenswerte in Anlagen, die mit Naturkatastrophen und/oder Lebensrisiken verbunden sind, Anlagen, die mit meteorologischen Risiken verbunden sind, und Anlagen, die dazu bestimmt sind, die Nichtverfügbarkeit eines bezahlbaren Versicherungsschutzes gegen Naturkatastrophen zu beheben. Er basiert auf dem Durchschnitt der Bestände an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums.

#2 Andere Investitionen umfasst Barmittel, die nicht in Bezug auf Nachhaltigkeit bewertet werden. Zu #2 Andere Investitionen gehörten auch Investitionen, die nicht mit dem eigenen Nachhaltigkeitstool von Schroders bewertet wurden und somit nicht zum Nachhaltigkeitsscore des Fonds beitrugen.



# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

**#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale** umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

**#2 Andere Investitionen** umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden

## • In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Im Referenzzeitraum wurden Investitionen in folgenden Wirtschaftssektoren getätigt:

Sektor	Teilsektor	In% der Vermögenswerte
Finanzwesen	Versicherung	91,31
Barmittel	Barmittel	6,79
Supranational	Supranational	1,97
Derivate	Devisenderivate	-0,05

Die obige Liste stellt den Durchschnitt der Fondsbeteiligungen an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums dar.

Die obigen Angaben zu den auf die Sektoren entfallenden Prozentanteilen des Vermögens sind dem Schroders Investment Book of Record (IBOR) entnommen. Die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht genannten Prozentanteile des Vermögens an den Sektoren sind dem Accounting Book of Record (ABoR) des Administrators entnommen. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen mit unterschiedlichen Berechnungsmethoden können Angaben zu Prozentanteilen des Vermögens an einzelnen Sektoren geringfügig voneinander abweichen.



## In welchem Masse waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Es gab keine definierte Mindest-Taxonomieausrichtung der Anlagen des Fonds (einschliesslich Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten) mit Umweltziel. Die Taxonomie-Konformität der Investitionen dieses Fonds wurde daher nicht berechnet und infolgedessen mit 0% des Fondsportfolios eingestuft.



# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

• Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

Ja:

In fossiles Gas  In Kernenergie

Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels («Klimaschutz») beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

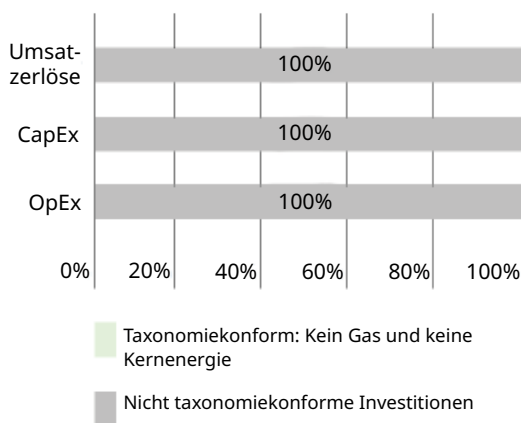
- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

- **Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

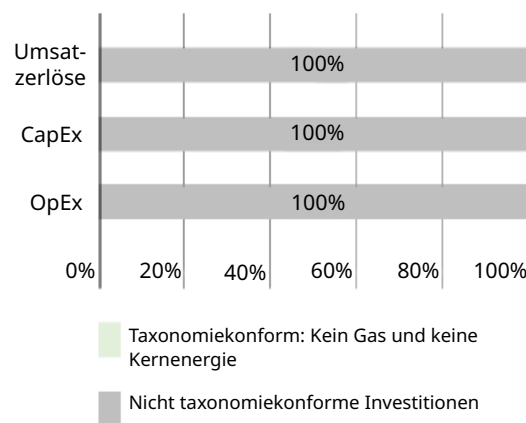
- **Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen\*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen\*



Diese Grafik gibt x% der Gesamtinvestitionen wieder<sup>2</sup>

\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff «Staatsanleihen» alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

<sup>2</sup>Da keine Taxonomiekonformität besteht, hat der Ausschluss von Staatsanleihen keine Auswirkungen auf die Grafik (d. h. der Prozentsatz der Investitionen, die der Taxonomie entsprechen, bleibt bei 0%) und die Verwaltungsgesellschaft ist daher der Ansicht, dass es nicht notwendig ist, diese Information anzugeben.

## Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten.

**Übergangstätigkeiten** sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## • *Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?*

Wie oben beschrieben, wird der Anteil der Anlagen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten mit 0% des Fondsportfolios angenommen.

## • *Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?*

Diese Frage ist nicht relevant.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## Wie hoch war der Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, der nicht mit der EU-Taxonomie konform war?

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet, ist die Frage für diesen Fonds nicht relevant.



## Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet, ist die Frage für diesen Fonds nicht relevant.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)



## Welche Investitionen fielen unter «Andere Investitionen», welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

#2 Andere Investitionen umfasst Barmittel, die nicht in Bezug auf Nachhaltigkeit bewertet werden. Zu #2 Andere Investitionen gehörten auch Investitionen, die nicht mit dem eigenen Nachhaltigkeitstool von Schroders bewertet wurden und somit nicht zum Nachhaltigkeitsscore des Fonds beitrugen.

Mindestschutzregelungen wurden gegebenenfalls auf Geldmarktinstrumente und Derivate angewandt, die zur Risikominderung (Absicherung) verwendet wurden, oder auf andere Anlagen, indem (gegebenenfalls) Anlagen in Gegenparteien eingeschränkt wurden, die mit Ländern mit höherem Risiko (im Hinblick auf Geldwäsche, Terrorismusfinanzierung, Bestechung, Korruption, Steuerhinterziehung und Sanktionsrisiken) verbunden oder dort engagiert waren. Bei einer unternehmensweiten Risikobewertung wird die Risikoeinstufung der einzelnen Länder berücksichtigt; dabei wird auf eine Reihe von öffentlichen Erklärungen, Indizes und globale Governance-Indikatoren Bezug genommen, die von den Vereinten Nationen, der Europäischen Union, der britischen Regierung, der Financial Action Task Force und mehreren Nichtregierungsorganisationen (NRO) wie Transparency International und dem Basler Ausschuss herausgegeben wurden.

Darüber hinaus wurden neue Gegenparteien durch das Kreditrisikoteam von Schroders überprüft, und die Zulassung einer neuen Gegenpartei basierte auf einer ganzheitlichen Prüfung der verschiedenen verfügbaren Informationsquellen, insbesondere zur Qualität des Managements, zur Eigentümerstruktur, zum Standort, zum aufsichtsrechtlichen und gesellschaftlichen Umfeld einer jeden Gegenpartei und zum Entwicklungsgrad des örtlichen Bankensystems und dessen aufsichtsrechtlicher Rahmenbedingungen. Die laufende Überwachung erfolgte über ein proprietäres Tool von Schroders, das die Analyse des Managements ökologischer, sozialer und unternehmensführungsbezogener Trends und Herausforderungen durch die Gegenpartei unterstützt.

Das Kreditrisikoteam von Schroders überwachte die Gegenparteien, und soweit während des Referenzzeitraums Gegenparteien gemäss unseren Richtlinien und Compliance-Anforderungen aus der genehmigten Liste für alle Fonds entfernt wurden, waren diese Kontrahenten ab dem Zeitpunkt ihrer Entfernung in Bezug auf relevante Anlagen nicht mehr für den Fonds zugelassen.



## Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wurden folgende Massnahmen ergriffen, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen:

- Der Anlageverwalter wandte bei der Auswahl der Anlagen für den Fonds Nachhaltigkeitskriterien an;
- der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Auswahl der vom Fonds gehaltenen Vermögenswerte die Nachhaltigkeitswerte des Fonds und der einzelnen Anlagen; und
- der Anlageverwalter beurteilte die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Anlagen des Fonds.



## Wie hat sich dieses Finanzprodukt im Vergleich zu seiner Benchmark entwickelt?

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

**Benchmarks** sind Indizes, an denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Es wurde kein Index als Benchmark festgelegt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

• **Wie unterschied sich die Benchmark von einem breiten Marktindex?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

• **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts in Bezug auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

• **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

• **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Regelmässige Informationen zu den in Artikel 8 Absätze 1, 2 und 2a der Verordnung (EU) 2019/2088 und Artikel 6 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2020/852 genannten Finanzprodukten

**Produkt:** Schroder GAIA Helix

**Unternehmenskennung (LEI-Code):** 549300HTRQHGX6XKWC51

## Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

### Hatte dieses Finanzprodukt ein nachhaltiges Investitionsziel?

Ja

Nein

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: \_\_%

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 61% an nachhaltigen Investitionen

in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

In Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: \_\_%

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

Die **EU-Taxonomie** ist ein Klassifikationssystem, das in der Verordnung (EU) 2020/852 festgelegt ist und ein Verzeichnis von **ökologisch nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten enthält**. Diese Verordnung umfasst kein Verzeichnis der sozial nachhaltigen Wirtschaftstätigkeiten. Nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel könnten taxonomiekonform sein oder nicht.

Der ausgewiesene Prozentsatz nachhaltiger Investitionen (bei denen es sich ausschliesslich um Long-Positionen handelt, da Short-Positionen nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden) entspricht dem Anteil der nachhaltigen Anlagen am Long-Engagement des Fonds am Ende des Referenzzeitraums. Dies steht im Einklang mit den vorvertraglichen Informationen zu dem Fonds, in denen die Verpflichtung des Fonds festgelegt ist, mindestens 35% seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Für zusätzlichen Kontext: Im Verhältnis zum Bruttoengagement des Fonds betrug der Anteil nachhaltiger Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums 28%. Das Bruttoengagement umfasst sowohl Kauf- als auch Verkaufspositionen, und dieser Wert wird aus Gründen der Kohärenz mit den anderen Berechnungen im nachstehenden Abschnitt über die Vermögensallokation angegeben.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)



## Inwieweit wurden die von diesem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden erfüllt. Der Fonds wies basierend auf dem Ratingsystem des Anlageverwalters einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert auf. Dies bedeutet, dass der gewichtete Durchschnittswert des Fonds auf Basis der zum Monatsende verfügbaren Daten über einen gleitenden Sechsmonatszeitraum bis zum Ende des Referenzzeitraums höher als Null war.

Der Nachhaltigkeitswert wird von einem von Schroders entwickelten Tool gemessen, das eine Schätzung der Netto-«Auswirkungen» liefert, die ein Emittent in Bezug auf soziale und ökologische «Kosten» oder «Vorteile» verursachen könnte. Dazu werden bestimmte Indikatoren in Bezug auf den jeweiligen Emittenten verwendet und diese positiv und negativ quantifiziert, um eine fiktive Gesamtkennzahl der Auswirkung zu ermitteln, die der jeweilige zugrunde liegende Emittent möglicherweise auf die Gesellschaft und die Umwelt haben kann. Dabei werden sowohl Daten Dritter als auch eigene Schätzungen und Annahmen von Schroders verwendet, und das Ergebnis kann von anderen Nachhaltigkeits-Tools und -Massstäben abweichen. Beispiele für solche Indikatoren sind Treibhausgasemissionen, Wasserverbrauch und Löhne im Vergleich zum existenzsichernden Lohn.

Das Ergebnis wird als Gesamtwert der Nachhaltigkeitsindikatoren für jeden Emittenten ausgedrückt, konkret als fiktiver Prozentsatz (positiv oder negativ) des Umsatzes oder des BIP des jeweiligen Emittenten. Ein Wert von +2% würde beispielsweise bedeuten, dass ein Emittent pro 100 US-Dollar Umsatz oder BIP einen relativen fiktiven positiven Einfluss (d. h. einen Nutzen für die Gesellschaft) von 2 US-Dollar erbringt. Der Nachhaltigkeitswert des Fonds wird von den Werten aller Emittenten (ggf. einschliesslich auf Look-through-Basis bei Indizes und Wertpapierkörben) im Portfolio des Fonds abgeleitet, die mithilfe des proprietären Tools von Schroders ermittelt werden. Die Long- und Short-Positionen des Fonds tragen unterschiedlich zum Gesamtwert bei. Long-Positionen mit positivem Wert und Short-Positionen mit negativem Wert tragen beide positiv zum Gesamtwert bei, während Long-Positionen mit negativem Wert und Short-Positionen mit positivem Wert beide dem Gesamtwert abträglich sind.

Der Referenzzeitraum für diesen Fonds ist der Zeitraum zwischen 1. Oktober 2022 und 30. September 2023.

Der Fonds verwendete Derivate in grossem Umfang, um seine Investitionsstrategie umzusetzen und die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erfüllen. Long- und Short-Derivatepositionen trugen in unterschiedlicher Weise zum Gesamtnachhaltigkeitswert des Fonds bei. Aktien- und Indexderivate (ohne Optionen) werden in derselben Weise wie physische Positionen auf Look-through-Basis bewertet und trugen ebenfalls zum Gesamtnachhaltigkeitswert des Fonds bei.

Der Fonds investierte während des Referenzzeitraums ausserdem mindestens 35% seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen.

### • **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Der positive absolute Nachhaltigkeitswert für den Referenzzeitraum betrug 9,8%.

Der Nachhaltigkeitswert wird wie vorstehend beschrieben als fiktiver Prozentsatz berechnet.

Während des Referenzzeitraums handelte es sich bei den Top-5-Indikatoren im proprietären Tool von Schroders, die positiv zum Nachhaltigkeitswert des Fonds beitrugen, um folgende:

Mit Nachhaltigkeitsindikatoren wird gemessen, inwieweit die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht werden.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

- Vermiedene Emissionen: geschätzter ökologischer Nutzen durch Unternehmen, die zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft beitragen;
- CO<sub>2</sub>-Emissionen Scope 1: die geschätzten Umweltkosten von Scope-1-Treibhausgasemissionen (THG) in Bezug auf den Klimawandel. Scope-1-Emissionen stellen die direkten Emissionen innerhalb des Verantwortungsbereichs eines Unternehmens dar;
- Bereitstellung von Empfängnisverhütungsmitteln: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen der Herstellung und des Angebots von Empfängnisverhütungsmitteln. Berechnung nach Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz; und
- Höhere Gehälter: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen von Unternehmen, die ihr Personal über dem örtlichen existenzsichernden Lohn bezahlen (in den Regionen, in denen die Unternehmen tätig sind). Zuweisung im Verhältnis zum Differenzbetrag zwischen den von den Unternehmen gezahlten Löhnen und den durchschnittlichen existenzsichernden Löhnen vor Ort;
- Tabak: geschätzte gesellschaftliche Kosten des Rauchens (wird Tabakherstellern zugeordnet). Berechnung nach Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz.

Tabak und Scope 1-CO<sub>2</sub>-Emissionen sind gesellschaftliche bzw. ökologische Kosten (und wurden daher negativ bewertet), trugen jedoch positiv zum Nachhaltigkeitswert des Fonds bei, da sie Short-Positionen darstellen, und Short-Positionen mit negativen Bewertungen tragen positiv zum Gesamtnachhaltigkeitswert des Fonds bei.

Der Anlageverwalter überwachte die Einhaltung des Merkmals, einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert aufrechtzuerhalten, anhand des gewichteten Durchschnitts des Nachhaltigkeitswerts des Fonds in dem proprietären Tool von Schroders über einen gleitenden Sechsmonatszeitraum zum Ende des Referenzzeitraums, basierend auf den Daten zum Monatsende. Der Gesamtnachhaltigkeitswert fasst die Auswirkung von Nachhaltigkeitsindikatoren zusammen, insbesondere Treibhausgasemissionen, Wassernutzung und Vergütungen verglichen mit dem Existenzminimum.

Der Fonds verpflichtete sich, mindestens 35% seiner Long-Positionen nachhaltig zu investieren, wobei der Nachhaltigkeitswert jedes Vermögenswerts durch das proprietäre Tool von Schroders definiert wird. Gemäss dieser Vorgabe entfielen während des Bezugszeitraums auf der Grundlage von Daten zum jeweiligen Quartalsende 55% des Long-Engagements auf nachhaltige Investitionen (bei denen es sich ausschliesslich um Long-Positionen handelt, da Short-Positionen nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden).

Der Anlageverwalter überwachte die Einhaltung der Vorgabe, mindestens 35% seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen zu investieren, indem er den Nachhaltigkeitswert jedes Vermögenswerts im proprietären Tool von Schroders berücksichtigte.

Für zusätzlichen Kontext: Der Anlageverwalter investierte während des Referenzzeitraums auf der Grundlage von Daten zum jeweiligen Quartalsende 28% des Bruttoengagements des Fonds in nachhaltige Investitionen. Dieser Wert entspricht dem prozentualen Anteil nachhaltiger Investitionen am Bruttoengagement des Fonds. Das Bruttoengagement umfasst sowohl Kauf- als auch Verkaufspositionen, und dieser Wert wird aus Gründen der Kohärenz mit den Berechnungen im nachstehenden Abschnitt über die Vermögensallokation angegeben.

Der Fonds wandte auch bestimmte Ausschlüsse an, deren Einhaltung der Anlageverwalter über seinen Portfolio-Compliance-Rahmen laufend überwachte.

## • ... und im Vergleich zu früheren Zeiträumen?



# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

## Nachhaltige Investitionen

Diese Tabelle zeigt den prozentualen Anteil des Vermögens, der in nachhaltige Anlagen investiert wurde, im Jahresvergleich.

Zeitraum	Fonds% (Brutto)	Fonds% (Long)
Okt. 2022 - Sep. 2023	28	55
Okt. 2021 - Sep. 2022	26	52

## Nachhaltigkeitswert

Diese Tabelle zeigt die Entwicklung des Nachhaltigkeitswerts des Fonds gegenüber dem Vorjahr

Zeitraum	Fonds (%)
Okt. 2022 - Sep. 2023	9,8
Okt. 2021 - Sep. 2022	8,8

Für 2022 wurde der Prozentsatz der nachhaltigen Investitionen zum Ende des Referenzzeitraums berechnet. Für 2023 wurde der Prozentsatz als Durchschnitt auf der Grundlage von Quartalsenddaten berechnet.

### • Welche Ziele verfolgten die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie trägt die nachhaltige Investition zu diesen Zielen bei?

In Bezug auf den nachhaltig investierten Anteil des Long-Portfolios des Fonds wies jede nachhaltige Investition eine positive Nettoauswirkung auf ein oder mehrere ökologische oder soziale Ziele auf, wie anhand des proprietären Tools von Schroders bewertet. Die Ziele der vom Fonds getätigten nachhaltigen Investitionen bestanden in positiven Nachhaltigkeitsauswirkungen unter anderem durch:

- Vermiedene Emissionen: geschätzter ökologischer Nutzen durch Unternehmen, die eine systemische oder gesamtwirtschaftliche Verringerung der CO<sub>2</sub>-Emissionen ermöglichen.
- Konnektivität: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen von Unternehmen, die durch Telekommunikationsdienste die Vernetzung von Gemeinden ermöglichen und/oder unterstützen; Berechnung im Verhältnis zum geschätzten globalen Nutzen des Zugangs zu globalen Kommunikationstechnologien und Zuweisung dieses Nutzens zu einzelnen Unternehmen auf der Grundlage ihres Anteils an den weltweiten Einnahmen aus Telekommunikations- und Internetkonnektivitätsmärkten, einschliesslich Social-Media-Unternehmen;
- Bereitstellung von Empfängnisverhütungsmitteln: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen der Herstellung und des Angebots von Empfängnisverhütungsmitteln. Zuweisung im Verhältnis zum Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz;
- Höhere Gehälter: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen von Unternehmen, die ihr Personal über dem örtlichen existenzsichernden Lohn bezahlen (in den Regionen, in denen die Unternehmen tätig sind). Zuweisung im Verhältnis zum Differenzbetrag zwischen den von den Unternehmen gezahlten Löhnen und den durchschnittlichen existenzsichernden Löhnen vor Ort; und
- Medizin: geschätzter gesellschaftlicher und gesamtwirtschaftlicher Nutzen durch das Angebot von medizinischen Produkten und Dienstleistungen. Zuweisung im Verhältnis zum Stellenwert des betreffenden Unternehmens innerhalb der Wertschöpfungskette des Gesundheitswesens und seinem Gesamtmarktanteil innerhalb des Teilssektors.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Die vorstehenden Beispiele für die Ziele der vom Fonds während des Referenzzeitraums getätigten nachhaltigen Investitionen beruhen auf den häufigsten Zielen zum jeweiligen Quartalsende. Möglicherweise waren für den Referenzzeitraum weitere Ziele definiert.

**Bei den wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

## **• Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, ökologisch oder sozial nachhaltigen Anlagezielen nicht erheblich geschadet?**

Der Ansatz des Anlageverwalters, kein ökologisch oder sozial nachhaltiges Investitionsziel erheblich zu beeinträchtigen, umfasste Folgendes:

- Unternehmensweite Ausschlüsse galten für Schroders-Fonds. Diese betreffen internationale Übereinkommen über Streumunition, Antipersonenminen sowie chemische und biologische Waffen. Eine detaillierte Liste aller ausgeschlossenen Unternehmen finden Sie unter <https://www.schroders.com/en/sustainability/active-ownership/group-exclusions/>

- Schroders hat am 6. Januar 2020 die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC) unterzeichnet. Der Fonds schloss Unternehmen, die gegen die UNGC-Prinzipien verstossen, aus dem Teil des Portfolios aus, der in nachhaltige Anlagen investiert ist, da Schroders der Auffassung ist, dass solche Unternehmen einem oder mehreren ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlagezielen erheblich schaden. Die Bereiche, die dafür verantwortlich sind, ob ein Emittent Verstößen gegen den UNGC bezichtigt wird, umfassen Aspekte, die von den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte abgedeckt werden, beispielsweise Menschenrechte, Bestechung und Korruption, Arbeitsrechte, Kinderarbeit, Diskriminierung, Gesundheit und Sicherheit sowie Tarifverhandlungen. Die Liste der Unternehmen, die gegen den UNGC verstossen, wird durch einen Drittanbieter bereitgestellt, und die Compliance mit der Liste wurden mittels unserer automatisierten Compliance-Kontrollen überwacht.

- Gegebenenfalls wurden auf Ebene der zugrunde liegenden Strategie, nicht jedoch auf Fondsebene, Unternehmen vom Long-Engagement ausgeschlossen, deren Einnahmen aus Aktivitäten im Zusammenhang mit Kraftwerkskohle, dem Abbau von Kraftwerkskohle und der Kohleverstromung bestimmte Schwellenwerte überschreiten.

Weitere Informationen zu allen Ausschlüssen des Fonds finden Sie unter «Angaben zur Nachhaltigkeit» auf der Webseite des Fonds unter <https://www.schroders.com/en-lu/lu/professional/fund-centre>.

## **Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Wo der Anlageverwalter Schwellenwerte bei nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren festlegte, wurde die Einhaltung dieser Grenzwerte kontinuierlich anhand des Portfolio-Compliance-Rahmens überwacht. Beteiligungsunternehmen, die diese Werte nicht einhielten, wurden nicht als nachhaltige Investition eingestuft.

Der Fonds schloss beispielsweise Unternehmen, die gegen die UNGC-Grundsätze verstossen (Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen/PAI 10), bei den nachhaltigen Investitionen des Portfolios aus. Die Liste der Unternehmen, die gegen den UNGC verstossen, wird durch einen Drittanbieter bereitgestellt, und die Compliance mit der Liste wurden mittels unserer automatisierten Compliance-Kontrollen überwacht.

Darüber hinaus wurden gegebenenfalls auf Ebene der zugrunde liegenden Strategie, nicht jedoch auf Fondsebene, Unternehmen vom Long-Engagement ausgeschlossen, von denen angenommen wurde, dass sie wesentlich zum Klimawandel beitragen (im Zusammenhang mit den PAIs 1, 2 und 3, die Treibhausgasemissionen abdecken). Nicht zugelassen waren Emittenten mit mehr als 10% Einnahmen aus dem Steinkohlebergbau und mehr als 30% Einnahmen aus der Kohlestromerzeugung. Der Fonds hat möglicherweise strengere Schwellenwerte angewandt, die auf der Website des Fonds angegeben sind. Die Einhaltung der Ausschlüsse wurde über unsere automatisierten Compliance-Kontrollen überwacht.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

In anderen Bereichen legte Schroders (auch indirekt über die Manager der zugrunde liegenden Strategien) Grundsätze für das Engagement in Unternehmen fest. Wir haben jeden PAI mit einem der sechs Kernthemen von Schroders verknüpft. Nachfolgend finden Sie eine Zusammenfassung der geltenden Schwellenwerte und der jeweiligen darauf bezogenen Engagement-Aktivitäten:

## Klimawandel:

Die PAIs 1, 2, 3, 4, 5, 6 und Pai 4 in Tabelle 2 beziehen sich auf den Engagement Blueprint zum Klimawandel. Einzelheiten zu unserem Engagement Blueprint finden Sie hier: (Link <https://mybrand.schroders.com/m/3222ea4ed44a1f2c/original/schroders-engagement-blueprint.pdf>). Unser Engagement soll aufzeigen, wie Unternehmen auf Herausforderungen reagieren, die sich aus den Auswirkungen des Klimawandels auf ihre langfristige Finanzsituation ergeben. Durch unsere Engagement-Aktivitäten gewinnen wir Erkenntnisse etwa zu Umsetzungstempo und Umfang von Emissionsreduktionszielen oder Schritten auf dem Weg zu Klimazielen.

## Biodiversität und Naturkapital:

Die PAIs 7, 8 und 9 beziehen sich auf das Engagement Blueprint-Thema Biodiversität und Naturkapital. Uns ist bewusst, wie wichtig es ist, dass alle Unternehmen ihre Risiken in Bezug auf Naturkapital und biologische Vielfalt bewerten und darüber berichten. Wir konzentrieren unser Engagement auf die Verbesserung der Offenlegung in Bezug auf Themen wie beispielsweise Entwaldung, nachhaltige Lebensmittelproduktion und Wasser.

## Menschenrechte:

Die PAIs 10 und 14 beziehen sich auf das Engagement Blueprint-Thema Menschenrechte. Die Rolle, die Unternehmen bei der Achtung der Menschenrechte spielen können und sollten, gewinnt immer mehr an Bedeutung. Wir sind uns bewusst, dass Menschenrechtskontroversen erhöhte operationelle, finanzielle und Reputationsrisiken verursachen. Unser Engagement konzentriert sich auf drei wichtigen Stakeholdergruppen Mitarbeitende, Gesellschaft und Kunden.

## Humankapitalmanagement:

Die PAIs 11, 12 und 13 beziehen sich auf das Engagement Blueprint-Thema Humankapitalmanagement. Humankapitalmanagement ist ein vorrangiges Thema unseres Engagements. Die Mitarbeitenden von Unternehmen stellen einen wichtigen Wettbewerbsfaktor dar und ein effektives Humankapitalmanagement ist unerlässlich für Innovation und langfristige Wertschöpfung. Wir sehen darüber hinaus klare Zusammenhänge zwischen hohen Standards im Humankapitalmanagement und der Erreichung der SDGs. Unsere Engagement-Aktivitäten befassen sich mit Themen wie Gesundheitsschutz und Sicherheit, Unternehmenskultur und Investitionen in Personal.

## Diversität und Inklusion:

Die PAIs 12 und 13 beziehen sich auf das Engagement Blueprint-Thema Diversität und Inklusion. Verbesserte Offenlegung zu Diversität in den Leitungsorganen und geschlechtsspezifischem Lohngefälle sind zwei der vorrangigen Ziele, die in unserem Engagement Blueprint definiert sind. Wir erwarten von Unternehmen die Implementierung einer Richtlinie, nach der bei jeder Stellenbesetzung in Führungsgremien mehrere diverse Bewerber berücksichtigt werden müssen. Unser Engagement-Ansatz umfasst auch Vorgaben zur Diversität der Geschäftsführung, der Belegschaft und der Wertschöpfungskette.

## Unternehmensführung (Corporate Governance):

Die PAIs 12, 13 und PAI 4 in Tabelle 3 beziehen sich auf das Engagement Blueprint-Thema Unternehmensführung. Wir stellen in Zusammenarbeit mit den Unternehmen sicher, dass diese im besten Interesse der Aktionäre und anderer wichtiger Stakeholder handeln. Wir sind weiterhin der Ansicht, dass in den meisten Fällen zunächst starke Governance-Strukturen geschaffen werden müssen, um Fortschritte und Leistungen in anderen wesentlichen Belangen im Bereich Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) zu erzielen. Wir befassen uns daher mit verschiedenen

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Corporate Governance-Aspekten wie der Vergütung von Führungskräften, Vorständen und Management sowie der Strategie.

## ***Stehen die nachhaltigen Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte in Einklang? Nähere Angaben:***

Der Anteil nachhaltiger Investitionen steht im Einklang mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

Wir nutzten eine von einem Drittanbieter bereitgestellte Liste von Unternehmen, die gegen den UNGC verstossen. Emittenten auf dieser Liste wurden nicht als nachhaltige Investition eingestuft. Die Bereiche, die berücksichtigt wurden, um festzustellen, ob ein Emittent gegen den UNGC verstösst, umfassten jene, die von den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte abgedeckt werden, beispielsweise Menschenrechte, Bestechung und Korruption, Arbeitsrechte, Kinderarbeit, Diskriminierung, Gesundheit und Sicherheit sowie Tarifverhandlungen.

*In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz «Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen» festgelegt, nach dem taxonomiekonforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische Unionskriterien beigefügt.*

Der Grundsatz «Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen» findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

*Alle anderen nachhaltigen Investitionen dürfen ökologische oder soziale Ziele ebenfalls nicht erheblich beeinträchtigen.*



## **Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?**

Der Fonds verteilte sein Vermögen auf mehrere zugrunde liegende Strategien. Einige PAIs wurden gegebenenfalls auf Fondsebene berücksichtigt, andere PAIs auf der Ebene der zugrunde liegenden Strategien durch den jeweiligen Anlageverwalter. Weitere Einzelheiten dazu, wie diese während des Bezugszeitraums berücksichtigt wurden, sind nachstehend aufgeführt.

Einige PAIs wurden im Rahmen der Vorinvestitionsprüfung durch die Anwendung von Ausschlüssen berücksichtigt. Dazu zählten:

- Umstrittene Waffen: PAI 14 (Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)) – auf Long- und Short-Engagements angewandt
- UNGC-Verletzer: PAI 10 (Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD für multinationale Unternehmen) – auf nachhaltige Investitionen angewandt
- Unternehmen, die Umsätze oberhalb bestimmter Schwellenwerte aus Tätigkeiten im Zusammenhang mit Kraftwerkskohle erzielen: (PAI 4 (Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind), PAI 5 (Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen)) – auf Long-Engagements auf Ebene der jeweiligen zugrunde liegenden Strategien angewandt

Die Einhaltung dieser Schwellenwerte wurde über den Portfolio-Compliance-Rahmen des Anlageverwalters überwacht.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Andere PAIs wurden im Rahmen der aktiven Eigentümerschaft berücksichtigt, die indirekt über die zugrunde liegenden Anlageverwalter erfolgte. Gegebenenfalls wurden auf der Grundlage der zugrunde liegenden Strategien und des Anlageprozesses des jeweiligen Anlageverwalters PAIs nach der Anlage im Rahmen von Engagement-Aktivitäten gemäss dem Ansatz und den Zielsetzungen des Engagement Blueprint von Schroders berücksichtigt. Zu den Schwerpunktthemen, die in unserem Engagement Blueprint berücksichtigt werden, gehören:

- Klimawandel
- Naturkapital und Biodiversität
- Menschenrechte
- Humankapitalmanagement
- Diversität und Inklusion
- Corporate Governance

Beispiele für PAIs, die mit diesem Ansatz erfasst wurden, sind PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO<sub>2</sub>-Fussabdruck),

PAI 3 ( THG-Intensität der investierten Unternehmen) und PAI 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen).

Nachstehend sind die Engagement-Aktivitäten des Fonds im Referenzzeitraum zusammengefasst, einschliesslich des jeweiligen Themas des Engagements:

<b>Engagement-Thema</b>	<b>Anzahl der Emittenten</b>
Klimawandel	47
Diversität und Inklusion	38
Menschenrechte	17
Humankapitalmanagement	16
Unternehmensführung und Aufsicht	8
Naturkapital und Biodiversität	7

Die ausgewiesenen Engagements können Engagements umfassen, die Short-Positionen, Barmitteln, Derivaten, Organismen für gemeinsame Anlagen, Schuldtiteln und Pensionsgeschäften des Fonds zugeordnet sind.

Unser Ansatz unterliegt einer laufenden Überprüfung, insbesondere in Anbetracht der sich verbessernden Verfügbarkeit und Qualität der Daten.



## Was waren die Hauptinvestitionen bei diesem Finanzprodukt?

Die 15 grössten Investitionen nach Nettoengagement (in% des NIW) während des Bezugszeitraums waren:

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der grösste Anteil der im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: **1. Okt. 2022 bis 30. Sep. 2023**

Grösste Investitionen	Sektor	% des Vermögens Land (Netto)	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	Informationstechnologie	1,87	Südkorea, Republik
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	Informationstechnologie	1,69	Taiwan (Republik China)
HDFC BANK LTD	Finanzen	1,59	Indien
RELX PLC	Industrie	1,54	Vereinigtes Königreich
AIA GROUP LTD	Finanzen	1,33	Hongkong
WHITBREAD PLC	Zyklische Konsumgüter	1,31	Vereinigtes Königreich
NOVA LJUBLJANSKA BANKA DD LJUBLJANA	Finanzen	1,23	Slowenien
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	Finanzen	1,23	China
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	Industrie	1,15	China
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	Zyklische Konsumgüter	1,15	China
WONIK IPS CO LTD	Informationstechnologie	0,96	Südkorea, Republik
MEDIATEK INC	Informationstechnologie	0,93	Taiwan (Republik China)
MIDEA GROUP CO LTD	Zyklische Konsumgüter	0,93	China
NATIONAL BANK OF GREECE SA	Finanzen	0,89	Griechenland
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	Finanzen	0,88	Japan

Die vorstehende Liste stellt den Durchschnitt des Nettoengagements des Fonds in% des NIW an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums dar.

Die Engagements wurden, soweit möglich, auf Look-through-Basis für Indexfutures, Indexoptionen, Total-Return-Swap-Positionen (TRS) und Differenzkontrakt-Baskets (CFD) zur Verfügung gestellt. In bestimmten Fällen wurden möglicherweise Proxy-Daten verwendet.

Die Daten zu den grössten Investitionen und dem prozentualen Anteil am NIW stammen aus dem Schroders Investment Book of Record (IBoR). Die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht genannten grössten Investitionen und prozentualen Anteile am NIW sind dem Accounting Book of Record (ABoR) des Administrators entnommen. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen mit unterschiedlichen Berechnungsmethoden können Angaben zu den grössten Investitionen und Prozentsätzen des NIW voneinander abweichen.



## Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

**Die Vermögensallokation** definiert den Anteil der Anlagen in bestimmten Vermögenswerten.

### • *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

Die Anlagen des Fonds, die genutzt werden, um seine ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen, sind nachstehend zusammengefasst.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst den Anteil des Fondsvermögens, der zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale eingesetzt wird. Dieser Anteil beträgt 98% des Bruttoengagements. Der Fonds erzielte dauerhaft einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert, und somit wurden die Investitionen (Long- und Short-Positionen) des Fonds, die durch das proprietäre Nachhaltigkeitstool von Schroders bewertet wurden, unter #1 einbezogen, wenn sie Einfluss auf den Nachhaltigkeitswert des Fonds hatten (unabhängig davon, ob eine



## Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

jeweilige Einzelinvestition einen positiven oder einen negativen Wert aufwies). Long-Positionen mit positiven Bewertungen und Short-Positionen mit negativen Bewertungen trugen beide positiv zur Gesamtbewertung bei, während Long-Positionen mit negativen Bewertungen und Short-Positionen mit positiven Bewertungen beide die Gesamtbewertung beeinträchtigten. Der unter #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale angegebene Prozentsatz bezieht sich auf den Durchschnitt des Bezugszeitraums auf der Grundlage der Quartalsenddaten. Ebenfalls in #1 enthalten ist der Anteil des Bruttoengagements, der in nachhaltige Anlagen investiert wurde, wie in #1A angegeben.

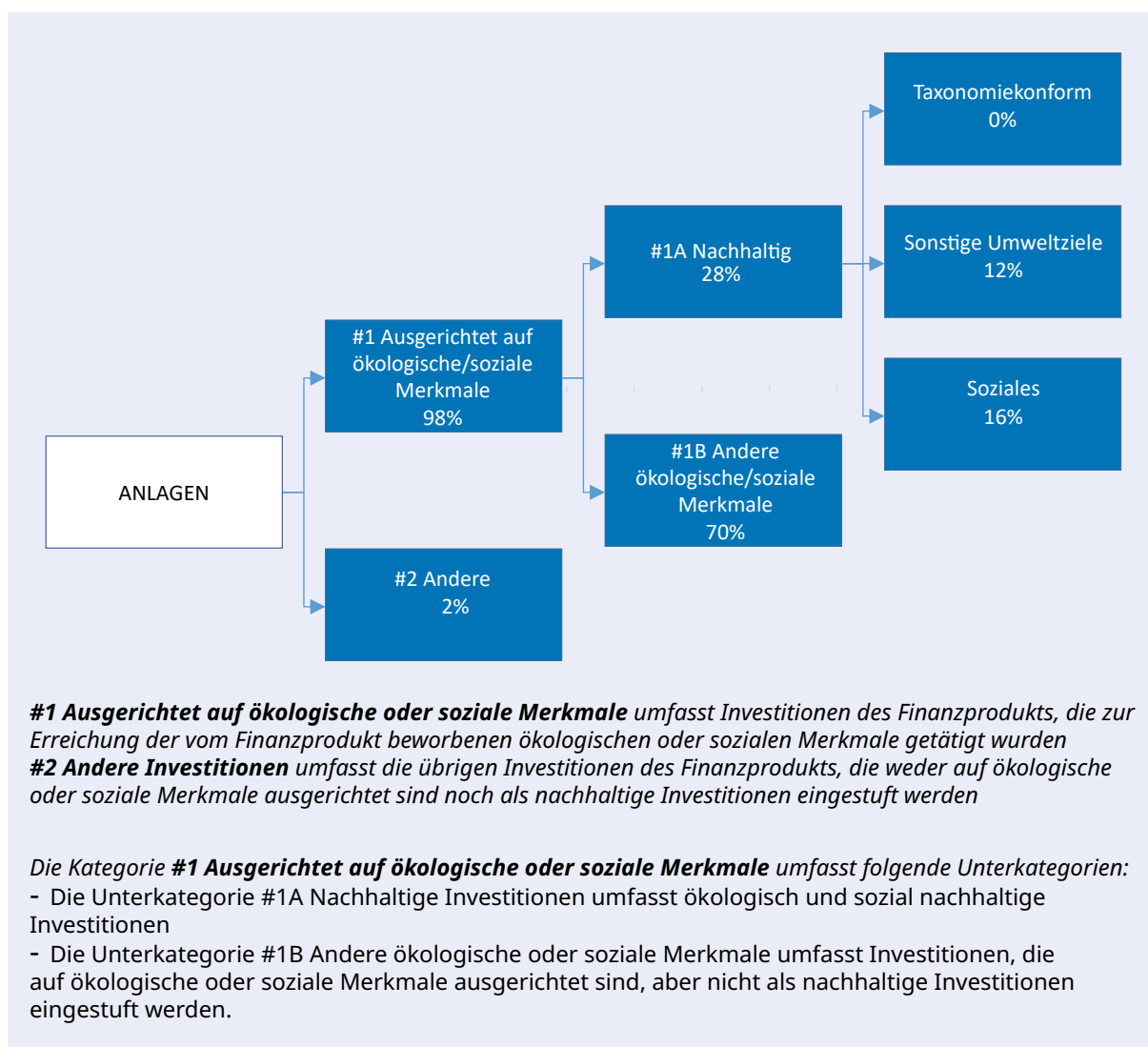
Der Nachhaltigkeitswert wird von einem von Schroders entwickelten Tool gemessen, das eine Schätzung der Netto-«Auswirkungen» liefert, die ein Emittent in Bezug auf soziale und ökologische «Kosten» oder «Vorteile» verursachen könnte. Dazu werden bestimmte Indikatoren in Bezug auf den jeweiligen Emittenten verwendet und diese positiv und negativ quantifiziert, um eine fiktive Gesamtkennzahl der Auswirkung zu ermitteln, die der jeweilige zugrunde liegende Emittent möglicherweise auf die Gesellschaft und die Umwelt haben kann. Beispiele für solche Indikatoren sind Treibhausgasemissionen, Wasserverbrauch und Löhne im Vergleich zum existenzsichernden Lohn.

Der Fonds investierte während des Referenzzeitraums 28% seines Bruttoengagements in nachhaltige Investitionen. Dieser Prozentsatz entspricht dem Durchschnitt der Quartalsenddaten im Referenzzeitraum. Das Bruttoengagement umfasst sowohl Long- als auch Short-Positionen, während die Prozentangabe nur Long-Positionen umfasst, da Short-Positionen nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. 12% davon wurden in nachhaltige Investitionen mit Umweltziel und 16% in nachhaltige Investitionen mit sozialem Ziel investiert. Der Fonds verpflichtete sich jedoch, mindestens 35% seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen zu investieren. Der Fonds investierte während des Referenzzeitraums 55% seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen. 24% davon wurden in nachhaltige Investitionen mit Umweltziel und 31% in nachhaltige Investitionen mit sozialem Ziel investiert. Die Summe des Prozentsatzes nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel und des Prozentsatzes nachhaltiger Investitionen mit einem sozialen Ziel ergibt aufgrund von Rundungen möglicherweise nicht den Gesamtprozentsatz nachhaltiger Investitionen. In Bezug auf den nachhaltig investierten Anteil des Fondsportfolios wies jede nachhaltige Investition eine positive Nettoauswirkung auf ein oder mehrere ökologische oder soziale Ziele auf, wie anhand des proprietären Tools von Schroders bewertet. Mit Ausnahme von grünen oder sozialen Anleihen, die grundsätzlich als Investitionen mit ökologischem bzw. sozialem Ziel eingestuft werden, hängt die Einstufung von nachhaltigen Investitionen als Investitionen mit einem ökologischen oder sozialen Ziel davon ab, ob der betreffende Emittent laut den Daten des proprietären Tools von Schroders bessere Umweltindikatoren oder soziale Indikatoren aufweist als seine Vergleichsgruppe. In beiden Fällen berücksichtigen die Indikatoren die Elemente «Kosten» und «Nutzen».

#2 Andere Investitionen umfasst Barmittel, Barmitteläquivalente und Optionen, die in Bezug auf Nachhaltigkeit als neutral eingestuft werden. Zu #2 Andere Investitionen gehörten auch Investitionen, die nicht mit dem eigenen Nachhaltigkeitstool von Schroders bewertet wurden und somit nicht zum Nachhaltigkeitsscore des Fonds beitrugen.



# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)



Die oben angegebenen Prozentsätze werden aus Gründen der Einheitlichkeit als Anteil des Bruttoengagements berechnet. Der Fonds hat sich jedoch verpflichtet, mindestens 35% seines Long-Engagements nachhaltig zu investieren, und während des Referenzzeitraums entfielen 55% der Long-Positionen des Fonds auf nachhaltige Investitionen.

Es wurden auf Look-Through-Basis Engagements für Index-Futures, Index-Optionen, TRS-Positionen und CFD-Körbe bereitgestellt und auf Emittentenebene verrechnet. In bestimmten Fällen wurden möglicherweise Proxy-Daten verwendet. Diese Verrechnung erfolgte vor der Einstufung als Long- oder Short-Engagement und vor der Berechnung des Bruttoengagements.

## • In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Im Referenzzeitraum wurden in den folgenden Wirtschaftssektoren Investitionen auf Basis des Brutto- und Nettoengagements (in% des NIW) getätigt:

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Sektor	Teilsektor	% des Vermögens (Netto)	% des Vermögens (Brutto)
Kommunikationsdienstleistungen	Medien und Unterhaltung	2,53	13,73
Kommunikationsdienstleistungen	Telekommunikationsdienstleistungen	-0,18	7,41
Zyklische Konsumgüter	Automobile und Autoteile	-1,26	9,60
Zyklische Konsumgüter	Zyklische Konsumgüter - Vertrieb und Einzelhandel	0,02	13,55
Zyklische Konsumgüter	Langlebige Konsumgüter und Bekleidung	3,40	15,33
Zyklische Konsumgüter	Verbraucherdienstleistungen	1,67	13,99
Basiskonsumgüter	Basiskonsumgüter - Vertrieb und Einzelhandel	-1,17	6,99
Basiskonsumgüter	Nahrungsmittel, Getränke und Tabakwaren	-0,83	13,02
Basiskonsumgüter	Haushalts- und Körperpflegeprodukte	0,24	3,36
Energie	Energie	-1,79	10,94
Finanzen	Banken	0,23	35,16
Finanzen	Finanzdienstleistungen	-3,47	17,52
Finanzen	Versicherung	2,12	12,98
Gesundheitswesen	Geräte und Dienstleistungen für das Gesundheitswesen	0,16	8,22
Gesundheitswesen	Pharmazeutika, Biotechnologie & Life Sciences	0,34	12,82
Inhaltsverzeichnis	Inhaltsverzeichnis	-1,79	0,12
Industrie	Investitionsgüter	3,85	43,43
Industrie	Gewerbliche und professionelle Dienstleistungen	1,19	9,77
Industrie	Transport	-3,83	9,60
Informationstechnologie	Halbleiter und Halbleiterausüstung	2,99	13,96
Informationstechnologie	Software und softwarebezogene Dienstleistungen	1,15	13,16
Informationstechnologie	Technologie-Hardware und Ausrüstung	2,44	19,21
Zinssätze / staatsnahe Titel / Staatsanleihen	Zinssätze / staatsnahe Titel / Staatsanleihen	1,33	1,67
Grundstoffe	Grundstoffe	-3,15	27,98
Immobilien	Aktien - Real Estate Investment Trusts (REITs)	-1,79	12,59
Immobilien	Immobilienbewirtschaftung und -entwicklung	-0,24	7,98
Versorger	Versorger	-3,76	7,39

Die obige Liste basiert auf dem durchschnittlichen Brutto- und Nettoengagement des Fonds in% des NIW an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums.

Es wurden auf Look-Through-Basis Engagements für Index-Futures, Index-Optionen, TRS-Positionen und CFD-Körbe bereitgestellt und auf Emittentenebene verrechnet. In bestimmten Fällen wurden möglicherweise Proxy-Daten verwendet.

Die obigen Angaben zu den auf die Sektoren entfallenden Prozentanteilen des NIW sind dem Schroders Investment Book of Record (IBOR) entnommen. Die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht genannten Prozentanteile des NIW an den Sektoren sind dem Accounting Book of Record (ABoR) des Administrators entnommen. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen mit unterschiedlichen Berechnungsmethoden können Angaben zu Prozentanteilen des NIW an einzelnen Sektoren voneinander abweichen.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)



## In welchem Masse waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

Es gab keine definierte Mindest-Taxonomieausrichtung der Anlagen des Fonds (einschliesslich Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten) mit Umweltziel. Die Taxonomie-Konformität der Investitionen dieses Fonds wurde daher nicht berechnet und infolgedessen mit 0% des Fondsportfolios eingestuft.

### • Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert<sup>1</sup>?

- Ja:
- In fossiles Gas  In Kernenergie
- Nein

<sup>1</sup> Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels («Klimaschutz») beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung am linken Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- **Umsatzerlöse**, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

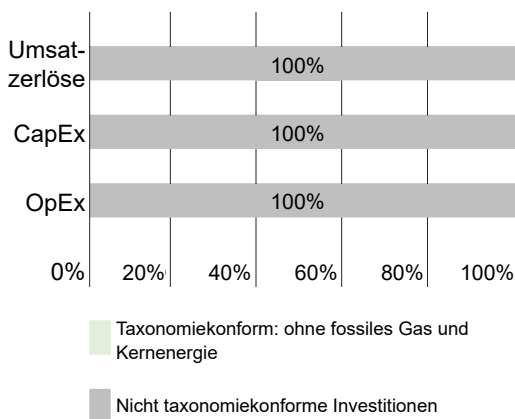
*Die beiden nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in grüner Farbe. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen\* gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschliesslich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

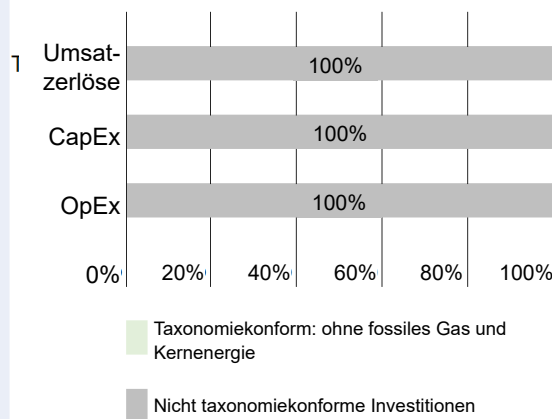
**- Investitionsausgaben (CapEx)**, die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

**- Betriebsausgaben (OpEx)**, die die umweltfreundlichen betrieblichen operativen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschliesslich Staatsanleihen\*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen\*



Dieses Diagramm gibt x% der Gesamtinvestitionen wieder\*

\* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff «Staatsanleihen» alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

<sup>2</sup>Da keine Taxonomiekonformität besteht, hat der Ausschluss von Staatsanleihen keine Auswirkungen auf die Grafik (d. h. der Prozentsatz der Investitionen, die der Taxonomie entsprechen, bleibt bei 0%) und die Verwaltungsgesellschaft ist daher der Ansicht, dass es nicht notwendig ist, diese Information anzugeben.

## Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten

## Übergangstätigkeiten

sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO<sub>2</sub>-armen Alternativen gibt und die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

## • Wie hoch ist der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten?

Wie oben beschrieben, wird der Anteil der Anlagen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten mit 0% des Fondsportfolios angenommen.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

- **Wie hat sich der Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden, im Vergleich zu früheren Bezugszeiträumen entwickelt?**

Diese Frage ist nicht relevant.



sind nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die **die Kriterien** für ökologisch nachhaltige Wirtschaftstätigkeiten gemäss der Verordnung (EU) 2020/852 nicht berücksichtigen.



## **Wie hoch war der Anteil nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel, der nicht mit der EU-Taxonomie konform war?**

Während des Referenzzeitraums und auf der Grundlage von Daten zum jeweiligen Quartalsende investierte der Fonds 12% seines Bruttoengagements in nachhaltige Anlagen mit einem Umweltziel, die nicht mit der Taxonomie konform waren. Dieser Prozentsatz wird aus Gründen der Vereinheitlichung mit der oben im Abschnitt «Vermögensallokation» angegebenen Berechnungsgrundlage aufgeführt. Der Fonds investierte 24% seines Long-Engagements in nachhaltige Anlagen mit einem Umweltziel, die nicht mit der Taxonomie konform waren.



## **Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?**

Während des Bezugszeitraums und auf der Grundlage von Daten zum jeweiligen Quartalsende investierte der Fonds 16% seines Bruttoengagements in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel. Dieser Prozentsatz wird aus Gründen der Vereinheitlichung mit der oben im Abschnitt «Vermögensallokation» angegebenen Berechnungsgrundlage aufgeführt. Der Fonds investierte 31% seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



## **Welche Investitionen fielen unter «Andere Investitionen», welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?**

#2 Andere Investitionen umfasst Barmittel, Barmitteläquivalente und Optionen, die in Bezug auf Nachhaltigkeit als neutral eingestuft werden. Zu #2 Andere Investitionen gehörten auch Investitionen, die nicht mit dem eigenen Nachhaltigkeitstool von Schroders bewertet wurden und somit nicht zum Nachhaltigkeitsscore des Fonds beitrugen.

Mindestschutzregelungen wurden gegebenenfalls auf Geldmarktinstrumente und Optionen angewandt, die zur Risikominderung (Absicherung) verwendet wurden, oder auf andere Anlagen, indem (gegebenenfalls) Anlagen in Gegenparteien eingeschränkt wurden, die mit Ländern mit höherem Risiko (im Hinblick auf Geldwäsche, Terrorismusfinanzierung, Bestechung, Korruption, Steuerhinterziehung und Sanktionsrisiken) verbunden oder dort engagiert waren. Bei einer unternehmensweiten Risikobewertung wird die Risikoeinstufung der einzelnen Länder berücksichtigt; dabei wird auf eine Reihe von öffentlichen Erklärungen, Indizes und globale Governance-Indikatoren Bezug genommen, die von den Vereinten Nationen, der Europäischen Union, der britischen Regierung, der Financial Action Task Force und mehreren Nichtregierungsorganisationen (NRO) wie Transparency International und dem Basler Ausschuss herausgegeben wurden.

Darüber hinaus wurden neue Gegenparteien durch das Kreditrisikoteam von Schroders überprüft, und die Zulassung einer neuen Gegenpartei basierte auf einer ganzheitlichen Prüfung der verschiedenen verfügbaren Informationsquellen, insbesondere zur Qualität des Managements, zur Eigentümerstruktur, zum Standort, zum aufsichtsrechtlichen und gesellschaftlichen Umfeld einer jeden Gegenpartei und zum Entwicklungsgrad des örtlichen Bankensystems und dessen aufsichtsrechtlicher Rahmenbedingungen. Die laufende Überwachung erfolgte über ein proprietäres Tool von Schroders, das die Analyse des Managements ökologischer, sozialer und unternehmensführungsbezogener Trends und Herausforderungen durch die Gegenpartei unterstützt.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

Das Kreditrisikoteam von Schroders überwachte die Gegenparteien, und soweit während des Bezugszeitraums Gegenparteien gemäss unseren Richtlinien und Compliance-Anforderungen aus der genehmigten Liste für alle Fonds entfernt wurden, waren diese Kontrahenten ab dem Zeitpunkt ihrer Entfernung in Bezug auf relevante Anlagen nicht mehr für den Fonds zugelassen.



## Welche Massnahmen wurden während des Bezugszeitraums zur Erfüllung der ökologischen und/oder sozialen Merkmale ergriffen?

Im Bezugszeitraum wurden folgende Massnahmen ergriffen, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen:

- Der Anlageverwalter wandte bei der Auswahl der Anlagen für den Fonds Nachhaltigkeitskriterien an;
- Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Auswahl der Vermögenswerte den Nachhaltigkeitswert des Fonds;
- der Anlageverwalter überwachte die Anwendung von Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung durch die zugrunde liegenden Strategien des Fonds; und
- der Anlageverwalter setzte (auch indirekt über die Manager der zugrunde liegenden Strategien) Engagement-Aktivitäten in Bezug auf mindestens eines der sechs vorrangigen Themen um, die in unserem Engagement Blueprint (Link <https://mybrand.schroders.com/m/3222ea4ed44a1f2c/original/schroders-engagement-blueprint.pdf>) definiert sind. Die Engagement-Aktivitäten des Fonds mit Angaben zur Anzahl der Emittenten, mit denen zusammengearbeitet wurde, und zu den entsprechenden Themen sind oben in der Antwort auf die Frage «Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?» zusammengefasst. Durch unsere Engagement-Aktivitäten bauen wir Beziehungen auf und führen einen wechselseitigen Dialog mit den Unternehmen, in die wir investieren. Wir wollen damit Veränderungen vorantreiben, die den Wert unserer Investitionen schützen und steigern.



## Wie hat sich dieses Finanzprodukt im Vergleich zu seiner Benchmark entwickelt?

**Bei den Benchmarks** handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

Es wurde kein Index als Benchmark festgelegt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

### • *Wie unterschied sich die Benchmark von einem breiten Marktindex?*

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

### • *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts in Bezug auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

# Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

## • *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

## • *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex abgeschnitten?*

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

Diese Angaben wurden unter Verwendung von Informationen von MSCI ESG Research LLC oder seinen verbundenen Unternehmen oder Informationsanbietern erstellt. Obwohl die Informationsanbieter von Schroder Investment Management (Europe) S.A., insbesondere MSCI ESG Research LLC und seine verbundenen Unternehmen (die «ESG-Parteien»), Informationen (die «Informationen») aus Quellen beziehen, die sie als zuverlässig erachten, garantiert keine der ESG-Parteien die Ursprünglichkeit, Genauigkeit und/oder Vollständigkeit der hierin enthaltenen Daten und sie schliessen ausdrücklich alle ausdrücklichen oder stillschweigenden Garantien aus, einschliesslich der Garantien der Marktgängigkeit und der Eignung für einen bestimmten Zweck. Die Informationen dürfen nur für Ihren internen Gebrauch verwendet, in keiner Form vervielfältigt oder weiterverbreitet werden und dürfen nicht als Grundlage oder Bestandteil von Finanzinstrumenten, Produkten oder Indizes verwendet werden. Darüber hinaus dürfen die Informationen selbst nicht dazu verwendet werden, zu bestimmen, welche Wertpapiere zu kaufen oder zu verkaufen sind oder wann sie gekauft oder verkauft werden sollten. Keine der ESG-Parteien haftet für Fehler oder Auslassungen in Verbindung mit den hierin enthaltenen Daten oder haftet für direkte, indirekte, spezielle, Strafschadenersatz, Folgeschäden oder sonstige Schäden (einschliesslich entgangener Gewinn), selbst wenn sie über die Möglichkeit solcher Schäden informiert wurden.

Dieser Bericht enthält bestimmte Informationen (die «Informationen»), die von ©2022MSCI ESG Research LLC und/oder ihren verbundenen Unternehmen oder Informationsanbietern (die «ESG-Parteien») stammen und zur Berechnung von Bewertungen, Ratings oder anderen Indikatoren verwendet worden sein können. Die Informationen dürfen nur für Ihren internen Gebrauch verwendet, in keiner Form vervielfältigt oder weiterverbreitet werden und dürfen nicht als Grundlage oder Bestandteil von Finanzinstrumenten, Produkten oder Indizes verwendet werden. Obwohl sie Informationen aus Quellen beziehen, die sie als zuverlässig erachten, garantiert keine der ESG-Parteien die Ursprünglichkeit, Genauigkeit und/oder Vollständigkeit der hierin enthaltenen Daten und sie schliessen ausdrücklich alle ausdrücklichen oder stillschweigenden Garantien aus, einschliesslich der Garantien der Marktgängigkeit und der Eignung für einen bestimmten Zweck. Keine der Informationen stellt eine Anlageberatung oder Empfehlung bezüglich einer Anlageentscheidung (oder deren Unterlassung) dar und darf nicht als solche verstanden werden, noch sollte sie als Hinweis oder Garantie für eine zukünftige Wertentwicklung, Analyse, Prognose oder Vorhersage verstanden werden. Keine der ESG-Parteien haftet für Fehler oder Auslassungen in Verbindung mit den hierin enthaltenen Daten oder Informationen oder haftet für direkte, indirekte, spezielle, Strafschadenersatz, Folgeschäden oder sonstige Schäden (einschliesslich entgangener Gewinn), selbst wenn sie über die Möglichkeit solcher Schäden informiert wurden.

Dieses Dokument dient der Erfüllung der aufsichtsrechtlichen Offenlegungspflichten von Schroder Investment Management (Europe) S.A. und sollte nur zu Informationszwecken verwendet werden. Das Material soll kein Angebot und keine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Finanzinstrumenten darstellen. Das Material soll keine Rechnungslegungs-, Rechts- oder Steuerberatung oder Anlageempfehlung darstellen und sollte nicht entsprechend verwendet werden. Die hierin gemachten Angaben werden für zuverlässig erachtet, Schroders übernimmt jedoch keine Gewähr für ihre Vollständigkeit oder Richtigkeit. Wir übernehmen keine Haftung für Fehler oder irreführende Meinungsäusserungen seitens MSCI oder Schroders. Individuelle Anlage- und/oder strategische Entscheidungen sollten nicht auf der Grundlage der in diesem Dokument enthaltenen Ansichten und Angaben getroffen werden. Schroders hat in diesem Dokument eigene Ansichten zum Ausdruck gebracht, die sich ändern können. Bitte beachten Sie, dass die Weiterverwendung der in diesem Dokument enthaltenen Daten den geltenden MSCI-Lizenzanforderungen unterliegt. Bitte beachten Sie, dass Sie, wenn Sie diese Daten für Ihre eigenen Zwecke weitergeben möchten, eine entsprechende Lizenz mit MSCI vereinbaren müssen.



# Anhang IV – Wertentwicklung des Fonds (ungeprüft) für das Kalenderjahr 2022\*

	Schroder GAIA BlueTrend	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Helix	Schroder GAIA Oaktree Credit	Schroder GAIA SEG US Equity**	Schroder GAIA Sirios US Equity	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse A Thes.	(12,12%)	-	20,66%	14,43%	3,61%	-	-	13,20%	-	0,30%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	(15,15%)	-	15,68%	-	(0,44%)	-	-	9,03%	-	(3,63%)
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	(13,75%)	16,37%	17,62%	-	1,23%	-	-	10,83%	-	(2,02%)
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	16,08%	-	-	-	-	-	(0,83%)
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	16,72%	-	-	1,57%	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	19,04%	-	2,45%	-	-	-	-	(0,83%)
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	17,42%	-	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	12,96%	-	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	20,05%	13,85%	-	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	16,83%	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	11,55%	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	6,74%	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	8,59%	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	11,49%	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	6,76%	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	8,56%	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	10,33%	-	-	-	-
Klasse C Thes.	(11,59%)	19,63%	21,56%	15,29%	4,69%	-	-	13,75%	5,15%	1,05%
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	0,50%	-	-	-	-	-	-	-	-	15,14%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	(14,63%)	-	16,57%	-	0,59%	7,27%	-	9,53%	2,25%	(2,91%)
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	(13,24%)	-	18,49%	-	2,23%	9,11%	-	11,25%	3,97%	(1,29%)
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	(11,75%)	-	20,29%	17,02%	3,95%	10,86%	-	12,81%	4,91%	0,35%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	18,69%	-	3,17%	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	3,54%	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	18,29%	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	15,28%	-	12,01%	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	13,81%	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	7,33%	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	9,17%	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	(11,77%)	-	-	-	-	10,92%	-	12,93%	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	4,95%	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(2,89%)
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-	(1,26%)
Klasse E Thes.	(11,59%)	-	21,88%	15,24%	5,10%	11,97%	-	14,28%	-	1,55%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	16,87%	-	1,06%	7,44%	-	-	-	(2,41%)
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	(13,23%)	-	18,76%	-	2,73%	9,29%	-	11,59%	-	(0,78%)
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	4,38%	11,02%	-	-	-	0,85%
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	19,01%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	12,18%	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	7,49%	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	9,32%	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	(11,73%)	-	-	-	-	11,09%	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	19,21%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	14,37%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	16,40%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	19,21%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	17,85%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	-	21,10%	-	-	5,99%	12,81%	-	-	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	16,17%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	18,30%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	19,69%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	14,81%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	16,88%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	17,28%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

\* Bitte beachten Sie, dass der Schroder GAIA Asian Equity Long Short in der obigen Tabelle nicht enthalten ist, da der Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in diesem Zeitraum nicht aktiv war.

\*\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. Die vergangene Wertentwicklung ist kein Hinweis auf die gegenwärtige oder künftige Wertentwicklung. In diesen Performedaten wurden keine Provisionen und Kosten berücksichtigt, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen anfallen.

# Anhang IV – Wertentwicklung des Fonds (ungeprüft) für das Kalenderjahr 2022\* (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Helix	Schroder GAIA Oaktree Credit	Schroder GAIA SEG US Equity**	Schroder GAIA Sirios US Equity	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	4,25%	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-	-	-	4,99%	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	1,75%	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	3,46%	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	(13,20%)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	(11,95%)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	(12,74%)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	14,99%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	16,86%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	19,30%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	18,58%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	-	-	-	-	-	(1,03%)	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	(3,59%)	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	-	-	-	-	-	(0,48%)	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	(4,97%)	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	(3,06%)	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-	(2,06%)	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	-	-	-	-	-	(0,73%)	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	(5,26%)	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	(3,44%)	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-	(2,07%)	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-	(2,85%)	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	(3,05%)	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	5,65%	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	2,87%	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	4,52%	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	-	15,40%	-	-	-	13,78%	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	2,92%	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	19,99%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	15,06%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	17,17%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	19,55%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	14,60%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	16,67%	-	-	-	-	-	-	-	-

\* Bitte beachten Sie, dass der Schroder GAIA Asian Equity Long Short in der obigen Tabelle nicht enthalten ist, da der Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in diesem Zeitraum nicht aktiv war.

\*\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. Die vergangene Wertentwicklung ist kein Hinweis auf die gegenwärtige oder künftige Wertentwicklung. In diesen Performancedaten wurden keine Provisionen und Kosten berücksichtigt, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen anfallen.

# Anhang IV – Wertentwicklung des Fonds (ungeprüft) drei Kalenderjahre bis 31. Dezember 2022\*

	Schroder GAIA BlueTrend	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Helix	Schroder GAIA SEG US Equity**	Schroder GAIA Sirios US Equity	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse A Thes.	38,73%	-	4,27%	0,76%	0,92%	-	20,82%	-	12,43%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	32,32%	-	(3,61%)	-	(5,43%)	-	12,93%	-	5,89%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	34,28%	-	(1,03%)	-	(3,66%)	-	14,90%	-	7,73%
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	3,67%	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	1,39%	-	0,50%	-	-	-	11,24%
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	6,20%	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	(3,91%)	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	3,14%	(0,64%)	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	4,74%	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	40,64%	13,97%	6,62%	2,89%	4,86%	-	22,76%	13,34%	14,08%
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	50,55%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	34,45%	-	(1,20%)	-	(1,92%)	-	15,14%	6,95%	7,82%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	36,34%	-	1,07%	-	(0,49%)	-	17,11%	9,33%	9,35%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	40,44%	-	4,55%	5,83%	2,96%	-	20,56%	12,35%	12,95%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	1,94%	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	3,47%	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	8,54%	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	2,67%	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	(1,96%)	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	40,60%	-	-	-	-	-	20,59%	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5,22%	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	7,48%
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	9,75%
Klasse E Thes.	39,82%	-	7,88%	2,90%	6,55%	-	24,09%	-	16,46%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	0,37%	-	(0,60%)	-	-	-	9,56%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	35,79%	-	2,23%	-	1,39%	-	18,08%	-	11,38%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	5,03%	-	-	-	15,00%
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	2,92%	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	39,78%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	12,80%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	5,18%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	7,55%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	12,80%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	11,31%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	-	18,26%	-	-	11,37%	-	-	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	10,26%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	12,88%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	14,16%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	6,42%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	8,90%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-	-	-	-	-

\* Bitte beachten Sie, dass der Schroder GAIA Asian Equity Long Short und der Schroder GAIA Oaktree Credit in der obigen Tabelle nicht berücksichtigt wurden, da die Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in diesem Zeitraum nicht aktiv waren.

\*\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. Die vergangene Wertentwicklung ist kein Hinweis auf die gegenwärtige oder künftige Wertentwicklung. In diesen Performancedaten wurden keine Provisionen und Kosten berücksichtigt, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen anfallen.

# Anhang IV – Wertentwicklung des Fonds (ungeprüft) drei Kalenderjahre bis 31. Dezember 2022\* (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Helix	Schroder GAIA SEG US Equity**	Schroder GAIA Sirios US Equity	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-	-	12,03%	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	5,34%	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	7,72%	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	39,45%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	-	-	-	-	3,89%	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	(1,67%)	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	-	-	-	-	5,47%	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	(2,58%)	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	(0,21%)	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	2,21%	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	-	-	-	-	4,75%	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	(1,17%)	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	2,16%	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	(0,33%)	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	(0,80%)	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	-	3,15%	-	-	22,99%	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	1,87%	-	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-

\* Bitte beachten Sie, dass der Schroder GAIA Asian Equity Long Short und der Schroder GAIA Oaktree Credit in der obigen Tabelle nicht berücksichtigt wurden, da die Teilfonds zum 31. Dezember 2022 in diesem Zeitraum nicht aktiv waren.

\*\* Für nähere Angaben zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. Die vergangene Wertentwicklung ist kein Hinweis auf die gegenwärtige oder künftige Wertentwicklung. In diesen Performedaten wurden keine Provisionen und Kosten berücksichtigt, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen anfallen.



EST. 1804

**Schroder Investment Management (Europe) S.A.**

5, rue Höhenhof,  
L-1736 Senningerberg  
Grossherzogtum Luxemburg  
Tel.: (+352) 341 342 212  
Fax: (+352) 341 342 342

GAIA 30. September 2023 CHDE