



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Geprüfter Jahresbericht

30. September 2022

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.

Jahres- und Halbjahresberichte, der aktuelle ausführliche Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen und die Satzung der Gesellschaft sind kostenlos in Papierform am eingetragenen Sitz der Gesellschaft in 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg, Großherzogtum Luxemburg und bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle sowie bei der weiteren Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland erhältlich.

Sollten zwischen der übersetzten und der englischen Fassung dieses Dokuments Abweichungen bestehen, ist in jedem Fall die englische Fassung maßgeblich.“

Inhalt

Schroder GAIA	5
Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland	6
Verwaltungsrat	7
Verwaltung	8
Bericht des Verwaltungsrats	9
Bericht des Anlageverwalters	11
Prüfbericht	13
Nettovermögensaufstellung	16
Ertrags- und Aufwandsrechnung	30
Veränderung des Nettovermögens	32
Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen	34
Anlageportfolio	38
Schroder GAIA BlueTrend	38
Schroder GAIA Cat Bond	39
Schroder GAIA Contour Tech Equity	44
Schroder GAIA Egerton Equity	44
Schroder GAIA Helix	42
Schroder GAIA Oaktree Credit	49
Schroder GAIA Sirius US Equity	56
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	57
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	58
Schroder GAIA Wellington Pagosa	59
Anmerkungen zum Abschluss	69
Gesamtkostenquote („TER“)	153
Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)	155
Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)	157
Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft)	168

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.

Dieser Bericht betrifft das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022. Der Jahresabschluss wurde im Einklang mit den Luxemburger Verordnungen in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen erstellt. Der letzte Termin, an dem die Anteilkurse berechnet wurden, war der 30. September 2022, der letzte Arbeitstag im Berichtsjahr. Zum Zeitpunkt dieses Berichts stehen zehn Teilfonds innerhalb der Gesellschaft für Anlagen 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 von Schroder Investment Management (Europe) S.A. erhältlich sind (<http://www.schroders.lu>).

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.; GIIN der Sponsoring-Gesellschaft: 4R1MT7.00000.SP.442.

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. (die „Verwaltungsgesellschaft“) bestellt hat, die wiederum den Bestimmungen der Richtlinie 2010/43/EG über Verwaltungsgesellschaften unterliegt, die in luxemburgisches Recht umgesetzt wurde.
4. dem vom Luxemburger Fondsverbands (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 Jahres- und Halbjahresberichten ordnungsgemäß geführt werden und ohne Weiteres zugänglich sind. Die Jahres- und Halbjahresberichte der Gesellschaft müssen vom Verwaltungsrat der Gesellschaft genehmigt und bei der Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“) sowie, im Fall der Jahresberichte, 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.

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 Finanzangaben (ungeprüft) enthalten.

Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland

Einrichtungen für Anleger im Sinne von Art. 92(1) a) Richtlinie 2009/65/EC, in der durch die Richtlinie (EU) 2019/1160 geänderten Fassung sind bei folgender Kontaktstelle verfügbar:

HSBC Continental Europe, Luxembourg
18, Boulevard de Kockelscheuer
L-1821 Luxembourg
Email: simeudealing@schroders.com

Zeichnungs-, Rückkauf- und Rücknahmeaufträge für die Anteile der Teilfonds, die zum Vertrieb in Deutschland berechtigt sind, können bei HSBC Continental Europe, Luxembourg eingereicht werden. Rücknahmeerlöse, etwaige Ausschüttungen und sonstige Zahlungen können auf Wunsch der Anteilinhaber über HSBC Continental Europe, Luxembourg geleitet werden.

Folgende Einrichtungen für Anleger im Sinne von Art. 92 (1) b) bis e) Richtlinie 2009/65/EC, in der durch die Richtlinie (EU) 2019/1160 geänderten Fassung sind auf www.eifs.lu/schroders verfügbar:

- Informationen darüber, wie Zeichnungs-, Rückkauf und Rücknahmeaufträge getätigt werden können und wie Rückkaufs- und Rücknahmeerlöse ausgezahlt werden;
- Informationen und Zugang zu Verfahren und Vorkehrungen in Bezug auf die Wahrnehmung von Anlegerrechten;
- Der neueste Verkaufsprospekt, die Satzung, die Jahres- und Halbjahresberichte, sowie die wesentlichen Anlegerinformationen;
- Informationen in Bezug auf die von den Einrichtungen ausgeübten Aufgaben auf einem dauerhaften Datenträger.

Die Ausgabe- und Rücknahmepreise werden ferner unter www.fundinfo.com veröffentlicht.

Etwaige Mitteilungen an die Anteilinhaber sind bei Schroder Investment Management (Europe) S.A. German Branch, Taunustor 1, D-60310 Frankfurt am Main, kostenlos erhältlich und werden den im Anteilregister registrierten Anlegern in Deutschland per Brief mitgeteilt. In folgenden Fällen wird eine zusätzliche Mitteilung auf <http://www.schroders.com/germany/home/> veröffentlicht: Aussetzung der Rücknahme von Anteilen, Kündigung der Verwaltung oder Abwicklung der Gesellschaft oder eines Teilfonds, Änderungen der Satzung, die mit den bisherigen Anlagegrundsätzen nicht vereinbar sind, wesentliche Anlegerrechte berühren oder die Vergütung und Aufwendungserstattungen betreffen (unter Angabe der Hintergründe sowie der Rechte der Anleger), Verschmelzung von Teilfonds sowie einer möglichen Umwandlung eines Teilfonds in einen Feederfonds.

Informationen zu Verfahren und Regelungen zu Anlegerrechten (Anlegerbeschwerden) werden auf der Internetseite der Gesellschaft <http://www.schroders.com/germany/home/> veröffentlicht.

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsvorsitzender

- **Eric Bertrand**

Head of Schroders GAIA

Vaults 13-16
Valletta Waterfront
1914 FRN
Malta

Weitere Verwaltungsratsmitglieder

- **Carla Bergareche**

Head of Iberian Business

Schroder Investment Management (Europe) S.A.
Sucursal en España
Pinar 7, 4th Floor, 28006 Madrid
Spanien

- **Mike Champion¹**

Head of Product Development

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

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

Independent Director

12, rue de la Sapinière, 8150 Bridel
Großherzogtum Luxemburg

- **Bernard Herman**

Independent Director

Immeuble Dyapason
4, rue Robert Stumper, 2557 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

- **Achim Küssner²**

Country Head Germany, Austria & CEE

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

- **Hugh Mullan**

Independent Director

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

- **Alexander Prawitz³**

Head of Central and Emerging Europe Distribution

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

- **Neil Walton**

Head of Investment Solutions

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

¹ Das Verwaltungsratsmandat von Mike Champion endete während des Geschäftsjahres am 28. Februar 2022.

² Das Verwaltungsratsmandat von Achim Küssner endete während des Geschäftsjahres am 18. Oktober 2021.

³ Alexander Prawitz wurde am 18. Oktober 2021 in den Verwaltungsrat berufen.

Verwaltung

Eingetragener Sitz

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft, Register- und Domizilstelle

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptzahlstelle und Transferstelle

HSBC Continental Europe, Luxembourg¹

16, boulevard d'Avranches, 1160 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Verwahrstelle und Verwaltungsstelle

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

80, route d'Esch, 1470 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptrechtsberater

Arendt & Medernach S.A.

41A, avenue J.F. Kennedy, 2082 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Unabhängiger Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative

2, rue Gerhard Mercator, 2182 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter

BennBridge Ltd.²

Eagle House, 3rd Floor, 108-110 Jermyn Street, London, SW1Y 6EE,
Vereinigtes Königreich
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund

Contour Asset Management, LLC

99 Park Avenue, Suite 1540, New York NY 10016
Vereinigte Staaten
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 den folgenden Untereinlageverwalter für den Schroder GAIA Helix bestellt:

– BennBridge Ltd.
– Schroder Investment Management North America Ltd.
– Schroder Investment Management (Singapore) Ltd.

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

Central 2, CH-8001 Zürich, Schweiz
Schroder GAIA Cat Bond

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.

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.

¹ Am 1. November 2022 hat sich die Anschrift der HSBC Continental Europe, Luxembourg, in 18 Boulevard de Kockelscheuer, L-1821 Luxembourg, Großherzogtum Luxemburg geändert.

² Der Anlageverwalter des Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund und ein Untereinlageverwalter von Schroder GAIA Helix wurden mit Wirkung zum 5. Dezember 2022 von BennBridge Ltd auf Tellworth Investments LLP geändert.

Bericht des Verwaltungsrats

Einleitung

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft legt hiermit seinen Bericht und den geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 vor.

Aktivitäten während des Geschäftsjahres

Zum 30. September 2022 belief sich das Nettovermögen der Gesellschaft insgesamt auf 5.333.186.258 EUR, was im Vergleich zu 5.674.359.712 EUR zum 30. September 2021 einem Rückgang um 6,01 % entspricht.

1. Neue Anteilsklassen

Die folgenden Anteilsklassen wurden im Berichtsjahr aufgelegt:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA BlueTrend			
Klasse N Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	USD	24. Juni 2022
Schroder GAIA Cat Bond			
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	USD	10. Dezember 2021
Klasse PI Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	USD	24. Juni 2022
Klasse PI Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	USD	24. Juni 2022
Klasse PI Aussch.	USD	USD	24. Juni 2022
Klasse PI Aussch. (in GBP abgesichert)	GBP	USD	24. Juni 2022
Klasse Y Thes.	USD	USD	24. Juni 2022
Klasse Y Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	USD	24. Juni 2022
Klasse Y Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	USD	24. Juni 2022
Klasse Y1 Thes.	USD	USD	24. Juni 2022
Klasse Y1 Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	USD	24. Juni 2022
Klasse Y1 Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	USD	24. Juni 2022
Schroder GAIA Helix			
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	USD	11. November 2021
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	USD	11. November 2021
Klasse IZ Thes. (in GBP abgesichert)	GBP	USD	3. März 2022
Klasse S Aussch.	USD	USD	3. März 2022
Klasse S Aussch. (in EUR abgesichert)	EUR	USD	3. März 2022
Klasse S Aussch. (in GBP abgesichert)	GBP	USD	3. März 2022
Schroder GAIA Oaktree Credit			
Klasse A2 Aussch.	USD	USD	11. Mai 2022
Klasse A2 Aussch. (in CHF abgesichert)	CHF	USD	11. Mai 2022
Klasse A2 Aussch. (in GBP abgesichert)	GBP	USD	11. Mai 2022
Klasse C Aussch.	USD	USD	11. Mai 2022
Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert)	CHF	USD	11. Mai 2022
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	GBP	USD	11. Mai 2022
Klasse E Aussch.	USD	USD	11. Mai 2022
Klasse E Aussch. (in CHF abgesichert)	CHF	USD	11. Mai 2022
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	GBP	USD	11. Mai 2022
Klasse A2 Aussch. (in EUR abgesichert)	EUR	USD	7. Juli 2022
Klasse C Aussch. (in EUR abgesichert)	EUR	USD	7. Juli 2022
Klasse E Aussch. (in EUR abgesichert)	EUR	USD	7. Juli 2022

Bericht des Verwaltungsrats (Forts.)

2. Auflösungen von Anteilsklassen

Während des Berichtsjahrs wurden die folgenden Anteilsklassen aufgelöst:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflösungsdatum
Schroder GAIA BlueTrend			
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	SGD	USD	30. November 2021
Klasse E Thes. CHF	CHF	USD	30. November 2021
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	USD	30. November 2021
Klasse E Thes. GBP	GBP	USD	30. November 2021
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	GBP	USD	30. November 2021
Klasse I Thes.	USD	USD	30. November 2021
Schroder GAIA Contour Tech Equity			
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	SGD	USD	30. November 2021
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	SGD	USD	30. November 2021
Klasse I Thes.	USD	USD	30. November 2021
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	GBP	USD	17. August 2022
Schroder GAIA Egerton Equity			
Klasse I Thes.	EUR	EUR	30. November 2021
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	USD	EUR	30. November 2021
Schroder GAIA Helix			
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	USD	30. November 2021
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	USD	30. November 2021
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	SGD	USD	30. November 2021
Schroder GAIA Sirios US Equity			
Klasse I Thes.	USD	USD	30. November 2021
Schroder GAIA Two Sigma Diversified			
Klasse I Thes.	USD	USD	30. November 2021
Schroder GAIA Wellington Pagosa			
Klasse A1 Thes.	USD	USD	30. November 2021
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	SGD	USD	30. November 2021
Klasse C1 Thes.	USD	USD	30. November 2021
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	SGD	USD	30. November 2021
Klasse I Thes.	USD	USD	30. November 2021

Der Verwaltungsrat

Schroder GAIA
30. September 2022

Bericht des Anlageverwalters

Die Teilfonds 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

Zu Beginn des zwölfmonatigen Berichtszeitraums breitete sich die Omikron-Variante von Covid-19 auf der ganzen Welt aus. Viele Länder verhängten erneut Reisebeschränkungen, auch wenn diese im Allgemeinen nicht so lange andauerten wie in früheren Phasen der Pandemie.

Ende 2021 gab es bereits Bedenken wegen der steigenden Inflation und der möglichen Notwendigkeit einer raschen Anhebung der Zinssätze durch die großen Zentralbanken. Diese Inflationsängste verschärfen sich noch durch die russische Invasion in der Ukraine im Februar 2022. Die Invasion verursachte nicht nur unsägliches menschliches Leid, sondern veranlasste die westlichen Staaten auch, Sanktionen gegen russisches Öl und andere Rohstoffe zu verhängen, was zu weiteren Preiserhöhungen führte.

In den ersten neun Monaten des Jahres 2022 erhöhte die US-Notenbank (Fed) die Zinssätze von 0,25 % auf 3,25 %, wobei weitere Anstiege wahrscheinlich waren, da die Inflation weiterhin hoch blieb. Im September 2022 betrug die Inflationsrate des US-Verbraucherpreisindex (VPI) 8,2 % gegenüber dem Vorjahr. Sie war niedriger als in den Vormonaten, aber immer noch hoch genug für die Erwartung des Marktes auf weitere Zinserhöhungen. Das schnellere Tempo der Zinserhöhungen der Fed trug zur Stärke des US-Dollars während des Berichtszeitraums bei. Die steigende Inflation trug zum schwächeren Wachstum bei. Die US-Wirtschaft schrumpfte sowohl im ersten als auch im zweiten Quartal 2022.

Auch in der Eurozone stieg die Inflation rapide an. Die jährliche Inflation wurde im September auf 10,0 % geschätzt. Die gestiegenen Energiepreise trugen wesentlich zum Anstieg der Inflation bei, nachdem Russland die Gaslieferungen nach Europa reduziert hatte. Die Europäische Zentralbank (EZB) handelte langsamer als die Fed, hob aber die Zinssätze im Juli und September an und erhöhte den Einlagensatz von -0,5 % auf 0,75 %.

Selbst Japan verzeichnete nach Jahrzehnten extrem niedriger Inflation im August 2022 eine jährliche Inflationsrate von 3,0 %. Aufgrund der Omikron-Welle blieb der internationale Reiseverkehr von und nach Japan in diesem Zeitraum stark eingeschränkt.

Im Vereinigten Königreich gab es im September 2022 einen Wechsel im Amt des Premierministers, nachdem Liz Truss die Wahl zum Vorsitzenden der Konservativen Partei gewonnen hatte. Die Ankündigung der finanzpolitischen Pläne ihres neuen Finanzministers – einschließlich verschiedener nicht finanzierter Steuerensenkungen – sorgte jedoch für Turbulenzen an den Finanzmärkten, wobei die Anleiherenditen stiegen und das Pfund Sterling stark fiel. Die meisten Pläne wurden jedoch kurz nach dem Ende des Berichtszeitraums zurückgezogen.

In den Schwellenländern sah es etwas anders aus. Während andere Volkswirtschaften mit wenigen Pandemiebeschränkungen offen blieben, setzte China seine „Null-Covid-Politik“ fort. Der Ausbruch der hoch ansteckenden Omikron-Variante von Covid-19 führte dazu, dass in zahlreichen chinesischen Städten – darunter auch in Shanghai – für längere Zeit Lockdowns verhängt wurden. Dies trug ebenfalls zum weltweiten Anstieg der Inflation bei. China ist von zentraler Bedeutung für die globalen Lieferketten und die Beschränkungen, die zur Eindämmung von Covid eingeführt wurden, haben die Produktionstätigkeit stark beeinträchtigt. Sie verursachten auch Engpässe bei der Verschiffung von Waren, die sich allerdings gegen Ende des Berichtszeitraums zu entspannen begannen.

Überblick über die Entwicklung am Aktienmarkt

Aktien hatten im Umfeld von unterbrochenen Lieferketten, höheren Energiepreisen und steigenden Zinsen ein schwieriges Jahr. Die Aktien der globalen Industrieländer, gemessen am MSCI World Index, fielen um 19,6 % (in US-Dollar).

Der wertorientierte Anlagestil entwickelte sich im Berichtszeitraum besser als sein Wachstumspendant, verzeichnete jedoch nach wie vor einen starken Rückgang. Im Vergleich zum MSCI World Growth, der um -26,9 % nachgab, fiel der MSCI World Value Index um -12,7 % (in US-Dollar). Dies war teilweise auf steigende Rohstoffpreise zurückzuführen, die wertorientierte Bereiche wie Energie begünstigten. Zudem wurden Wachstumstitel durch das Umfeld steigender Anleiherenditen belastet. Der Grund dafür ist, dass die erwarteten Cashflows von Wachstumsaktien weiter in die Zukunft reichen, wodurch sie anfälliger für Änderungen des Diskontsatzes sind, der zur Berechnung ihres Barwerts verwendet wird.

Nach Regionen erwiesen sich Aktien aus den USA als widerstandsfähiger als einige andere Regionen. Nichtsdestotrotz musste der S&P 500 nach wie vor eine negative Rendite von -15,5 % hinnehmen. Europäische Aktien verzeichneten starke Rückgänge. Dies war teilweise auf die Nähe der Region zum Krieg in der Ukraine und die Abhängigkeit von russischem Gas zurückzuführen. Darüber hinaus drückten die Sorgen darüber, was steigende Kraftstoff- und Strompreise für die Verbraucherausgaben bedeuten könnten, die Stimmung. Britische Aktien verzeichneten einen leichteren Rückgang, hauptsächlich dank des hohen Engagements im Energie- und Grundstoffsektor, der über weite Strecken des Berichtszeitraums durch erhöhte Rohstoffpreise gestützt wurde.

Der MSCI Emerging Markets Index entwickelte sich indessen mit einer Rendite von -28,1 % (in US-Dollar) schwächer als der MSCI World Index. Russische Aktien gingen im Vorfeld und nach der Invasion der Ukraine am 24. Februar stark zurück. Der lokale Markt schloss am 25. Februar, und Russland wurde am 9. März aus dem MSCI Emerging Markets Index zu einem Preis entfernt, der praktisch Null betrug.

China blieb weit hinter dem Emerging Markets (EM) Index zurück, nachdem die Zahl der täglichen neuen Fälle von Covid-19 anstieg und in mehreren Städten Lockdowns verhängt wurden. Auch regulatorische Bedenken in Bezug auf in den USA notierte chinesische Aktien trugen zur Marktschwäche bei. Angesichts einer Abkühlung im Technologiesektor gaben die Märkte Korea und Taiwan ebenfalls nach.

Der Anstieg der Rohstoffpreise unterstützte Rohstoffexporteure wie Brasilien, Indonesien, Kuwait, Katar, Saudi-Arabien und die VAE.

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

Bericht des Anlageverwalters (Forts.)

Überblick über die Entwicklung am Anleihemarkt

Die erhöhte Volatilität an den Märkten im bisherigen Jahresverlauf ist darauf zurückzuführen, dass die Zentralbanken und Anleger vor dem Hintergrund einer Wachstumsverlangsamung weiterhin mit der anhaltenden Inflation zu kämpfen haben. Der Krieg in der Ukraine setzte die Energiepreise in Europa weiter unter Druck, und die Sorgen verlagerten sich deutlich in Richtung Rezessionsängste.

Die Fed hat die bisherigen Zinssätze im September um weitere 75 Basispunkte erhöht und den Zinssatz damit auf zwischen 3 % und 3,25 % gebracht. Der Vorsitzende Jerome Powell erklärte, dass der Ausblick der Fed seit dem Treffen in Jackson Hole unverändert bleibe.

Die Veröffentlichung des britischen Staatshaushaltes beschleunigte den Ausverkauf, da die Anleger die Glaubwürdigkeit des finanzpolitischen Rahmens der Regierung in Frage stellten. Da der Markt für britische Staatsanleihen erhebliche Verluste erlitt, griff die Bank of England ein und kaufte vorübergehend langlaufende Staatsanleihen. Das Pfund Sterling erreichte am Ende des dritten Quartals ein beispielloses Tief von 1,03 USD, bevor es sich leicht erholte.

Einige kurze Erholungen im Laufe des Jahres waren nicht von Dauer. Die Renditen auf Staatsanleihen waren allgemein höher und die Kreditspreads auf dem globalen Markt weiter, was die Marktrenditen stark belastete. Die Kreditspreads weiteten sich aufgrund von Befürchtungen aus, dass eine straffere Geldpolitik die weiteren Wachstumsaussichten der Wirtschaft untergraben könnte.

Unternehmensanleihen verzeichneten weltweit zweistellige Rückgänge in den Regionen, der Qualität und den Sektoren, wobei sich Finanztitel relativ gesehen etwas besser entwickelten.

Die Rendite auf zehnjährige US-Staatsanleihen stieg von 1,31 % auf 3,83 % und die Rendite auf zweijährige Anleihen von 0,21 % auf 4,23 %.

Die Rendite auf zehnjährige britische Staatsanleihen stieg von 0,62 % auf 4,15 % und die Rendite auf zweijährige Staatsanleihen von 0,16 % auf 3,92 %.

Die Rendite auf zehnjährige deutsche Bundesanleihen stieg von einer negativen Rendite von -0,38 % auf 2,11 %. Im Vergleich zu den USA steht die Eurozone vor größeren Schwierigkeiten. Die Europäische Zentralbank kämpft in einer Zeit, in der sich der Wachstumsausblick rapide verschlechtert, mit einer zweistelligen Inflation, getrieben von höheren Energiekosten.

Schwellenmarktwährungen gaben nach, als die Anleger aufgrund von Rezessionsängsten in den US-Dollar flüchteten. Mittel- und osteuropäische Währungen tendierten gegenüber dem Euro uneinheitlich.

Ausblick

Die Zinssätze steigen in rasantem Tempo, da die Zentralbanken eingestehen müssen, dass die Inflation nicht mehr nur eine Reihe vorübergehender Schocks ist, sondern die Gefahr besteht, dass sie sich verfestigt. Für viele wirkt dies wie eine neues Regime in der Geldpolitik und an den Finanzmärkten.

Per September 2022 erwartet das Team von Schroders Economics für dieses Jahr ein globales Wachstum von 2,6 %, das sich bis 2023 auf nur 1,5 % verlangsamt. Abgesehen von der Covid-19-Pandemie wird dies das schwächste Jahr für das globale Wachstum seit 2009 sein. Die Prognosen für die USA, die Eurozone und das Vereinigte Königreich wurden stark nach unten korrigiert.

Die weltweite Inflation dürfte von 3,4 % im Jahr 2021 auf 7,2 % im Jahr 2022 steigen, bevor sie 2023 auf 4,3 % zurückgehen dürfte. Unterstützt wird dies durch einen Rückgang der Energieinflation im Jahresvergleich, aber auch durch höhere Zinssätze, die den Druck an Binnenmärkten verringern.

China wird sich wahrscheinlich weiter von den Auswirkungen der Covid-bedingten Lockdowns erholen, flankiert von der politischen Unterstützung, die gerade erst zu wirken beginnt. Die Erholung dürfte jedoch nur von kurzer Dauer sein, da sich die Probleme auf dem Wohnimmobilienmarkt zu verschärfen scheinen, während sich die Aussichten nach aussen verschlechtern werden. Die People's Bank of China hat bereits zwei ihrer Leitzinssätze gesenkt, was bedeutet, dass es eine Chance auf weiter fallende Zinssätze gibt.

Die Anlageverwalter

Schroder GAIA

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



Prüfbericht

An die Anteilhaber von
Schroder GAIA

Unser Prüfungsurteil

Unseres Erachtens zeigt der beiliegende Jahresabschluss ein wahrheitsgetreues und angemessenes Bild der Finanzlage des Schroder GAIA (der „Fonds“) und jedes seiner Teilfonds zum 30. September 2022 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.

Umfang unserer Prüfung

Der Abschluss des Fonds umfasst:

- die Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022,
- die Ertrags- und Aufwandsrechnung für das abgelaufene Geschäftsjahr,
- die Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr,
- das Anlageportfolio zum 30. September 2022 und
- die Anmerkungen zum Abschluss, die einen Überblick über die wesentlichen Rechnungslegungsmethoden enthalten.

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.

Unseres Erachtens sind die Ergebnisse aus unserer Prüfung ausreichend und geeignet, um als Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk zu dienen.

Wir sind 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. Wir haben unsere sonstigen ethischen Verantwortlichkeiten im Rahmen dieser ethischen Anforderungen erfüllt.

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 unser Prüfungsurteil zu diesem Jahresabschluss.

*PricewaterhouseCoopers, Société coopérative, 2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxembourg
T: +352 494848 1, F: +352 494848 2900, www.pwc.lu*

*Cabinet de révision agréé. Expert-comptable (autorisation gouvernementale n° 10028256)
R.C.S. Luxembourg B 65 477 - TVA LU25482518*



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

In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses liegt es in unserer Verantwortung, die vorstehend identifizierten sonstigen Angaben zu lesen und dabei zu erwägen, ob die sonstigen Angaben wesentliche Widersprüche zum Abschluss oder unseren im Rahmen der Prüfung erworbenen Kenntnisse enthalten oder anderweitig wesentlich fehlerhaft zu sein 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 des 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 die Schließung 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 Prüfungsberichts einschließlich unseres Bestätigungsvermerks. 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:

- 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;

Prüfbericht (Forts.)



- beurteilen wir die Eignung der verwendeten Rechnungslegungsmethoden und die Angemessenheit der rechnungslegungsbezogenen Schätzungen und der diesbezüglichen Angaben des Verwaltungsrats des Fonds;
- die Schlussfolgerung, ob der vom Verwaltungsrat des Fonds bei der Erstellung des Abschlusses angewandte Grundsatz der Unternehmensfortführung angemessen ist und ob auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise eine wesentliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen besteht, die die Fähigkeit des Fonds oder eines seiner Teilfonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit ernsthaft in Zweifel stellen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine erhebliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Prüfungsbericht 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 Prüfungsberichts. 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.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Vertreten durch

Luxemburg, 26. Januar 2023

Karim Bara

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
VERMÖGENSWERTE					
Anlagen					
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	265.700.355	2.179.139.807	165.744.016	477.637.625	468.380.959
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	(9.697.344)	(270.506.005)	(34.663.131)	35.726.926	(67.085.423)
Wertpapiere zum Marktwert	256.003.011	1.908.633.802	131.080.885	513.364.551	401.295.536
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)					
aus Devisenterminkontrakten	11.012.105	7.736.272	191.631	(4.179.985)	(7.002.938)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	7.313.025	-	-	2.219.883	13.861.093
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Kontrakten	1.489.913	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	7.700.521	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	35.550.217	35.507.327
aus Differenzkontrakten	578.711	-	16.429.571	-	(29.916.932)
	28.094.275	7.736.272	16.621.202	33.590.115	12.448.550
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	298.242	1.969.715	19.880.845	23.022.900	68.063.492
Bankguthaben	76.475.853	36.251.868	62.889.029	29.212.491	40.827.569
Termineinlagen	-	-	-	-	-
Forderung aus Broker-Einschusskonto	890.952	-	-	2.078.170	-
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	12.997.260	51.740.000	10.077.783	11.442.008	17.864.781
Forderungen aus Zeichnungen	13.792.392	-	210.536	91.765	1.047.011
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	-	1.061.823
Dividenden und Zinsforderungen	409.583	22.495.027	236.233	1.042.826	6.782.303
Erstattungsforderung des Fonds	173.603	-	-	-	6.566
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	1.180.000	-
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	3.130.000	16.240.000	1.280.000	1.430.000	6.590.000
Sonstige Forderungen	-	-	-	2.347.715	-
SUMME VERMÖGENSWERTE	392.265.171	2.045.066.684	242.276.513	618.802.541	555.987.631
VERBINDLICHKEITEN					
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	2.329	-	3.722.834	10.332.001	17.012.268
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	1.031.997	-	13.315.948	15.193.712	11.793.516
Fällige Managementgebühren	303.001	1.723.318	251.170	756.834	272.044
Fällige Performancegebühren	6.790.392	-	11.590	-	118
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	39.099	-	1.033.782	483.069	1.426.836
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	-	5.726.602
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	-	-	-
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	1.540.000	6.890.000	710.000	-	4.180.000
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	1.590.000	9.350.000	570.000	2.610.000	2.410.000
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	9.517.187	50.249.655	3.126.157	829.153	22.802.532
SUMME VERBINDLICHKEITEN	20.814.005	68.212.973	22.741.481	30.204.769	65.623.916
SUMME NETTOVERMÖGEN	371.451.166	1.976.853.711	219.535.032	588.597.772	490.363.715

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
VERMÖGENSWERTE						
Anlagen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	52.815.059	187.604.270	5.164.828	37.404.095	508.087.186	4.430.905.432
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	(7.377.735)	(9.269.251)	(50.519)	(2.843.271)	(21.688.985)	(396.407.207)
Wertpapiere zum Marktwert	45.437.324	178.335.019	5.114.309	34.560.824	486.398.201	4.034.498.225
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	1.067.144	694.725	2.002.218	90.379	5.123.037	17.171.076
aus Kassageschäften	-	-	12.432	-	-	12.685
aus Terminkontrakten	43.173	-	3.736.982	138.600	(601.740)	27.226.043
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	1.422.646	1.451.606
aus Credit Default Index-Kontrakten	-	-	536.107	-	248.695	2.321.019
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	(5.968)	(6.089)
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	9.777	9.976
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	(1.308.497)	6.522.141
aus Total Return Swaps	-	7.695.581	18.017.797	-	12.526.162	110.798.285
aus Differenzkontrakten	-	-	-	263.253	-	(12.871.502)
	1.110.317	8.390.306	24.305.536	492.232	17.414.112	152.635.240
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	2.197.535	1.390.825	278.569	189.870	31.199.611	151.068.240
Bankguthaben	2.215.406	6.712.071	465.714.145	2.882.972	57.150.139	795.964.269
Termineinlagen	-	-	338.925.000	-	-	345.824.201
Forderung aus Broker-Einschusskonto	85.397	-	26.874.668	-	37.239.804	68.493.988
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	110.000	-	28.623.738	2.058.905	47.466.464	186.105.444
Forderungen aus Zeichnungen	118.467	349.294	7.868.681	8.797	4.040.936	28.087.418
Optionen und Swaptions zum Marktwert	775	-	-	-	2.417.299	3.550.734
Dividenden und Zinsforderungen	606.636	325.930	75.109	135.076	1.530.549	34.318.873
Erstattungsforderung des Fonds	-	-	-	-	-	183.837
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	70.000	-	1.259.750
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	50.000	750.000	5.470.000	90.000	3.750.000	39.551.004
Sonstige Forderungen	-	-	-	531.061	-	2.952.742
SUMME VERMÖGENSWERTE	51.931.857	196.253.445	903.249.755	41.019.737	688.607.115	5.844.493.965
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	4.095.159	2.878.475	185.408.773	128.323	48.661.664	277.588.556
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	124.198	643.421	1.559.338	10.386	6.860.508	51.253.631
Fällige Managementgebühren	15.016	269.495	863.553	25.133	651.412	5.223.005
Fällige Performancegebühren	-	480.767	331	-	3.407.256	10.908.070
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	-	173.358	737.639	45.342	1.039.377	5.075.404
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	-	-	5.843.174
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	910.000	-	-	-	928.524
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	30.000	440.000	3.600.000	-	2.100.000	19.886.741
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	20.000	310.000	1.870.000	160.000	1.650.000	20.924.013
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	131.071	1.678.863	14.364.106	25.284	8.698.325	113.676.589
SUMME VERBINDLICHKEITEN	4.415.444	7.784.379	208.403.740	394.468	73.068.542	511.307.707
SUMME NETTOVERMÖGEN	47.516.413	188.469.066	694.846.015	40.625.269	615.538.573	5.333.186.258

* Für die in Euro angegebene Summe der Nettovermögensaufstellung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 30. September 2022 umgerechnet: 1 Euro = 0,98005 US-Dollar und 1 Euro = 0,87775 Pfund Sterling.

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (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
Nettoinventarwert					
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
zum 30. September 2020	87.937.926	1.243.442.808	229.295.450	1.015.453.805	404.188.534
Im Umlauf befindliche Anteile*					
zum 30. September 2022					
Klasse A Thes.	123.093	2.401	176.071	361.114	4.847
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2.122	-	2.838	-	100
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	431.750	2.913	39.126	-	129.763
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	10.884	-
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	-	100	-	-	151
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	5.342	-	140
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	344.709	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	813	-
Klasse A1 Thes.	-	-	15.885	22.018	-
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	91.701	-
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.	447.257	7.052	953.745	1.021.683	10.917
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	296.014	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	14.183	1.937	22.773	-	369
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	351.354	8.204	530.090	-	71.105
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	720.276	2.000	179.245	294.604	39.997
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	94.048	-	11
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	140
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	624.156	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	5.866	-
Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	3.711	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	13.040	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	1
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	50.801	-	9.594	6	450.656
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	2.509	-	56.356
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	5.000	-	37.980	-	1.392.317
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	86.926
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	50.117	-	-
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.	-	14.858	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.262	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	7.655	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	162	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	256	-	-	-
Klasse I Thes.	-	148.883	-	-	164.951
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	27.091	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	9	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	120	-	-	103
Klasse IF Thes.	-	200.458	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	114.953	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	451.410	-	-	-
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	-	7.383.343	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	11.709	-	-	-
Klasse IZ Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	92

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (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
Im Umlauf befindliche Anteile* (Forts.)					
zum 30. September 2022					
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)	68.900	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	1.250	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in SEK abgesichert)	40.059	-	-	-	-
Klasse PI Thes. (in CHF abgesichert)	-	27.100	-	-	-
Klasse PI Thes. (in EUR abgesichert)	-	40.030	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	56.230	-	-	-
Klasse PI Aussch. (in GBP abgesichert)	-	79.439	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	120.427
Klasse S Aussch. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	27.910
Klasse S Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	1.334.152
Klasse X Thes.	-	-	-	144.100	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	655.490
Klasse Y Thes.	-	2	-	-	-
Klasse Y Thes. (in CHF abgesichert)	-	10	-	-	-
Klasse Y Thes. (in EUR abgesichert)	-	10	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	2	-	-	-
Klasse Y1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	10	-	-	-
Klasse Y1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	10	-	-	-

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert					
zum 30. September 2022	47.516.413	188.469.066	694.846.015	40.625.269	615.538.573
zum 30. September 2021	28.626.911	338.622.600	908.388.830	32.208.486	411.679.496
zum 30. September 2020	-	496.429.129	1.437.139.563	53.232.443	551.890.372
Im Umlauf befindliche Anteile*					
zum 30. September 2022					
Klasse A Thes.	-	601.060	-	-	142.940
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	-	4.775	-	-	5.707
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	-	105.281	-	-	202.353
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	16.885
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.	15	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch. (in CHF abgesichert)	101	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch. (in EUR abgesichert)	100	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch. (in GBP abgesichert)	101	-	-	-	-
Klasse C Thes.	10.131	319.476	2.247.282	132.532	2.708.890
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	-	139.846
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	620	11.677	37.517	2.569	79.016
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	100	208.845	1.234.520	94.001	1.300.358
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	100	53.093	1.409.403	-	616.372
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	5.072	-
Klasse C Aussch.	15	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert)	101	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in EUR abgesichert)	100	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	101	300	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	23
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	365
Klasse E Thes.	264.913	170	-	-	47.943
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	100	-	-	-	8.532
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	49.404	11.132	-	-	128.136
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	100	-	-	-	64.002
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	15	-	-	-	-
Klasse E Aussch. (in CHF abgesichert)	101	-	-	-	-
Klasse E Aussch. (in EUR abgesichert)	100	-	-	-	-
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	101	-	-	-	-
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	-	-	15	-
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)	-	-	-	-	-

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Im Umlauf befindliche Anteile* (Forts.)					
zum 30. September 2022					
Klasse K Thes.	-	-	567.192	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	885	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	68.884	87	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	77	-
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.	-	-	-	95.767	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	26.142	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	4.574	-
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)	-	-	-	-	-

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (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
Nettoinventarwert je Anteil*					
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 jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (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
Nettoinventarwert je Anteil* (Forts.)					
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 jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil*					
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	-

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil* (Forts.)					
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)	-	-	-	-	-

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (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
Nettoinventarwert je Anteil*					
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 jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil*					
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	-	-	-

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (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
Nettoinventarwert je Anteil*					
zum 30. September 2020					
Klasse A Thes.	86,58	1.420,12	123,26	211,77	107,16
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	76,51	-	115,69	-	102,22
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	78,76	-	116,88	-	102,77
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	197,45	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	118,40	-	171,31	-	105,54
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	208,39	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	213,86	-
Klasse A1 Thes.	-	-	123,20	199,36	-
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	201,60	-
Klasse C Thes.	88,63	1.423,33	126,38	226,74	108,09
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	78,43	1.132,03	119,86	-	103,83
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	80,11	1.187,75	119,68	-	104,43
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	84,81	101,39	97,89	209,80	106,30
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	29.258,43	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	990,58	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	174,53	-	107,19
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	223,17	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	226,00	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	229,37	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	84,95	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5.333,77
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	5.191,66
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	5.208,67
Klasse E Thes.	91,56	-	126,84	224,98	109,18
Klasse E Thes. CHF	79,53	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	79,92	-	119,03	-	104,69
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	82,36	-	119,96	-	105,46
Klasse E Thes. GBP	94,68	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	88,59	-	97,47	-	106,98
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	986,64	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	175,49	-	108,18
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	87,47	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	1.418,48	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.130,75	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.185,11	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	1.170,10	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	1.566,30	-	-	-
Klasse I Thes.	98,72	1.583,23	139,84	317,22	110,86
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.355,82	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.426,13	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	10.145,79	-	-	11.409,09
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	254,12	-
Klasse IF Thes.	-	1.458,67	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.248,94	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.313,54	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	1.392,31	-	-	-
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 GBP abgesichert)	87,63	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	-	225,24	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	104,73

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil*				
zum 30. September 2020				
Klasse A Thes.	135,15	-	-	102,30
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	162,66	-	-	94,81
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	122,38	-	-	95,77
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	140,69
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	100,92
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse C Thes.	140,52	117,57	96,28	104,32
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	102,62
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	167,07	107,12	122,31	96,62
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	126,91	108,95	108,76	97,67
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	131,62	112,57	-	80,23
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	143,51
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	128,91	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	131,54	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	5.218,57
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	4.836,18
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	4.882,00
Klasse E Thes.	149,91	-	-	105,52
Klasse E Thes. CHF	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	97,89
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	135,83	-	-	98,89
Klasse E Thes. GBP	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	81,26
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	145,42
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.	178,21	134,70	98,74	108,36
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 Aussch.	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	115,46	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	105,16	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	106,80	107,71	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	127,17	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	96,30	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	108,77	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	128,94	-
Klasse X Thes.	93,01	-	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	134,99	-	-	-

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

Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
ERTRÄGE					
Nettoausschüttungen [^]	5.660	-	-	3.198.194	31.003.789
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	1.173.440	133.627.456	-	-	851.314
Nettoertrag aus Swaps	402.815	-	-	-	248.979
Bankzinsen	172.989	439.892	335.280	900	218.997
Sonstige Erträge	10.510	26.166	-	25.542	-
Erträge insgesamt	1.765.414	134.093.514	335.280	3.224.636	32.323.079
AUFWAND					
Performancegebühren	6.790.392	-	11.590	854.333	117
Managementgebühren	2.863.828	22.477.113	4.510.598	11.588.745	4.230.815
Nettodividendenaufwand [^]	-	-	3.727.789	-	-
Nettoaufwand aus Swaps	-	14.075	869.096	1.290.952	-
Verwahrstellengebühren	217.615	587.143	89.188	210.845	221.239
Verwaltungsgebühren	806.805	3.560.261	1.076.842	2.525.116	873.891
Taxe d'abonnement	139.406	235.469	154.880	349.767	251.352
Vertriebsgebühren	-	-	13.756	117.449	-
Bank- und Zinskosten	8.300	-	927	497.312	51.049
Sonstige Aufwendungen	160.776	723.237	178.167	1.352.786	378.173
Aufwendungen insgesamt	10.987.122	27.597.298	10.632.833	18.787.305	6.006.636
Abzüglich: Kostenzuschüsse	(173.603)	-	-	-	(6.566)
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	(9.048.105)	106.496.216	(10.297.553)	(15.562.669)	26.323.009

[^] Enthält erhaltene/gezahlte Dividenden in Verbindung mit Derivaten und deren Basiswerten.

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
ERTRÄGE						
Nettoausschüttungen [^]	13.887	1.543.896	20.734	243.454	2.311.861	39.085.808
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	1.797.812	105.593	2.328.959	199.043	1.611.821	144.603.479
Nettoertrag aus Swaps	-	-	-	-	-	665.062
Bankzinsen	14.028	72.097	867.318	12.791	408.411	2.595.965
Sonstige Erträge	414	115	-	-	8.503	72.181
Erträge insgesamt	1.826.141	1.721.701	3.217.011	455.288	4.340.596	187.022.495
AUFWAND						
Performancegebühren	-	480.767	331	-	3.407.257	11.762.403
Managementgebühren	105.806	4.097.156	11.631.959	271.242	6.454.898	69.417.458
Nettodividendenaufwand [^]	-	-	-	-	-	3.803.672
Nettoaufwand aus Swaps	-	1.273.197	10.772.847	322.467	2.810.293	17.718.235
Verwahrstellengebühren	30.774	65.454	212.379	8.704	357.173	2.037.980
Verwaltungsgebühren	43.378	800.219	2.514.586	95.963	1.600.536	14.140.509
Taxe d'abonnement	10.053	119.889	371.008	17.779	261.200	1.944.694
Vertriebsgebühren	-	-	-	-	3	131.488
Bank- und Zinskosten	31.186	-	104.550	24	100.726	800.118
Sonstige Aufwendungen	11.299	120.578	446.763	18.525	266.055	3.705.454
Aufwendungen insgesamt	232.496	6.957.260	26.054.423	734.704	15.258.141	125.462.011
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	-	-	-	-	(183.837)
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	1.593.645	(5.235.559)	(22.837.412)	(279.416)	(10.917.545)	61.744.321

* 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 2022 umgerechnet: 1 Euro = 0,98005 US-Dollar und 1 Euro = 0,87775 Pfund Sterling.

[^] Enthält erhaltene/gezahlte Dividenden in Verbindung mit Derivaten und deren Basiswerten.

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Veränderung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)**	(9.048.105)	106.496.216	(10.297.553)	(15.562.669)	26.323.009
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)					
aus verkauften Wertpapieren	25.192.567	(14.218.711)	(113.414.552)	23.183.527	(39.735.420)
aus Devisenterminkontrakten	(12.632.475)	(326.756.007)	(30.767.424)	(51.204.276)	(114.763.314)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	22.482.081	-	-	4.760.933	16.439.687
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Kontrakten	9.832.496	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	4.860.980	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	73.150.460	230.036.864
aus Differenzkontrakten	-	-	99.991.152	-	(145.038.981)
aus Options- und Swaptionkontrakten	1.356.495	-	(108.000)	-	1.289.001
aus Devisen	(1.510.719)	(857.050)	(146.731)	26.903.367	(31.850.080)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)	49.581.425	(341.831.768)	(44.445.555)	76.794.011	(83.622.243)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)					
aus Anlagen	(17.234.380)	(268.442.067)	(54.831.745)	(143.916.303)	(107.700.615)
aus Devisenterminkontrakten	13.278.934	25.964.451	2.781.303	8.438.205	817.730
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	8.126.906	-	-	(1.170.366)	10.682.279
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Kontrakten	(12.636.447)	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	9.961.515	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	3.992.207	7.492.066
aus Differenzkontrakten	1.039.530	-	3.116.216	-	(10.509.037)
aus Options- und Swaptionkontrakten	(2.564)	-	-	-	378.139
aus Devisen	63.581	485.838	46.315	(291.689)	141.049
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	2.597.075	(241.991.778)	(48.887.911)	(132.947.946)	(98.698.389)
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	43.130.395	(477.327.330)	(103.631.019)	(71.716.604)	(155.997.623)
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	203.122.323	547.127.393	120.527.317	124.513.744	549.360.274
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(80.891.892)	(454.837.140)	(239.064.626)	(413.664.385)	(627.774.600)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	(1.148.737)	-	-	(6.757.237)
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Geschäftsjahres	165.360.826	(386.185.814)	(222.168.328)	(360.867.245)	(241.169.186)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	206.090.340	2.363.039.525	441.703.360	949.465.017	731.532.901
Nennwährungsanpassung***	-	-	-	-	-
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	371.451.166	1.976.853.711	219.535.032	588.597.772	490.363.715

** 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 2021 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 30. September 2022.

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Veränderung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)**	1.593.645	(5.235.559)	(22.837.412)	(279.416)	(10.917.545)	61.744.321
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	(394.060)	13.769.451	513.554	(886.231)	4.782.916	(103.844.461)
aus Devisenterminkontrakten	540.963	(6.851.102)	(76.409.720)	306.507	(10.195.602)	(640.452.237)
aus Kassageschäften	-	-	(2.005.447)	-	-	(2.046.270)
aus Terminkontrakten	10.728	-	(7.127.564)	(276.262)	11.699.909	48.836.625
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	2.386.568	2.435.149
aus Credit Default Index-Kontrakten	-	-	(1.880.673)	-	(52.813)	8.059.803
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	5.556.199	5.669.302
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	111.247	113.511
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	8.732.552	13.870.244
aus Total Return Swaps	-	21.906.494	63.109.633	-	4.666.562	399.378.265
aus Differenzkontrakten	-	-	-	3.745.333	-	(41.697.850)
aus Options- und Swaptionkontrakten	(1.182)	622.662	-	(48.531)	(6.042.871)	(2.997.890)
aus Devisen	(222.228)	(1.801.381)	(6.625)	535	(12.174.917)	(22.654.446)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)	(65.779)	27.646.124	(23.806.842)	2.841.351	9.469.750	(335.330.255)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)						
aus Anlagen	(7.090.507)	(44.905.710)	(161.555)	(3.434.957)	(38.620.420)	(697.788.364)
aus Devisenterminkontrakten	927.982	1.276.498	7.687.625	32.406	6.078.522	68.485.376
aus Kassageschäften	-	-	330	-	-	337
aus Terminkontrakten	43.173	-	16.032.461	163.800	(1.416.497)	33.165.855
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	1.409.862	1.438.561
aus Credit Default Index-Kontrakten	-	-	626.291	-	242.370	(12.007.332)
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	988.953	1.009.084
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	9.777	9.976
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	(2.788.381)	7.319.151
aus Total Return Swaps	-	1.046.632	27.808.191	-	13.011.461	54.355.302
aus Differenzkontrakten	-	-	-	190.900	-	(6.265.131)
aus Options- und Swaptionkontrakten	422	(421.626)	-	5.889	426.466	395.299
aus Devisen	(36.636)	(22.286)	237.057	3.341	(1.540.792)	(926.497)
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	(6.155.566)	(43.026.492)	52.230.400	(3.038.621)	(22.198.679)	(550.808.383)
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	(4.627.700)	(20.615.927)	5.586.146	(476.686)	(23.646.474)	(824.394.317)
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	32.886.583	40.374.987	116.607.983	14.977.433	402.520.066	2.195.071.396
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(9.367.952)	(169.912.594)	(335.736.944)	(6.083.964)	(175.014.515)	(2.555.793.218)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	(1.429)	-	-	-	-	(8.068.367)
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Geschäftsjahres	18.889.502	(150.153.534)	(213.542.815)	8.416.783	203.859.077	(1.193.184.506)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	28.626.911	338.622.600	908.388.830	32.208.486	411.679.496	5.674.359.712
Nennwährungsanpassung***	-	-	-	-	-	852.011.052
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	47.516.413	188.469.066	694.846.015	40.625.269	615.538.573	5.333.186.258

* 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 2022 umgerechnet: 1 Euro = 0,98005 US-Dollar und 1 Euro = 0,87775 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 2021 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 30. September 2022.

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen

	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	68,92	93,32	-	-	36,23
Sonstige Wertpapiere					
Werbung	-	-	-	-	-
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	-	0,13	-
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	-
Fluggesellschaften	-	-	-	-	0,04
Bekleidung	-	-	-	-	0,41
Automobilhersteller	-	-	-	-	0,84
Autoteile und -zubehör	-	-	-	-	0,92
Banken	-	-	-	4,04	5,01
Getränke	-	-	-	-	0,55
Biotechnologie	-	-	-	-	-
Baustoffe	-	-	-	-	0,34
Chemie	-	-	-	1,88	0,86
Kohle	-	-	-	-	-
Gewerbliche Dienstleistungen	-	-	5,48	-	0,63
Computer	-	-	1,39	-	0,67
Kosmetik und Körperpflege	-	-	-	-	0,23
Vertrieb und Großhandel	-	-	-	-	0,14
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	-	16,09	1,14
Elektrik	-	-	-	-	-
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	0,09
Elektronik	-	-	-	-	2,79
Energie – Alternative Energiequellen	-	-	-	-	1,12
Bau- und Ingenieurwesen	-	-	-	-	-
Unterhaltung	-	-	1,91	-	-
Umweltschutz	-	-	-	-	-
Lebensmittel	-	-	-	-	1,22
Gas	-	-	-	-	-
Gesundheitswesen – Produkte	-	-	-	-	0,31
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	-	-	3,88	0,39
Holdinggesellschaften – Diversifiziert	-	-	-	-	-
Wohngebäude-Bauträger	-	-	-	2,05	0,01
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	1,13
Haushaltswaren	-	-	-	-	0,38
Versicherungen	-	3,23	-	-	1,37
Internet	-	-	15,81	11,52	0,27
Investmentgesellschaften	-	-	-	1,31	4,03
Eisen und Stahl	-	-	-	-	-
Freizeit	-	-	-	-	0,31
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	0,04
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	0,33
Maschinen – Diversifiziert	-	-	-	-	0,50
Medien	-	-	3,46	-	-
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	-
Bergbau	-	-	-	3,80	1,02
Diverse Fertigungsbetriebe	-	-	-	-	-
Öl und Gas	-	-	-	2,95	0,77

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)					
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	-
Verpackung und Container	-	-	-	-	-
Pharmazeutika	-	-	-	-	0,60
Pipelines	-	-	-	-	-
Immobilien	-	-	-	0,34	1,74
Einzelhandel	-	-	-	3,21	1,93
Halbleiter	-	-	4,34	8,47	10,97
Software	-	-	21,58	7,18	0,63
Lagerung	-	-	-	-	-
Telekommunikation	-	-	5,74	-	1,14
Transport	-	-	-	20,37	0,68
Wasser	-	-	-	-	0,06
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	68,92	96,55	59,71	87,22	81,84
Termineinlagen	-	-	-	-	-
Sonstiges Nettovermögen	31,08	3,45	40,29	12,78	18,16
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	95,62	22,27	0,01	64,16	48,87
Sonstige Wertpapiere					
Werbung	-	-	-	-	0,08
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	-	-	0,08
Agrarwirtschaft	-	0,09	-	-	0,26
Fluggesellschaften	-	2,32	-	-	-
Bekleidung	-	-	-	-	-
Automobilhersteller	-	2,16	-	-	0,03
Autoteile und -zubehör	-	-	-	-	0,17
Banken	-	5,56	-	2,15	5,91
Getränke	-	1,93	-	0,74	-
Biotechnologie	-	0,35	-	-	2,09
Baustoffe	-	2,13	-	0,79	0,40
Chemie	-	-	-	-	0,19
Kohle	-	-	-	-	0,06
Gewerbliche Dienstleistungen	-	4,70	-	1,32	0,57
Computer	-	0,28	-	1,21	0,07
Kosmetik und Körperpflege	-	-	-	-	-
Vertrieb und Großhandel	-	-	-	-	0,06
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	5,80	-	1,40	1,53
Elektrik	-	0,37	-	-	1,52
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	0,13
Elektronik	-	1,46	-	1,49	0,09
Energie – Alternative Energiequellen	-	-	-	-	0,14
Bau- und Ingenieurwesen	-	0,19	-	-	0,14
Unterhaltung	-	-	-	1,32	-
Umweltschutz	-	0,73	-	-	0,06
Lebensmittel	-	-	-	1,15	-
Gas	-	-	-	-	0,33
Gesundheitswesen – Produkte	-	13,06	-	0,79	1,18
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	0,27	-	-	1,00
Holdinggesellschaften – Diversifiziert	-	-	-	-	0,04
Wohngebäude-Bauträger	-	-	-	-	0,22
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	-
Haushaltswaren	-	-	-	-	-
Versicherungen	-	-	-	2,55	1,57
Internet	-	2,06	-	-	0,58
Investmentgesellschaften	-	-	0,72	-	0,54
Eisen und Stahl	-	-	-	-	0,05
Freizeit	-	2,31	-	-	-
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	0,04
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	0,11
Maschinen – Diversifiziert	-	-	-	-	0,34
Medien	-	-	-	-	0,02
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	0,05
Bergbau	-	-	-	-	0,45
Diverse Fertigungsbetriebe	-	1,50	-	1,47	0,13
Öl und Gas	-	2,32	-	-	4,91

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)					
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	2,18	-	-	0,71
Verpackung und Container	-	0,52	-	-	-
Pharmazeutika	-	3,48	-	-	2,10
Pipelines	-	0,64	-	-	0,62
Immobilien	-	-	-	1,27	0,17
Einzelhandel	-	2,39	-	0,97	0,33
Halbleiter	-	3,84	-	-	0,26
Software	-	8,02	-	1,38	0,30
Lagerung	-	-	-	0,91	-
Telekommunikation	-	0,36	-	-	0,38
Transport	-	1,33	-	-	0,14
Wasser	-	-	-	-	-
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	95,62	94,62	0,73	85,07	79,02
Termineinlagen	-	-	48,78	-	-
Sonstiges Nettovermögen	4,38	5,38	50,49	14,93	20,98
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Anlageportfolio zum 30. September 2022

Schroder GAIA BlueTrend

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Vereinigte Staaten				
14.000.000	USD	United States Treasury Note 15/10/22, 1.38%	13.993.881	3,77
16.000.000	USD	United States Treasury Note 15/11/22, 1.63%	15.971.584	4,30
16.000.000	USD	United States Treasury Note 15/12/22, 1.63%	15.952.039	4,29
15.200.000	USD	United States Treasury Note 15/01/23, 1.50%	15.115.631	4,07
14.300.000	USD	United States Treasury Note 15/02/23, 1.38%	14.172.339	3,82
14.500.000	USD	United States Treasury Note 15/03/23, 0.50%	14.283.949	3,85
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/04/23, 0.25%	9.805.334	2,64
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/05/23, 0.13%	9.761.233	2,63
6.000.000	USD	United States Treasury Note 15/06/23, 0.25%	5.840.356	1,57
9.500.000	USD	United States Treasury Note 15/07/23, 0.13%	9.203.107	2,48
17.500.000	USD	United States Treasury Note 15/08/23, 0.13%	16.887.532	4,54
13.000.000	USD	United States Treasury Note 15/10/23, 0.13%	12.457.270	3,35
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/11/23, 0.25%	9.560.938	2,57
14.500.000	USD	United States Treasury Note 15/12/23, 0.13%	13.802.754	3,72
15.000.000	USD	United States Treasury Note 15/01/24, 0.13%	14.221.289	3,83
10.500.000	USD	United States Treasury Note 15/02/24, 0.13%	9.922.500	2,67
14.500.000	USD	United States Treasury Note 15/03/24, 0.25%	13.678.711	3,68
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/04/24, 0.38%	9.419.531	2,54
12.500.000	USD	United States Treasury Note 15/05/24, 0.25%	11.715.332	3,15
Summe Anleihen			235.765.310	63,47
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			235.765.310	63,47

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Irland				
212.580.894	USD	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	20.237.701	5,45
Summe Anleihen			20.237.701	5,45
Summe sonstige Wertpapiere			20.237.701	5,45
Summe Kapitalanlagen			256.003.011	68,92
Sonstiges Nettovermögen			115.448.155	31,08
Nettoinventarwert			371.451.166	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien					7.750.000	USD	Integrity Re II 12/04/23, variabel	1.162.500	0,06
Supranational					12.000.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A1 19/12/23, variabel	9.000.000	0,46
550	USD	Voussoir Re SideCar	2.954.050	0,15	10.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/23, variabel	9.980.938	0,50
697	USD	Voussoir Re SideCar- Preference	7.202.798	0,36	5.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variabel	3.937.500	0,20
530	USD	Voussoir Re SideCar- Preference	53.767.440	2,72	12.087.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variabel	11.769.716	0,60
Summe Aktien					3.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B1 21/04/25, variabel	3.571.875	0,18
Anleihen					4.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C1 21/04/25, variabel	4.560.000	0,23
Bermuda					10.464.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A2 20/04/26, variabel	9.156.000	0,46
14.963.000	USD	3264 Re 07/02/23, variabel	14.555.258	0,74	4.000.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B2 20/04/26, variabel	3.770.000	0,19
26.000.000	USD	Acorn Re 07/11/24, variabel	24.844.299	1,26	3.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C2 20/04/26, variabel	3.590.625	0,18
10.263.000	USD	Baldwin Re 07/07/25, variabel	9.857.612	0,50	6.000.000	USD	Kilimanjaro Re Series A2 05/05/23, variabel	5.710.500	0,29
2.667.000	USD	Blue Halo Re Series A 24/02/25, variabel	2.596.991	0,13	17.600.000	USD	Kilimanjaro Re Series B2 05/05/23, variabel	17.243.599	0,87
3.500.000	USD	Blue Halo Re Series B 24/02/25, variabel	3.202.500	0,16	1.527.288	USD	Manatee Re III 08/06/26, variabel	305.458	0,02
4.750.000	USD	Bowline Re Series 2019- 1A 20/03/23, variabel	4.625.313	0,23	25.602.000	USD	Merna Reinsurance II 08/07/24, variabel	15.361.200	0,78
14.350.000	USD	Bowline Re Series 2019- 1B 20/03/23, variabel	13.973.313	0,71	15.000.000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/25, variabel	14.632.500	0,74
3.333.000	USD	Bowline Re Series 2022-1 23/05/25, variabel	3.336.833	0,17	14.700.000	USD	Mona Lisa Re Series A 09/01/23, variabel	14.275.905	0,72
6.750.000	USD	Citrus Re 07/06/25, variabel	6.680.813	0,34	11.714.000	USD	Mona Lisa Re Series B 09/01/23, variabel	11.564.647	0,59
133	USD	Eden Re II 22/03/23, ZCP	2.940	-	9.000.000	USD	Montoya Re 07/04/25, variabel	8.889.750	0,45
1.487.500	USD	Eden Re II 22/03/24, ZCP	629.436	0,03	30.000.000	USD	Mystic Re IV 08/01/24, variabel	29.812.499	1,51
1.100.000	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	931.150	0,05	2.020.000	USD	Nakama Re 14/01/25, variabel	1.980.610	0,10
24.512.000	USD	Everglades Re II Series A1 14/05/24, variabel	21.447.999	1,08	30.250.000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	28.888.749	1,46
28.750.000	USD	Everglades Re II Series A2 14/05/24, variabel	25.156.249	1,27	14.880.000	USD	Northshore Re II 07/07/23, variabel	14.861.400	0,75
19.250.000	USD	Everglades Re II Series B1 14/05/24, variabel	15.881.249	0,80	14.962.000	USD	Northshore Re II 08/01/24, variabel	14.490.697	0,73
12.500.000	USD	FloodSmart Re Series A 27/02/23, variabel	5.625.000	0,28	8.884.000	USD	Phoenician Re 14/12/23, variabel	8.772.950	0,44
9.750.000	USD	FloodSmart Re Series B 27/02/23, variabel	1.462.500	0,07	16.000.000	USD	Phoenician Re Series A 14/12/23, variabel	15.800.000	0,80
7.917.000	USD	Four Lakes Re 07/01/25, variabel	7.871.477	0,40	5.000.000	USD	Power Protective Re 15/12/23, variabel	4.912.500	0,25
11.950.000	USD	Galileo Re Series C 08/01/24, variabel	11.642.885	0,59	2.250.000	USD	Power Protective Re 09/10/24, variabel	2.190.938	0,11
9.400.000	USD	Galileo Re Series D 08/01/24, variabel	9.241.140	0,47					
2.400.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	2.328.000	0,12					
5.000.000	USD	Integrity Re 12/06/23, variabel	750.000	0,04					

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
23.000.000	USD	Riverfront Re Series A 07/01/25, variabel	22.137.499	1,12	10.966.000	EUR	Hexagon II Reinsurance DAC 17/01/24, variabel	10.586.020	0,54
5.750.000	USD	Riverfront Re Series B 07/01/25, variabel	5.563.125	0,28	Singapur		37.612.414	1,90	
6.601.509	USD	Sanders Re II 07/04/23, variabel	182.202	0,01	17.250.000	USD	Alamo Re II 08/06/23, variabel	17.142.188	0,86
9.270.000	USD	Sanders Re II 07/06/23, variabel	8.574.750	0,43	9.783.000	USD	Easton Re 08/01/24, variabel	9.408.800	0,48
9.625.000	USD	Sanders Re II 07/04/24, variabel	9.461.375	0,48	6.750.000	USD	Kizuna Re III 07/04/26, variabel	6.564.375	0,33
7.917.000	USD	Sanders Re II Series A 07/04/25, variabel	7.614.175	0,39	4.012.000	USD	Phoenix 1 Re 04/01/27, ZCP	4.497.051	0,23
16.447.000	USD	Sanders Re II Series A1 07/04/25, variabel	15.797.344	0,80	Supranational		42.003.342	2,12	
7.750.000	USD	Sanders Re III Series A 07/06/25, variabel	7.701.563	0,39	3.450.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 02/12/22, variabel	3.441.375	0,17
8.250.000	USD	Sanders Re III Series B 07/06/25, variabel	4.950.000	0,25	9.620.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 02/12/22, variabel	1.443.000	0,07
11.050.000	USD	Sanders Re III Series A 07/04/26, variabel	10.859.388	0,55	18.500.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 29/12/23, variabel	18.296.499	0,93
8.750.000	USD	Sanders Re III Series B 07/04/26, variabel	8.500.625	0,43	2.013.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 13/03/24, variabel	2.007.968	0,10
11.250.000	USD	Sutter Re Series A 23/05/23, variabel	11.100.938	0,56	5.550.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 13/03/24, variabel	5.466.750	0,28
13.100.000	USD	Sutter Re Series F 23/05/23, variabel	12.926.425	0,65	6.700.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series C 13/03/24, variabel	6.603.687	0,33
5.256.000	USD	Tailwind Re Series A 08/01/25, variabel	5.045.760	0,26	4.750.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series D 13/03/24, variabel	4.744.063	0,24
8.958.000	USD	Tailwind Re Series B 08/01/25, variabel	8.543.693	0,43	Vereinigtes Königreich		20.833.313	1,05	
5.152.000	USD	Tailwind Re Series C 08/01/25, variabel	4.913.720	0,25	21.450.000	USD	Atlas Capital UK 2019 07/06/23, variabel	20.833.313	1,05
250.000	USD	Tailwind Re Series D 08/01/25, variabel	238.438	0,01	Summe Anleihen		757.105.290	38,30	
9.500.000	USD	Titania Re 21/06/24, variabel	9.203.125	0,47	Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		821.029.578	41,53	
10.107.000	USD	Titania Re 27/12/24, variabel	9.538.481	0,48					
3.750.000	USD	Tomoni Re Series A 07/04/26, variabel	3.661.875	0,19					
6.750.000	USD	Tomoni Re Series B 07/04/26, variabel	6.566.063	0,33					
1.384.000	USD	Voussoir Re 01/03/24, variabel	126.082	0,01					
1.460.000	USD	Voussoir Re perpetual, variabel	134.685	0,01					
3.500.000	USD	Wrigley Re 08/07/24, variabel	3.404.625	0,17					
Hongkong			2.973.750	0,15					
3.000.000	USD	Greater Bay Re 15/10/22, ZCP	2.973.750	0,15					
Irland			20.100.502	1,02					
9.856.000	EUR	Azzurro Re II DAC 17/01/24, variabel	9.514.482	0,48					

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen					9.250.000	USD	Hestia Re 22/04/25, variabel	1.387.500	0,07
Bermuda					719.278.912			36,40	
7.308.000	USD	2001 Cat Re 08/01/24, variabel	7.241.497	0,37	6.864.000	USD	Hypatia Series A 07/06/23, variabel	6.743.880	0,34
39.726.000	USD	Alamo Re 07/06/24, variabel	37.670.179	1,91	2.379.000	USD	Hypatia Series B 07/06/23, variabel	2.337.368	0,12
4.250.000	USD	Alamo Re 07/06/25, variabel	4.132.063	0,21	6.750.000	USD	Integrity Re 06/06/25, variabel	1.012.500	0,05
2.450.000	USD	Artex 17/01/25, variabel	2.278.500	0,12	6.000.000	USD	Isosceles Insurance 10/07/23, variabel	5.940.000	0,30
19.855.000	USD	Bonanza Re 20/02/24, variabel	1.191.300	0,06	3.000.000	USD	Kendall Re 02/05/24, variabel	2.814.000	0,14
18.246.000	USD	Bonanza Re 23/12/24, variabel	8.210.700	0,42	7.857.000	USD	Kilimanjaro III Re 21/04/25, variabel	6.874.875	0,35
12.250.000	USD	Bonanza Re 16/03/25, variabel	11.943.750	0,60	24.844.000	USD	Kilimanjaro III Re 25/06/25, variabel	24.688.724	1,25
24.917.000	USD	Cape Lookout Re 22/03/24, variabel	24.181.948	1,22	7.500.000	USD	Matterhorn Re 08/01/24, variabel	6.668.250	0,34
10.000.000	USD	Cape Lookout Re 28/03/25, variabel	9.655.000	0,49	4.257.000	USD	Matterhorn Re 07/06/24, variabel	4.225.073	0,21
816.477	USD	Citrus Re 20/03/23, variabel	244.943	0,01	9.250.000	USD	Matterhorn Re 24/03/25, variabel	8.995.625	0,46
10.833.000	USD	Commonwealth Re 08/07/25, variabel	10.817.292	0,55	14.250.000	USD	Matterhorn Re 08/12/25, variabel	13.804.688	0,70
199	USD	Eden Re II 22/03/23, ZCP	1.834	-	7.600.000	USD	Matterhorn Re 25/01/27, variabel	7.296.000	0,37
1.637.314	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP	1.252.545	0,06	9.500.000	USD	Matterhorn Re Series A 24/03/25, variabel	9.143.750	0,46
3.419.200	USD	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP	2.612.268	0,13	13.118.000	USD	Matterhorn Re Series A 07/12/22, variabel	13.003.218	0,66
16.300.000	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	13.843.590	0,70	14.250.000	USD	Matterhorn Re Series B 07/12/22, variabel	14.196.563	0,72
11.000.000	USD	Everglades Re II 04/05/23, variabel	9.625.000	0,49	20.144.000	USD	Merna Reinsurance II 05/04/24, variabel	19.690.760	1,00
8.750.000	USD	Everglades Re II 19/05/25, variabel	7.656.250	0,39	12.000.000	USD	Merna Reinsurance II Series 2 07/07/25, variabel	7.200.000	0,36
31.404.000	USD	FloodSmart Re Series A 01/03/24, variabel	7.851.000	0,40	19.000.000	USD	Merna Reinsurance II Series 3 07/07/25, variabel	18.833.750	0,95
5.625.000	USD	FloodSmart Re Series B 01/03/24, variabel	562.500	0,03	6.000.000	USD	MetroCat Re 08/05/23, variabel	5.887.500	0,30
21.020.000	USD	FloodSmart Re Series A 25/02/25, variabel	9.459.000	0,48	23.750.000	USD	Mona Lisa Re 08/07/25, variabel	23.405.624	1,18
9.250.000	USD	FloodSmart Re Series B 25/02/25, variabel	1.850.000	0,09	9.750.000	USD	Mystic Re IV 08/01/25, variabel	9.445.313	0,48
2.250.000	USD	FloodSmart Re Series C 25/02/25, variabel	135.000	0,01	16.952.000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	16.152.713	0,82
4.520.000	USD	Frontline Re 06/07/26, variabel	2.938.000	0,15	34.150.000	USD	Nakama Re Series 1 13/04/23, variabel	33.791.424	1,71
4.000.000	USD	Golden State Re II 08/01/23, variabel	4.001.800	0,20	12.200.000	USD	Nakama Re Series 2 13/04/23, variabel	12.071.900	0,61
2.500.000	USD	Herbie Re 06/01/23, variabel	1.437.500	0,07	6.974.000	USD	Northshore Re II 08/07/25, variabel	6.902.517	0,35
7.000.000	USD	Herbie Re 08/07/24, variabel	6.370.000	0,32	7.500.000	USD	Pelican IV Re Series A 07/05/24, variabel	4.125	-
3.833.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	3.353.875	0,17					

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Wahrung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregeltten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Wahrung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregeltten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
4.750.000	USD	Pelican IV Re Series B 07/05/24, variabel	24.225	-	2.250.000	USD	Residential Reinsurance 2019 Series 13 06/06/23, variabel	2.235.938	0,11
23.250.000	USD	Phoenician Re 14/12/24, variabel	22.197.937	1,12	6.154.000	USD	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variabel	6.046.305	0,31
19.872.000	USD	Sakura Re Series A 07/04/25, variabel	19.226.160	0,97	5.484.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variabel	5.340.045	0,27
17.292.000	USD	Sakura Re Series B 07/04/25, variabel	16.781.886	0,85	5.000.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variabel	4.918.750	0,25
2.750.000	USD	Sierra Series A 28/12/22, variabel	2.725.938	0,14	4.250.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 11 06/06/25, variabel	3.963.125	0,20
2.750.000	USD	Sierra Series B 28/12/22, variabel	2.725.938	0,14	5.535.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 12 06/06/25, variabel	5.233.343	0,26
14.500.000	USD	Sierra Series A 31/01/24, variabel	14.086.750	0,71	4.642.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 13 06/06/25, variabel	4.402.937	0,22
3.500.000	USD	Sierra Series B 31/01/24, variabel	3.400.250	0,17	6.500.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 14 06/06/25, variabel	6.191.250	0,31
3.750.000	USD	Topanga Re 08/01/26, variabel	3.591.563	0,18	14.416.667	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 2 06/12/25, variabel	13.605.728	0,69
20.000.000	USD	Torrey Pines Re Series A 07/06/24, variabel	19.230.000	0,97	4.310.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 3 06/12/25, variabel	4.089.113	0,21
19.250.000	USD	Torrey Pines Re Series B 07/06/24, variabel	18.701.375	0,95	6.300.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 13 06/06/26, variabel	6.191.325	0,31
9.500.000	USD	Torrey Pines Re Series A 06/06/25, variabel	9.241.125	0,47	2.950.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 14 06/06/26, variabel	2.899.113	0,15
5.000.000	USD	Torrey Pines Re Series B 06/06/25, variabel	4.863.750	0,25	5.250.000	USD	Vitality Re X Series A 10/01/23, variabel	5.242.388	0,27
22.982.000	USD	Ursa Re 10/12/22, variabel	22.562.578	1,14	4.750.000	USD	Vitality Re X Series B 10/01/23, variabel	4.729.813	0,24
41.725.000	USD	Ursa Re II Series AA 07/12/23, variabel	40.577.562	2,05	9.117.000	USD	Vitality Re XI Series A 09/01/24, variabel	8.942.409	0,45
11.500.000	USD	Ursa Re II Series D 07/12/23, variabel	11.057.250	0,56	3.500.000	USD	Vitality Re XI Series B 09/01/24, variabel	3.433.325	0,17
21.366.000	USD	Ursa Re II 06/12/24, variabel	20.415.213	1,03	12.044.000	USD	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variabel	11.806.131	0,60
9.000.000	USD	Ursa Re II Series A 16/06/25, variabel	8.754.750	0,44	6.000.000	USD	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variabel	5.916.900	0,30
6.250.000	USD	Ursa Re II Series E 16/06/25, variabel	6.079.688	0,31	8.148.000	USD	Vitality Re XIII Series A 06/01/26, variabel	7.997.669	0,40
		Kaimaninseln	160.528.873	8,12	4.000.000	USD	Vitality Re XIII Series B 06/01/26, variabel	3.962.200	0,20
1.092.500	USD	Caelus Re V Series B 05/06/24, variabel	928.625	0,05			Hongkong	6.477.665	0,33
6.600.000	USD	Caelus Re V Series C 05/06/24, variabel	660.000	0,03	6.558.000	USD	Black Kite Re 09/06/25, variabel	6.477.665	0,33
132.536	USD	Caelus Re V Series D 05/06/24, variabel	2.498	-					
6.850.000	USD	Caelus Re VI 07/06/23, variabel	6.647.925	0,34					
13.050.000	USD	Caelus Re VI 07/06/24, variabel	12.632.399	0,64					
11.975.000	USD	Residential Reinsurance 2018 06/12/22, variabel	11.828.306	0,60					
7.062.000	USD	Residential Reinsurance 2019 06/12/23, variabel	6.841.313	0,35					
4.000.000	USD	Residential Reinsurance 2019 Series 12 06/06/23, variabel	3.840.000	0,19					

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Irland			70.160.479	3,55
19.925.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variabel	19.202.719	0,97
20.000.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity 06/06/25, variabel	19.635.000	0,99
20.000.000	EUR	Lion III Re DAC 16/07/25, variabel	19.319.725	0,98
4.250.000	EUR	Orange Capital Re DAC 17/01/25, variabel	4.061.082	0,21
8.269.000	EUR	Windmill II Re DAC 05/07/24, variabel	7.941.953	0,40
Singapur			46.888.785	2,37
4.000.000	USD	Astro Re 08/07/25, variabel	240.000	0,01
9.250.000	USD	Catahoula II Re Series A 16/06/25, variabel	9.219.937	0,47
5.250.000	USD	Catahoula II Re Series B 16/06/25, variabel	5.238.188	0,26
6.000.000	USD	Catahoula Re 09/05/23, variabel	22.500	-
6.315.000	USD	Cosaint Re 03/04/24, variabel	947.250	0,05
11.466.000	USD	First Coast Re III 07/04/25, variabel	8.599.500	0,44
6.957.000	EUR	Hexagon III Re 15/01/26, variabel	5.284.111	0,27
5.000.000	EUR	Hexagon III Re Series CAT 15/01/26, variabel	4.630.736	0,23
3.000.000	USD	Phoenix 2 Re 04/01/28, ZCP	3.058.800	0,15
250.000	USD	Phoenix 2 Re Series 22-1 04/01/28, ZCP	273.325	0,01
5.000.000	USD	Umigame Re Series A1 07/04/25, variabel	4.863.750	0,25
2.750.000	USD	Umigame Re Series A2 07/04/25, variabel	2.675.063	0,14
1.875.000	USD	Umigame Re Series B1 07/04/25, variabel	1.835.625	0,09
Vereinigtes Königreich			28.939.313	1,46
29.750.000	USD	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variabel	28.939.313	1,46
Vereinigte Staaten			31.707.612	1,60
5.500.000	USD	Gateway Re 12/05/25, variabel	5.465.625	0,28
6.250.000	USD	Logistics Re 20/12/24, variabel	6.144.688	0,31
51.919	USD	Putnam Re 07/06/24, variabel	27.257	-
1.500.000	USD	Security First Managers 25/02/25, variabel	1.500.000	0,08

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
15.403.000	USD	Vista Re 21/05/24, variabel	14.979.417	0,75
3.750.000	USD	Vista Re 21/05/25, variabel	3.590.625	0,18
Summe Anleihen			1.063.981.639	53,83
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			1.063.981.639	53,83

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Bermuda				
8.898.000	USD	Matterhorn Re 07/12/22, ZCP	8.553.203	0,43
Vereinigte Staaten				
13.907.978	USD	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5,96%	13.351.659	0,67
2.400	USD	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP	-	-
2.174.333	USD	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP	1.717.723	0,09
Summe Anleihen			23.622.585	1,19
Summe sonstige Wertpapiere			23.622.585	1,19
Summe Kapitalanlagen			1.908.633.802	96,55
Sonstiges Nettovermögen			68.219.909	3,45
Nettoinventarwert			1.976.853.711	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Israel			4.630.704	2,11
24.600	USD	Nice	4.630.704	2,11
Vereinigte Staaten			126.450.181	57,60
73.892	USD	Alphabet	7.067.770	3,22
36.182	USD	Amazon.com	4.088.566	1,86
226.000	USD	Cargurus	3.202.420	1,46
855.986	USD	CCC Intelligent Solutions Holdings	7.789.473	3,55
103.304	USD	Comcast	3.029.906	1,38
98.999	USD	Fiserv	9.263.336	4,22
149.503	USD	Five9	11.209.735	5,11
13.128	USD	Intuit	5.084.737	2,32
221.816	USD	Marvell Technology	9.518.125	4,34
239.033	USD	Momentive Global	1.388.782	0,63
28.088	USD	Netflix	6.613.039	3,01
220.381	USD	New Relic	12.645.461	5,76
302.163	USD	News	4.565.683	2,08
103.017	USD	PayPal Holdings	8.866.673	4,04
122.243	USD	Pinterest	2.848.262	1,30
57.391	USD	Seagate Technology Holdings	3.054.923	1,39
59.400	USD	T-Mobile US	7.969.698	3,63
189.000	USD	Toast	3.160.080	1,44
131.712	USD	TripAdvisor	2.908.201	1,32
180.495	USD	Warner Music Group	4.189.289	1,91
83.222	USD	Zendesk	6.333.194	2,88
57.771	USD	Zillow Group	1.652.828	0,75
Summe Aktien			131.080.885	59,71
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			131.080.885	59,71
Summe Kapitalanlagen			131.080.885	59,71
Sonstiges Nettovermögen			88.454.147	40,29
Nettoinventarwert			219.535.032	100,00

Schroder GAIA Egerton Equity

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Kanada			133.461.525	22,67
441.954	CAD	Canadian National Railway	48.700.756	8,27
770.971	CAD	Canadian Pacific Railway	52.512.668	8,92
1.107.926	CAD	Cenovus Energy	17.366.175	2,95
479.613	USD	Teck Resources	14.881.926	2,53
Frankreich			769.284	0,13
8.183	EUR	Safran	769.284	0,13
Norwegen			7.487.127	1,27
1.357.872	NOK	Norsk Hydro	7.487.127	1,27
Taiwan			8.687.928	1,48
124.192	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	8.687.928	1,48
Vereinigtes Königreich			11.074.082	1,88
40.258	USD	Linde	11.074.082	1,88
Vereinigte Staaten			351.884.605	59,79
390.203	USD	Alphabet	38.281.739	6,50
140.060	USD	Amazon.com	16.148.952	2,74
155.152	USD	Analog Devices	22.058.956	3,75
227.818	USD	Applied Materials	19.045.078	3,24
84.366	USD	Blackstone Mortgage Trust	2.009.186	0,34
7.966	USD	Booking Holdings	13.356.268	2,27
360.011	USD	Charles Schwab	26.400.684	4,49
687.719	USD	CSX	18.693.775	3,18
175.661	USD	DR Horton	12.071.597	2,05
29.248	USD	First Citizens BancShares	23.798.003	4,04
176.135	USD	KKR	7.727.978	1,31
98.617	USD	Lowe's	18.898.279	3,21
81.022	USD	LPL Financial Holdings	18.062.024	3,07
84.662	USD	Mastercard	24.562.821	4,17
177.780	USD	Microsoft	42.247.805	7,19
44.361	USD	UnitedHealth Group	22.860.139	3,88
141.567	USD	Visa	25.661.321	4,36
Summe Aktien			513.364.551	87,22
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			513.364.551	87,22
Summe Kapitalanlagen			513.364.551	87,22
Sonstiges Nettovermögen			75.233.221	12,78
Nettoinventarwert			588.597.772	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Helix

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Belgien				
30.098	EUR	Azelis Group	672.270	0,14
Brasilien				
			16.061.309	3,28
639.100	BRL	B3 - Brasil Bolsa Balcao	1.541.965	0,31
276.607	BRL	BR Malls Participacoes	482.247	0,10
126.023	BRL	CCR	291.942	0,06
1.287.800	BRL	Cia Brasileira de Alumínio	2.723.764	0,56
1.298.885	BRL	Itausa	2.336.569	0,48
337.973	BRL	Lojas Renner	1.740.212	0,35
279.100	BRL	Petroleo Brasileiro	1.537.698	0,31
548.600	BRL	Raia Drogasil	2.305.421	0,47
1.388.700	BRL	TIM	3.101.491	0,64
Kanada				
			373	-
256	CAD	Loop Energy	373	-
Chile				
			2.175.719	0,44
1.463.812	CLP	Aguas Andinas	287.189	0,06
291.732	CLP	Empresas Copec	1.888.530	0,38
China				
			37.645.057	7,68
168.200	HKD	Baozun	324.405	0,07
319.500	HKD	Budweiser Brewing	836.409	0,17
426.000	HKD	China Mengniu Dairy	1.690.455	0,34
48.300	CNH	China Tourism Group Duty Free	1.343.144	0,27
5.000	HKD	China Tourism Group Duty Free	125.670	0,03
43.098	CNH	Contemporary Amperex Technology	2.423.509	0,49
36.270	CNH	Foshan Haitian Flavouring & Food	421.352	0,09
52.310	CNH	Gongniu Group	1.030.916	0,21
6.552	USD	H World Group	219.754	0,04
304.490	CNH	Han's Laser Technology Industry Group	1.113.037	0,23
140.916	CNH	Hongfa Technology	688.456	0,14
486.975	CNH	Huafon Chemical	446.049	0,09
101.488	CNH	Jiangsu Hengli Hydraulic	644.590	0,13
190.320	CNH	Jiangsu Hengrui Medicine	937.031	0,19
7.544	USD	JinkoSolar Holding	417.862	0,09
7.000	CNH	Kweichow Moutai	1.838.578	0,37
643.112	CNH	LONGi Green Energy Technology	4.321.903	0,88
725.449	CNH	Midea Group	5.017.694	1,03
215.660	CNH	NARI Technology	752.329	0,15

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
33.285	CNH	Oppein Home Group	530.429	0,11
140.400	CNH	Ping An Insurance Group of China	818.868	0,17
822.400	CNH	Sany Heavy Industry	1.601.160	0,33
228.700	CNH	SF Holding	1.514.797	0,31
117.436	CNH	Shanghai Kelai Mechatronics Engineering	290.742	0,06
609.183	CNH	Shenzhen Inovance Technology	4.914.206	1,00
73.462	CNH	Thunder Software Technology	1.087.944	0,22
407.820	CNH	Toly Bread	763.681	0,16
46.800	CNH	Wanhua Chemical Group	604.599	0,12
14.300	CNH	Yunnan Energy New Material	349.258	0,07
80.290	CNH	Zhejiang Jiechang Linear Motion Technology	292.367	0,06
223.500	HKD	Zylox-Tonbridge Medical Technology	283.863	0,06
			499.425	0,10
Ägypten				
448.317	USD	Commercial International Bank Egypt	499.425	0,10
			807.917	0,16
Georgien				
43.390	GBP	TBC Bank Group	807.917	0,16
			2.752.363	0,56
Deutschland				
34.055	EUR	Dr Ing hc F Porsche	2.752.363	0,56
			2.284.107	0,47
Griechenland				
373.350	EUR	Alpha Services & Holdings	294.796	0,06
671.062	EUR	National Bank of Greece	1.989.311	0,41
			2.000.637	0,41
Ungarn				
116.757	HUF	Richter Gedeon	2.000.637	0,41
			6.011.732	1,23
Indonesien				
541.100	IDR	Bank Central Asia	303.819	0,06
8.053.600	IDR	Bank Mandiri Persero	4.984.743	1,02
3.247.300	IDR	Mitra Keluarga Karyasehat	618.432	0,13
357.600	IDR	Telkom Indonesia Persero	104.738	0,02
			4.248.363	0,87
Italien				
86.699	EUR	Ariston Holding	739.781	0,15
67.344	EUR	FincoBank Banca Finco	840.173	0,17
1.418.143	EUR	Intesa Sanpaolo	2.365.672	0,49
10.433	EUR	Prysmian	302.737	0,06
			1.888.024	0,39
Kasachstan				
161.612	USD	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	1.616.120	0,33

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
4.688	USD	Kaspi.KZ	271.904	0,06
Mexiko			670.830	0,14
61.626	USD	Banco Santander Mexico Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	314.293	0,06
37.849	USD	Vista Energy	356.537	0,08
Peru			137.030	0,03
6.831	USD	Intercorp Financial Services	137.030	0,03
Philippinen			3.511.812	0,72
893.020	PHP	Ayala Land	348.068	0,07
555.850	PHP	International Container Terminal Services	1.484.795	0,30
3.080.700	PHP	Wilcon Depot	1.678.949	0,35
Polen			2.235.839	0,46
3.081	PLN	Dino Polska	188.391	0,04
38.930	PLN	Grupa Pracuj	299.522	0,06
5.374	PLN	KRUK	256.786	0,05
76.698	PLN	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	359.653	0,07
28.382	PLN	Santander Bank Polska	1.131.487	0,24
Katar			1.824.670	0,37
1.620.730	QAR	Qatar Gas Transport	1.824.670	0,37
Russland			-	-
262.653	USD	Fix Price Group	-	-
62.454	USD	Softline Holding	-	-
Slowenien			2.324.158	0,47
228.119	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	2.324.158	0,47
Südafrika			1.481.842	0,30
17.149	ZAR	Capitec Bank Holdings	1.481.842	0,30
Südkorea			33.222.826	6,78
2.800	KRW	Hana Financial Group	69.379	0,01
11.165	KRW	Hyundai Motor	1.377.383	0,28
2.313	KRW	KB Financial Group	70.649	0,01
5.450	KRW	Korea Zinc	2.266.548	0,46
7.382	KRW	LG Chem	2.765.606	0,56
220	KRW	LG Chem – Preference	38.750	0,01
6.970	KRW	LG Energy Solution	2.077.798	0,42
2.593	KRW	LG H&H	1.147.249	0,23
95.415	KRW	LG Uplus	716.930	0,15
7.519	KRW	NAVER	1.016.933	0,21
400.719	KRW	Samsung Electronics	14.872.565	3,04
96.464	KRW	Samsung Electronics – Preference	3.162.201	0,65

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
19.348	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	2.488.315	0,51
2.506	KRW	Samsung SDI	956.368	0,20
1.644	KRW	SK Hynix	95.489	0,02
2.835	KRW	SK Telecom	100.663	0,02
Schweiz			1.456.688	0,30
234.018	ZAR	Mediclinic International	1.280.995	0,26
9.933	GBP	Wizz Air Holdings	175.693	0,04
Taiwan			49.740.270	10,13
144.792	TWD	Advantech	1.338.513	0,27
361.000	TWD	ASE Technology Holding	910.772	0,19
5.000	TWD	ASMedia Technology	104.570	0,02
234.000	TWD	Chroma ATE	1.326.656	0,27
118.000	TWD	CTBC Financial Holding	73.776	0,02
31.250	TWD	Dadi Early-Childhood Education Group	90.849	0,02
20.000	TWD	Delta Electronics	159.375	0,03
163.000	TWD	Eclat Textile	2.012.536	0,41
348.000	TWD	Getac Holdings	463.101	0,09
77.000	TWD	Giant Manufacturing	498.394	0,10
555.000	TWD	Hon Hai Precision Industry	1.783.048	0,36
210.000	TWD	MediaTek	3.644.524	0,74
182.000	TWD	Merida Industry	1.034.710	0,21
233.000	TWD	Nien Made Enterprise	1.845.712	0,38
125.000	TWD	Novatek Microelectronics	862.232	0,18
138.750	TWD	Sporton International	1.031.371	0,21
201.000	TWD	Taiwan Mobile	605.235	0,12
2.157.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	28.670.320	5,85
55.000	TWD	Uni-President Enterprises	116.586	0,02
1.294.000	TWD	United Microelectronics	1.457.070	0,30
29.900	TWD	Universal Vision Biotechnology	266.048	0,05
32.650	TWD	Voltronic Power Technology	1.444.872	0,29
Thailand			3.511.749	0,72
429.300	THB	Kasikornbank	1.638.897	0,33
472.400	THB	Kasikornbank-XDR	1.803.436	0,38
294.200	THB	Land & Houses	69.416	0,01
Vereinigte Arabische Emirate			7.118.528	1,45
4.623.063	AED	Emaar Development	5.777.177	1,17
240.689	AED	Emaar Properties	379.409	0,08
274.962	AED	Emirates NBD Bank	961.942	0,20

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Vereinigtes Königreich			20.127.394	4,10
485.217	GBP	Beazley	3.054.892	0,61
313.078	GBP	Bytes Technology Group	1.467.155	0,30
67.338	EUR	CNH Industrial	767.204	0,16
1.133.322	GBP	Harworth Group	1.530.804	0,31
633.457	GBP	Inspecc Group	954.623	0,19
1.039.222	GBP	NatWest Group	2.620.628	0,53
361.349	GBP	OSB Group	1.695.784	0,35
219.480	PLN	Pepco Group	1.328.701	0,27
1.274.357	GBP	Premier Foods	1.355.704	0,28
393.119	GBP	Team17 Group	1.632.480	0,33
1.140.761	GBP	TT Electronics	1.792.992	0,37
437.457	GBP	Tyman	961.040	0,20
128.310	GBP	Watches of Switzerland Group	965.387	0,20
Vereinigte Staaten			356.287	0,07
632	USD	Mastercard	179.703	0,03
994	USD	Visa	176.584	0,04
Vietnam			1.437.820	0,29
474.600	VND	Vietnam Dairy Products	1.437.820	0,29
Summe Aktien			206.205.039	42,06
Anleihen				
Angola			392.058	0,08
340.000	USD	Angolan Government International Bond 26/11/29, 8.00%	256.736	0,05
200.000	USD	Angolan Government International Bond 26/11/49, 9.13%	135.322	0,03
Argentinien			176.906	0,04
423.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/01/38, 3.88%	100.361	0,02
354.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/41, 3.50%	76.545	0,02
Brasilien			1.337.329	0,26
3.136.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10.00%	548.481	0,11
4.590.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/31, 10.00%	788.848	0,15
Burkina Faso			303.544	0,06
380.000	USD	Endeavour Mining 14/10/26, 5.00%	303.544	0,06

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
China			108.025	0,02
290.000	USD	Country Garden Holdings 08/04/26, 7.25%	108.025	0,02
Tschechische Republik			193.248	0,04
8.490.000	CZK	Czech Republic Government Bond 24/04/40, 1.50%	193.248	0,04
Ecuador			277.440	0,06
630.319	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/35, 2.50%	209.015	0,05
230.000	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/40, 1,50 %	68.425	0,01
El Salvador			92.627	0,02
250.000	USD	El Salvador Government International Bond 28/02/29, 8.63%	92.627	0,02
Elfenbeinküste			426.690	0,09
470.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5.88%	334.352	0,07
140.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 30/01/32, 4.88%	92.338	0,02
Mexiko			1.067.004	0,21
4.300.000	MXN	Mexican Bonos 18/11/38, 8.50%	193.073	0,04
3.310.000	MXN	Mexican Bonos 13/11/42, 7.75%	136.678	0,03
8.870.000	MXN	Mexican Bonos 07/11/47, 8.00%	372.319	0,07
3.800.000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/09/24, 7.19%	171.147	0,03
4.600.000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/11/26, 7.47%	193.787	0,04
Nigeria			251.433	0,05
350.000	USD	Nigeria Government International Bond 24/03/29, 8.38%	251.433	0,05
Peru			319.863	0,07
1.540.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/32, 6.15%	319.863	0,07
Polen			369.968	0,08
1.350.000	PLN	Republic of Poland Government Bond 25/10/30, 1.25%	176.766	0,04
1.500.000	PLN	Republic of Poland Government Bond 25/04/32, 1.75%	193.202	0,04
Russland			170.961	0,03
38.000.000	RUB	Russian Federal Bond – OFZ 23/03/33, 7.70%	170.961	0,03

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Senegal				
320.000	EUR	Senegal Government International Bond 08/06/37, 5.38%	189.428	0,04
Singapur				
370.000	USD	Puma International Financing 24/01/26, 5.00%	326.328	0,07
Südafrika				
6.690.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	304.563	0,06
4.819.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/40, 9.00%	211.569	0,04
Türkei				
470.000	USD	Pegasus Hava Tasimaciligi 30/04/26, 9.25%	431.836	0,09
Ukraine				
3.000.000	UAH	Ukraine Government Bond 22/05/24, 9.99%	47.256	0,01
6.460.000	UAH	Ukraine Government Bond 26/02/25, 15.84%	106.980	0,02
8.190.000	UAH	Ukraine Government Bond 26/05/27, 9.79%	88.789	0,02
330.000	USD	VF Ukraine PAT via VFU Funding 11/02/25, 6.20%	179.091	0,04
Summe Anleihen			7.372.936	1,50
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			213.577.975	43,56

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen				
Brasilien				
250.000	USD	MC Brazil Downstream Trading 30/06/31, 7.25%	188.533	0,04
Chile				
450.000	USD	Kenbourne Invest 22/01/28, 4.70%	342.920	0,07
Vereinigtes Königreich				
525.000	USD	Petrofac 15/11/26, 9.75%	404.759	0,08
Vereinigte Staaten				
20.000.000	USD	United States Treasury Bill 06/10/22, ZCP	19.993.748	4,09
20.000.000	USD	United States Treasury Bill 13/10/22, ZCP	19.984.997	4,08

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
20.000.000	USD	United States Treasury Bill 20/10/22, ZCP	19.976.171	4,07
20.000.000	USD	United States Treasury Bill 27/10/22, ZCP	19.967.421	4,07
5.000.000	USD	United States Treasury Bill 03/11/22, ZCP	4.988.833	1,02
10.000.000	USD	United States Treasury Bill 10/11/22, ZCP	9.971.822	2,03
20.000.000	USD	United States Treasury Bill 17/11/22, ZCP	19.931.119	4,06
20.000.000	USD	United States Treasury Bill 08/12/22, ZCP	19.884.060	4,05
20.000.000	USD	United States Treasury Bill 12/01/23, ZCP	19.814.371	4,04
15.000.000	USD	United States Treasury Bill 19/01/23, ZCP	14.847.352	3,03
Summe Anleihen			170.296.106	34,73
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			170.296.106	34,73

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Luxemburg				
45.213	USD	Schroder ISF - China A	6.157.648	1,26
33.994	USD	Schroder ISF Indian Equity	11.263.807	2,29
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen			17.421.455	3,55
Summe Kapitalanlagen			401.295.536	81,84
Sonstiges Nettovermögen			89.068.179	18,16
Nettoinventarwert			490.363.715	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Argentinien			957.406	2,02
80.000	USD	Genneia 02/09/27, 8.75%	73.999	0,16
250.000	USD	Transportadora de Gas del Sur 02/05/25, 6.75%	214.911	0,45
775.000	USD	YPF 27/06/29, 8.50%	468.117	0,99
250.000	USD	YPF Energia Electrica 25/07/26, 10.00%	200.379	0,42
Belgien			82.319	0,17
100.000	EUR	Telenet Finance Luxembourg Notes 01/03/28, 3.50%	82.319	0,17
Kanada			79.572	0,17
100.000	EUR	Primo Water Holdings 31/10/28, 3.88%	79.572	0,17
China			111.062	0,23
200.000	USD	Shimao Group Holdings 15/07/26, 5.60%	25.314	0,05
200.000	USD	Shimao Group Holdings 13/07/30, 4.60%	24.435	0,05
200.000	USD	Sino-Ocean Land Treasure IV 05/05/26, 3.25%	61.313	0,13
Frankreich			721.537	1,52
13.425	EUR	Accor 07/12/27, 0.70%	9.631	0,02
100.000	EUR	Afflelou 19/05/26, 4.25%	86.244	0,18
100.000	EUR	Altice France 15/07/29, 4.00%	74.507	0,16
100.000	EUR	Banijay Entertainment 01/03/25, 3.50%	91.150	0,19
110.000	EUR	CAB Selas 01/02/28, 3.38%	82.770	0,17
100.000	EUR	Chrome Bidco 31/05/28, 3.50%	78.085	0,16
100.000	EUR	Iliad Holding 15/10/28, 5.63%	84.347	0,18
100.000	EUR	Loxam 15/07/26, 3.75%	83.270	0,18
110.000	EUR	Parts Europe 16/07/25, 6.50%	107.860	0,23
27.591	EUR	Worldline 30/07/25, ZCP	23.673	0,05
Deutschland			257.659	0,54
100.000	EUR	Gruenthal 15/05/28, 4.13%	81.744	0,17
100.000	EUR	Nidda BondCo 30/09/25, 5.00%	85.892	0,18
100.000	EUR	Renk 15/07/25, 5.75%	90.023	0,19
Indien			303.803	0,64
200.000	USD	Vedanta Resources Finance II 21/01/24, 13.88%	167.448	0,35

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
200.000	USD	Vedanta Resources Finance II 11/03/25, 8.95%	136.355	0,29
Irland			161.274	0,34
100.000	EUR	eircom Finance DAC 15/02/27, 2.63%	83.108	0,18
100.000	EUR	Rockford Tower Europe CLO DAC 20/04/34, variabel	78.166	0,16
Italien			541.825	1,14
100.000	EUR	Castor 15/02/29, variabel	89.763	0,19
100.000	EUR	Centurion Bidco 30/09/26, 5.88%	86.303	0,18
100.000	EUR	Gamma Bidco 15/07/25, 5.13%	88.464	0,19
100.000	EUR	Mooney Group 17/12/26, variabel	92.883	0,20
110.000	EUR	TeamSystem 15/02/28, 3.50%	89.450	0,19
100.000	EUR	Telecom Italia 11/04/24, 4.00%	94.962	0,19
Luxemburg			244.037	0,51
100.000	EUR	Altice Financing 15/01/28, 3.00%	74.086	0,16
100.000	EUR	Matterhorn Telecom 15/11/27, 4.00%	86.146	0,17
100.000	EUR	Summer BC Holdco B 31/10/26, 5.75%	83.805	0,18
Niederlande			666.326	1,40
100.000	EUR	Lincoln Financing 01/04/24, 3.63%	95.006	0,20
110.000	EUR	Q-Park Holding I 01/03/26, variabel	93.966	0,20
110.000	EUR	TMNL Holding 15/01/29, 3.75%	86.511	0,18
100.000	EUR	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 3.75%	88.572	0,19
175.000	USD	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 5.50%	156.755	0,33
100.000	EUR	UPC Holding 15/06/29, 3.88%	77.241	0,16
100.000	EUR	Ziggo Bond 28/02/30, 3.38%	68.275	0,14
Spanien			458.412	0,96
139.000	USD	Banco Santander 18/08/25, 5.15%	134.976	0,28
100.000	EUR	Cirsa Finance International 15/03/27, 4.50%	78.655	0,17
100.000	EUR	Grifols Escrow Issuer 15/10/28, 3.88%	72.773	0,15
110.000	EUR	Lorca Telecom Bondco 18/09/27, 4.00%	94.104	0,20

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (cont)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	77.904	0,16
Schweden			125.905	0,26
100.000	EUR	Samhallsbyggnadsbola- get i Norden perpetual, variabel	41.339	0,09
100.000	EUR	Verisure Holding 15/07/26, 3.88%	84.566	0,17
Vereinigtes Königreich			736.959	1,55
100.000	GBP	AA Bond 31/01/26, 6.50%	94.348	0,20
100.000	EUR	EG Global Finance 30/10/25, 6.25%	85.369	0,18
100.000	GBP	Hurricane Finance 15/10/25, 8.00%	106.819	0,22
100.000	EUR	Motion Finco 15/05/25, 7.00%	97.246	0,20
100.000	GBP	Pinewood Finance 15/11/27, 3.63%	90.305	0,19
100.000	GBP	Premier Foods Finance 15/10/26, 3.50%	89.517	0,19
100.000	GBP	Thames Water Kemble Finance 19/05/26, 4.63%	93.215	0,20
110.000	EUR	Vodafone Group 27/08/80, variabel	80.140	0,17
Vereinigte Staaten			2.702.131	5,70
162.000	USD	American Tower 15/03/25, 2.40%	150.600	0,32
110.000	EUR	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 2.13%	83.165	0,18
125.000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/27, 5.25%	77.792	0,16
100.000	EUR	Avantor Funding 15/07/28, 3.88%	84.998	0,18
155.000	USD	Boeing 01/05/25, 4.88%	151.576	0,32
150.000	USD	Celanese US Holdings 05/07/24, 5.90%	148.074	0,31
13.000	USD	Cloudflare 15/08/26, ZCP	10.166	0,02
100.000	EUR	Dana Financing Luxembourg 15/07/29, 3.00%	71.094	0,15
100.000	EUR	Energizer Gamma Acquisition 30/06/29, 3.50%	70.490	0,15
161.000	USD	Energy Transfer 15/03/25, 4.05%	154.547	0,33
100.000	USD	Ford Motor Credit 17/11/23, 3.37%	96.872	0,20
153.000	USD	General Motors Financial 07/04/25, 3.80%	145.784	0,31
156.000	USD	HCA 15/03/24, 5.00%	155.066	0,33
85.000	USD	MGIC Investment 15/08/28, 5.25%	76.112	0,16

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
55.000	USD	Oceaneering International 01/02/28, 6.00%	43.701	0,09
263.000	USD	Olin 01/08/29, 5.63%	233.951	0,50
165.000	USD	Oracle 01/04/25, 2.50%	153.916	0,32
110.000	EUR	Silgan Holdings 01/06/28, 2.25%	86.854	0,18
110.000	EUR	Standard Industries 21/11/26, 2.25%	85.136	0,18
171.000	USD	Synchrony Bank 22/08/25, 5.40%	166.901	0,35
260.000	USD	TransDigm 15/11/27, 5.50%	226.712	0,48
87.000	USD	VMware 15/05/25, 4.50%	85.081	0,18
149.000	USD	Zimmer Biomet Holdings 01/04/25, 3.55%	143.543	0,30
Summe Anleihen			8.150.227	17,15
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			8.150.227	17,15

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Argentinien			503.942	1,06
150.000	USD	Pampa Energia 15/04/29, 9.13%	126.203	0,27
400.000	USD	Telecom Argentina 06/08/25, 8.50%	377.739	0,79
Australien			1.086.983	2,29
125.000	USD	Mineral Resources 01/05/30, 8.50%	121.074	0,25
262.000	AUD	Ruby Bond Trust 12/03/53, variabel	161.806	0,34
272.000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2021-1 12/03/53, variabel	168.261	0,35
500.000	AUD	Ruby Bond Trust 14/01/54, variabel	317.977	0,68
500.000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2022-1 14/01/54, variabel	317.865	0,67
Bermuda			756.701	1,59
400.000	USD	Eagle Re 25/11/28, variabel	395.435	0,83
400.000	USD	Home Re 25/01/34, variabel	361.266	0,76
Brasilien			123.613	0,26
200.000	USD	Azul Investments 15/06/26, 7.25%	123.613	0,26

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (cont)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Kanada					Deutschland				
			1.276.320	2,69				116.587	0,25
78.000	USD	Bank of Montreal 14/09/24, 4.25%	76.841	0,16	145.000	USD	Mercer International 01/02/29, 5.13%	116.587	0,25
125.000	USD	Bombardier 15/06/26, 7.13%	114.823	0,24	Hongkong				
50.000	USD	Bombardier 15/03/25, 7.50%	49.094	0,10	150.000	USD	Seaspan 01/08/29, 5.50%	115.869	0,24
80.000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce 04/08/25, 3.95%	77.325	0,16	Irland				
300.000	USD	Cascades 15/01/28, 5.38%	254.401	0,54	375.000	EUR	Ares European CLO XII DAC 20/04/32, variabel	305.282	0,64
180.000	USD	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 23/08/25, 4.40%	174.221	0,37	321.530	EUR	Arrow CMBS 2018 DAC 22/05/30, variabel	307.426	0,65
105.000	USD	GFL Environmental 01/08/28, 4.00%	88.149	0,19	750.000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 15/04/32, variabel	622.241	1,30
200.000	USD	Intelligent Packaging 15/09/28, 6.00%	159.558	0,34	750.000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 19/10/34, variabel	609.301	1,27
130.000	USD	Precision Drilling 15/01/26, 7.13%	122.119	0,26	250.000	EUR	BBAM European CLO I DAC 22/07/34, variabel	193.530	0,41
19.000	USD	Shopify 01/11/25, 0.13%	15.628	0,03	300.000	EUR	Bluemountain Fuji Eur CLO IV DAC 25/02/34, variabel	231.993	0,49
100.000	USD	Strathcona Resources 01/08/26, 6.88%	84.995	0,18	104.000	EUR	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	93.409	0,20
60.000	USD	Toronto-Dominion Bank 13/09/24, 4.29%	59.166	0,12	100.000	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	102.618	0,22
Kaimaninseln					109.000	GBP	Frost CMBS DAC* 20/11/33, variabel	109.101	0,23
			3.353.402	7,06	375.000	EUR	Goldentree Loan Management CLO 4 DAC 20/07/34, variabel	294.689	0,62
250.000	USD	ACAM 17/11/34, variabel	236.088	0,50	177.206	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 17/08/33, variabel	157.401	0,33
250.000	USD	ACAM Series 2019-FL1 17/11/34, variabel	241.828	0,51	558.497	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance Series 1A 17/08/33, variabel	502.198	1,06
375.000	USD	ICG US CLO 16/01/33, variabel	301.643	0,63	375.000	EUR	Palmer Square European CLO DAC 15/04/35, variabel	289.086	0,61
375.000	USD	Marble Point CLO XV 23/07/32, variabel	302.845	0,64	375.000	EUR	Segovia European CLO 20/07/32, 3.40%, variabel	322.626	0,68
250.000	USD	MP CLO VIII 28/04/34, variabel	220.565	0,46	250.000	EUR	St Paul's CLO VII DAC 18/07/34, variabel	208.972	0,44
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI 20/07/34, variabel	202.258	0,43	399.359	GBP	Taurus UK DAC 17/11/29, variabel	426.100	0,90
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI Series 2021-11A 20/07/34, variabel	217.900	0,46	310.000	GBP	Taurus UK DAC 17/05/30, variabel	314.421	0,66
375.000	USD	Trinitas CLO XVI 20/07/34, variabel	341.334	0,72	281.517	GBP	Taurus UK DAC 17/08/31, variabel	285.448	0,60
1.000.000	USD	Trinitas CLO XVIII 20/01/35, variabel	906.264	1,90	375.000	EUR	Vendome Funding CLO DAC 20/07/34, variabel	273.886	0,58
400.000	USD	TRTX Issuer 15/03/38, variabel	382.677	0,81	Israel				
Frankreich					18.000	USD	Wix.com 15/08/25, ZCP	15.147	0,03
			38.218	0,08				15.147	0,03
40.000	USD	Credit Agricole 04/10/24, 3.25%	38.218	0,08					

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (cont)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens				
Japan					170.000					USD	AssuredPartners 15/01/29, 5.63%	132.343	0,28
4.200.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 11/10/22, ZCP	29.021	0,06	29.000	USD	Beauty Health 01/10/26, 1.25%	23.490	0,05				
7.600.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 24/10/22, ZCP	52.518	0,11	50.000	USD	Bausch Health 01/02/27, 6.13%	34.740	0,07				
82.350.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 07/11/22, ZCP	569.077	1,20	55.000	USD	Bausch Health 01/06/28, 4.88%	35.551	0,07				
Luxemburg					335.000					USD	BellRing Brands 15/03/30, 7.00%	307.145	0,65
130.000	USD	ION Trading Technologies 15/05/28, 5.75%	106.187	0,22	30.000	USD	Bentley Systems 01/07/27, 0.38%	22.755	0,05				
Mexiko					329.988					USD	Blackbird Capital Aircraft 15/07/46, 2.44%	267.074	0,56
200.000	USD	Braskem Idesa 20/02/32, 6.99%	134.500	0,28	16.000	USD	Blackline 15/03/26, ZCP	13.024	0,03				
Singapur					370.000					USD	Bloomin' Brands 15/04/29, 5.13%	308.806	0,65
43.000	USD	Sea 15/09/26, 0.25%	29.993	0,06	250.000	USD	BRSP 19/08/38, variabel	233.191	0,49				
Vereinigtes Königreich					180.000					USD	Cablevision Lightpath 15/09/28, 5.63%	144.226	0,30
100.000	GBP	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 15/07/28, 4.88%	83.692	0,18	280.000	USD	Calpine 01/02/29, 4.63%	228.705	0,48				
Vereinigte Staaten					165.000					USD	Carnival 01/03/27, 5.75%	115.867	0,24
195.000	USD	Academy 15/11/27, 6.00%	177.245	0,37	20.000	USD	Carnival 01/06/30, 10.50%	16.735	0,04				
125.000	USD	Acadia Healthcare 01/07/28, 5.50%	114.445	0,24	200.000	USD	CCO Holdings 01/09/29, 6.38%	183.988	0,39				
65.000	USD	Acadia Healthcare 15/04/29, 5.00%	57.687	0,12	23.000	USD	Ceridian HCM Holding 15/03/26, 0.25%	18.665	0,04				
170.000	USD	Ahead DB Holdings 01/05/28, 6.63%	145.238	0,31	207.000	USD	Charles Schwab 13/05/26, variabel	201.055	0,42				
13.000	USD	Airbnb 15/03/26, ZCP	10.829	0,02	80.000	USD	Citgo Holding 01/08/24, 9.25%	79.526	0,17				
33.000	USD	Alarm.com Holdings 15/01/26, ZCP	27.143	0,06	330.000	USD	CITGO Petroleum 15/06/25, 7.00%	315.855	0,66				
310.000	USD	Albertsons 15/02/28, 5.88%	286.620	0,60	160.000	USD	Citigroup 01/06/24, variabel	160.223	0,34				
35.000	USD	Albertsons 15/02/30, 4.88%	29.658	0,06	220.000	USD	Cogent Communications Group 15/06/27, 7.00%	207.668	0,44				
50.000	USD	Allied Universal 01/06/28, 4.63%	38.603	0,08	125.000	USD	Colgate Energy Partners III 15/02/26, 7.75%	122.925	0,26				
280.000	USD	Allied Universal Finance 15/07/26, 6.63%	250.060	0,53	45.000	USD	CommScope 01/07/28, 7.13%	34.833	0,07				
30.000	USD	American Airlines 15/07/25, 11.75%	31.378	0,07	170.000	USD	CommScope 01/09/29, 4.75%	138.984	0,29				
125.000	USD	APX Group 15/02/27, 6.75%	116.929	0,25	145.000	USD	CommScope Technologies 15/06/25, 6.00%	129.040	0,27				
250.000	USD	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 15/05/36, variabel	234.198	0,49	145.000	USD	Community Health Systems 15/03/27, 5.63%	111.827	0,24				
185.000	USD	Arconic 15/02/28, 6.13%	163.830	0,34	30.000	USD	Community Health Systems 15/01/29, 6.00%	22.112	0,05				
80.000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 4.13%	66.095	0,14	370.000	USD	Compass Group Diversified Holdings 15/04/29, 5.25%	290.863	0,61				
103.000	USD	AREIT Trust 14/09/36, variabel	97.351	0,20									
205.000	USD	ASP Unifrax Holdings 30/09/28, 5.25%	156.268	0,33									

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (cont)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
35.000	USD	Comstock Resources 15/01/30, 5.88%	30.567	0,06	40.000	USD	Goldman Sachs Group 29/09/25, variabel	38.134	0,08
280.000	USD	Consolidated Communications 01/10/28, 6.50%	210.062	0,44	135.000	USD	Graham Packaging 15/08/28, 7.13%	108.699	0,23
335.000	USD	Coty 15/04/26, 6.50%	306.888	0,65	230.000	USD	Gray Television 15/10/30, 4.75%	172.711	0,36
19.000	USD	Coupa Software 15/06/26, 0.38%	14.697	0,03	40.000	USD	Harley-Davidson Financial Services 08/06/25, 3.35%	37.529	0,08
45.000	USD	Crocs 15/03/29, 4.25%	35.864	0,08	200.000	USD	HAT Holdings I 15/04/25, 6.00%	188.130	0,40
185.000	USD	CSC Holdings 01/02/28, 5.38%	161.968	0,34	285.000	USD	Hawaiian Brand Intellectual Property 20/01/26, 5.75%	251.796	0,53
322.000	USD	Cushman & Wakefield US Borrower 15/05/28, 6.75%	299.386	0,63	170.000	USD	Hess Midstream Operations 15/06/28, 5.13%	149.095	0,31
105.000	USD	CVR Energy 15/02/25, 5.25%	94.708	0,20	290.000	USD	Hunt 15/04/29, 5.25%	222.418	0,47
161.000	USD	Delta Air Lines 20/10/25, 4.50%	156.386	0,33	25.000	USD	iHeartCommunications 01/05/27, 8.38%	21.148	0,04
41.000	USD	DigitalOcean Holdings 01/12/26, ZCP	29.930	0,06	300.000	USD	iHeartCommunications 15/08/27, 5.25%	257.074	0,54
350.000	USD	Directv Financing 15/08/27, 5.88%	302.531	0,64	26.000	USD	Illumina 15/08/23, ZCP	24.961	0,05
115.000	USD	DISH DBS 01/12/26, 5.25%	94.384	0,20	21.000	USD	Ionis Pharmaceuticals 15/12/24, 0.13%	19.096	0,04
50.000	USD	DISH DBS 01/12/28, 5.75%	37.772	0,08	185.000	USD	Iron Mountain 15/03/28, 5.25%	162.535	0,34
33.000	USD	DocuSign 15/01/24, ZCP	30.954	0,07	25.000	USD	Iron Mountain 15/07/28, 5.00%	21.551	0,05
17.000	USD	Dropbox 01/03/26, ZCP	14.867	0,03	305.000	USD	JB Poindexter 15/04/26, 7.13%	282.445	0,59
85.000	USD	Edgewell Personal Care 01/04/29, 4.13%	70.723	0,15	15.000	USD	JetBlue Airways 01/04/26, 0.50%	10.725	0,02
20.000	USD	Envestnet 15/08/25, 0.75%	16.825	0,04	145.000	USD	LABL 01/11/28, 5.88%	117.707	0,25
32.000	USD	Etsy 15/06/28, 0.25%	24.912	0,05	245.000	USD	Legends Hospitality Holding 01/02/26, 5.00%	211.068	0,44
45.000	USD	EverArc Escrow 30/10/29, 5.00%	36.317	0,08	375.000	USD	Level 3 Financing 01/07/28, 4.25%	293.494	0,62
90.000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/30, 6.75%	68.634	0,14	26.000	USD	Liberty Broadband 30/09/50, 2.75%	24.992	0,05
345.000	USD	FirstCash 01/01/30, 5.63%	295.298	0,62	280.000	USD	Medline Borrower 01/10/29, 5.25%	212.086	0,45
400.000	USD	FMC GMSR Issuer Trust 25/07/26, variabel	318.113	0,67	295.000	USD	Minerals Technologies 01/07/28, 5.00%	257.413	0,54
95.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/08/27, 9.75%	93.095	0,20	157.000	USD	Mondelez International Holdings Netherlands 15/09/25, 4.25%	153.794	0,32
195.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/05/28, 5.50%	156.276	0,33	55.000	USD	MPH Acquisition Holdings 01/09/28, 5.50%	45.713	0,10
160.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/28, 5.00%	137.579	0,29	341.500	USD	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 15/03/35, variabel	326.880	0,69
170.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/29, 6.75%	140.640	0,30	25.000	USD	NCR 01/10/28, 5.00%	19.726	0,04
500.000	USD	FS Rialto Issuer 17/08/37, variabel	493.651	1,05	160.000	USD	NCR 01/09/29, 6.13%	138.036	0,29
90.000	USD	General Motors Financial 08/03/24, variabel	88.767	0,19					

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (cont)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
TBA-Wertpapiere				
Vereinigte Staaten			600.352	1,26
217.000	USD	Fannie Mae or Freddie Mac 01/10/37, 4.00%	209.829	0,44
199.000	USD	Fannie Mae or Freddie Mac 01/10/37, 4,50 %	195.471	0,41
196.000	USD	Fannie Mae or Freddie Mac 01/10/52, 5.50%	195.052	0,41
Summe TBA-Wertpapiere			600.352	1,26
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			34.909.961	73,47

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Kaimaninseln			645.028	1,36
798.822	USD	Horizon Aircraft Finance I 15/12/38, 4.46%	645.028	1,36
Irland			997.108	2,09
500.000	EUR	Dryden 27 R Euro CLO DAC 15/04/33, variabel	391.325	0,82
250.000	EUR	ICG Euro CLO DAC 15/05/35, variabel	192.594	0,41
500.000	EUR	ICG Euro CLO DAC Series 2022-1A 15/05/35, variabel	413.189	0,86
Vereinigte Staaten			735.000	1,55
750.000	USD	Voya CLO 20/10/34, variabel	735.000	1,55
Summe Anleihen			2.377.136	5,00
Summe sonstige Wertpapiere			2.377.136	5,00
Summe Kapitalanlagen			45.437.324	95,62
Sonstiges Nettovermögen			2.079.089	4,38
Nettoinventarwert			47.516.413	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Bermuda				
48.476	USD	Golar LNG	1.208.022	0,64
Schweiz				
142.800	USD	Alcon	8.308.104	4,41
Vereinigte Staaten				
57.093	USD	Abbott Laboratories	5.524.319	2,93
16.967	USD	Adobe	4.669.318	2,48
21.420	USD	agilon health	501.656	0,27
33.136	USD	Alphabet	3.169.458	1,68
40.833	USD	American Express	5.508.780	2,92
40.932	USD	Analog Devices	5.703.465	3,03
11.952	USD	Anterix	426.925	0,23
2.477	USD	Biogen	661.359	0,35
133.863	USD	Boston Scientific	5.184.514	2,75
2.101	USD	Bunge	173.480	0,09
11.155	USD	Comerica	793.121	0,42
15.873	USD	Constellation Brands	3.645.711	1,93
3.561	USD	CyberArk Software	533.936	0,28
14.262	USD	Danaher	3.683.732	1,95
10.850	USD	Dropbox	224.812	0,12
21.199	USD	Eaton	2.827.099	1,50
12.361	USD	Eli Lilly	3.996.929	2,12
17.210	USD	Graphic Packaging Holding	339.725	0,18
44.833	USD	Halliburton	1.103.788	0,59
17.330	USD	Hess	1.888.797	1,00
70.426	USD	Johnson Controls International	3.466.368	1,84
17.444	USD	Keysight Technologies	2.744.988	1,46
14.241	USD	Lantheus Holdings	1.001.570	0,53
24.871	USD	LPL Financial Holdings	5.433.816	2,88
5.521	USD	MasTec	350.584	0,19
11.214	USD	Medtronic	905.531	0,48
7.994	USD	Microsoft	1.861.803	0,99
8.815	USD	NextEra Energy	691.184	0,37
249.052	USD	Norwegian Cruise Line Holdings	2.829.231	1,50
16.877	USD	Occidental Petroleum	1.037.092	0,55
10.063	USD	Old Dominion Freight Line	2.503.373	1,33
23.094	USD	Option Care Health	726.768	0,39
48.689	USD	PACCAR	4.074.782	2,16
4.394	USD	Palo Alto Networks	719.693	0,38
124.609	USD	Patterson-UTI Energy	1.455.433	0,77
42.135	USD	Pfizer	1.843.828	0,98

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
142.841	USD	Portillo's	2.812.539	1,49
2.388	USD	PTC	249.785	0,13
13.536	USD	QUALCOMM	1.529.297	0,81
25.206	USD	Regions Financial	505.884	0,27
19.562	USD	Roper Technologies	7.035.278	3,73
40.090	USD	Royal Caribbean Cruises	1.519.411	0,81
27.550	USD	S&P Global	8.412.392	4,46
88.649	USD	Sabre	456.542	0,24
83.952	USD	Schlumberger	3.013.877	1,60
15.121	USD	Silgan Holdings	635.687	0,34
141.655	USD	Southwest Airlines	4.368.640	2,32
6.598	USD	Splunk	496.170	0,26
1.919	USD	T-Mobile US	257.472	0,14
37.346	USD	Verra Mobility	574.008	0,30
3.429	USD	Vulcan Materials	540.788	0,29
10.125	USD	Waste Connections	1.368.191	0,73
228.055	USD	Wells Fargo	9.172.371	4,87
14.293	USD	Williams-Sonoma	1.684.430	0,89
Summe Aktien			136.355.856	72,35
Anleihen				
Vereinigte Staaten				
2.256.000	USD	TransDigm 15/11/27, 5.50%	1.967.153	1,04
Summe Anleihen			1.967.153	1,04
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			138.323.009	73,39
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
Anleihen				
Vereinigte Staaten				
2.735.000	USD	NCL 15/03/26, 5.88%	2.101.683	1,11
2.630.000	USD	Royal Caribbean Cruises 31/08/26, 5.50%	1.995.188	1,06
36.000.000	USD	United States Treasury Bill 17/11/22, ZCP	35.915.139	19,06
Summe Anleihen			40.012.010	21,23
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			40.012.010	21,23
Summe Kapitalanlagen			178.335.019	94,62
Sonstiges Nettovermögen			10.134.047	5,38
Nettoinventarwert			188.469.066	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Deutschland			66.564	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4.25%	12.558	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4.75%	13.422	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3.25%	11.469	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2.50%	10.406	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2.50%	10.536	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1.25%	8.173	-
Vereinigte Staaten			23.612	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2.50%	7.639	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3.00%	8.363	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2.50%	7.610	-
Summe Anleihen			90.176	0,01
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			90.176	0,01

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Vereinigte Staaten			24.133	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2.88%	8.175	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3.00%	8.361	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2.50%	7.597	-
Summe Anleihen			24.133	-
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			24.133	-

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Luxemburg				
5.000.000	USD	JPMorgan Liquidity Funds-US Dollar Treasury Liquidity Fund	5.000.000	0,72
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen			5.000.000	0,72
Summe Kapitalanlagen			5.114.309	0,73

Termineinlagen				
Finanzen			338.925.000	48,78
90.000.000	USD	Banque NA 03/10/22, 3.05%	90.000.000	12,95
65.000.000	USD	Credit Agricole 03/10/22, 3.06%	65.000.000	9,35
58.925.000	USD	JPMorgan Chase Bank NA 03/10/22, 3.04%	58.925.000	8,48
30.000.000	USD	Mizuho Bank 03/10/22, 3.07%	30.000.000	4,32
95.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank 03/10/22, 3.06%	95.000.000	13,68
Summe Termineinlagen			338.925.000	48,78
Sonstiges Nettovermögen			350.806.706	50,49
Nettoinventarwert			694.846.015	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert GBP	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Vereinigtes Königreich			8.494.283	20,91
183.377	GBP	Beazley	1.034.247	2,56
116.909	GBP	Bytes Technology Group	490.784	1,21
1.296.958	GBP	Comptoir Group	69.387	0,17
547.250	GBP	Everyman Media Group	536.305	1,32
425.207	GBP	Harworth Group	514.500	1,27
237.618	GBP	Inspecs Group	320.784	0,79
386.538	GBP	NatWest Group	873.190	2,15
135.336	GBP	OSB Group	568.953	1,40
489.684	GBP	Premier Foods	466.669	1,15
150.981	GBP	Team17 Group	561.649	1,38
430.398	GBP	TT Electronics	606.000	1,49
163.992	GBP	Tyman	322.736	0,79
49.534	GBP	VIDENDUM	596.389	1,47
71.120	GBP	Vp	536.245	1,32
48.274	GBP	Watches of Switzerland Group	325.367	0,80
126.987	GBP	Wincanton	371.437	0,91
36.692	GBP	Young & Company's Brewery	220.886	0,54
8.423	GBP	Young & Company's Brewery Class A	78.755	0,19
Summe Aktien			8.494.283	20,91
Anleihen				
Vereinigtes Königreich			19.152.312	47,14
9.600.000	GBP	United Kingdom Gilt 31/01/23, 0.13%	9.510.241	23,40
3.300.000	GBP	United Kingdom Gilt 22/07/23, 0.75%	3.221.261	7,93
2.000.000	GBP	United Kingdom Gilt 07/09/23, 2.25%	1.964.846	4,84
4.050.000	GBP	United Kingdom Gilt 31/01/24, 0.13%	3.837.202	9,45
650.000	GBP	United Kingdom Gilt 22/04/24, 1.00%	618.762	1,52
Summe Anleihen			19.152.312	47,14
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			27.646.595	68,05

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert GBP	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Vereinigtes Königreich			6.914.229	17,02
2.000.000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 06/03/23, ZCP	1.978.060	4,87
5.000.000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 13/03/23, ZCP	4.936.169	12,15
Summe Anleihen			6.914.229	17,02
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			6.914.229	17,02
Summe Kapitalanlagen			34.560.824	85,07
Sonstiges Nettovermögen			6.064.445	14,93
Nettoinventarwert			40.625.269	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien					845	HKD	Anhui Conch Cement	2.680	-
Australien					26.779	HKD	Baidu	389.251	0,06
244.434	GBP	Glencore	1.304.981	0,21	6.700	CNH	Baoshan Iron & Steel	4.936	-
27.073	AUD	Whitehaven Coal	156.028	0,03	1.836	HKD	China Longyuan Power Group	2.304	-
Österreich					4.000	HKD	China National Building Material	3.063	-
26.088	EUR	Addiko Bank	269.738	0,04	3.869	HKD	China Oilfield Services	3.840	-
45.127	EUR	BAWAG Group	1.966.319	0,32	7.000	CNH	China Railway Group	5.128	-
Belgien					4.344	CNH	Contemporary Amperex Technology	243.920	0,04
8.858	USD	Euronav	136.325	0,02	248.122	HKD	CSPC Pharmaceutical Group	245.920	0,04
6.476	EUR	UCB	451.384	0,08	40.705	HKD	Everest Medicines	38.892	0,01
Bermuda					5.842	HKD	Ganfeng Lithium	38.886	0,01
15.514	USD	Golar LNG	386.609	0,06	3.372	CNH	Ganfeng Lithium	35.347	0,01
Brasilien					1.650	HKD	Great Wall Motor	1.896	-
59.588	USD	Banco Bradesco	219.284	0,04	664	CNH	Guangzhou Tinci Materials Technology	4.098	-
2.049	USD	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	18.666	-	2.303	CNH	Hangzhou Tigermed Consulting	29.412	-
51.184	BRL	Cosan	164.909	0,03	727.277	HKD	Hope Education Group	51.884	0,01
254.634	BRL	Hapvida Participacoes e Investimentos	357.333	0,05	83.500	HKD	Li Ning	639.308	0,11
14.784	BRL	Hypera	121.274	0,02	185.310	HKD	Lifetech Scientific	61.615	0,01
Burkina Faso					5.381	CNH	Metallurgical of China	2.254	-
16.057	CAD	Endeavour Mining	296.183	0,05	51.900	HKD	Onewo	293.562	0,05
Kanada					474	HKD	Ping An Insurance Group of China	2.367	-
134.400	CAD	ARC Resources	1.614.143	0,27	25.295	HKD	Remegen	122.614	0,02
20.248	USD	Barrick Gold	313.844	0,05	1.300	CNH	SAIC Motor	2.604	-
96.147	USD	Cenovus Energy	1.477.779	0,24	1.600	CNH	Sany Heavy Industry	3.111	-
3.200	USD	Clementia Pharmaceuticals	-	-	173.600	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer	233.541	0,04
112.979	CAD	Enerplus	1.599.790	0,26	114.638	CNH	Sinoma Science & Technology	319.853	0,05
54.229	CAD	Foran Mining	90.293	0,01	8.000	HKD	Sinopec Engineering Group	3.210	-
81.390	CAD	Headwater Exploration	309.922	0,05	7.500	HKD	Tencent Holdings	254.534	0,04
7.128	CAD	Intact Financial	1.008.762	0,16	580	CNH	Wuxi Lead Intelligent Equipment	3.843	-
22.465	CAD	NuVista Energy	159.541	0,03	3.059	HKD	XPeng	17.926	-
39.159	CAD	Parex Resources	571.786	0,09	69	USD	Xpeng-ADR	825	-
6.016	CAD	Pembina Pipeline	182.743	0,03	200	CNH	Yunnan Energy New Material	4.878	-
23.215	CAD	Trican Well Service	48.233	0,01	144.400	HKD	Zai Lab	504.043	0,08
15.667	CAD	Whitecap Resources	99.127	0,02	8.452	CNH	Zhejiang HangKe Technology	59.180	0,01
Kaimaninseln					4.074	CNH	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology	3.161	-
37.400	USD	Patria Investments	488.070	0,08					
China									
35.808	HKD	Alibaba Group Holding	355.587	0,06					
17.904	CNH	Amoy Diagnostics	57.854	0,01					
9.075	HKD	Angang Steel	2.243	-					

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Dänemark			863.895	0,14
6.874	USD	Ascendis Pharma	709.809	0,11
475	DKK	Genmab	154.086	0,03
Ägypten			2.344	-
2.328	GBP	Centamin	2.344	-
Frankreich			3.821.527	0,62
108.981	EUR	ALD	1.010.393	0,17
4.378	EUR	Dassault Aviation	502.007	0,08
383	EUR	Gaztransport Et Technigaz	42.528	0,01
10.909	EUR	Publicis Groupe	522.808	0,08
31.853	EUR	Technip Energies	362.592	0,06
18.173	EUR	TotalEnergies	859.799	0,14
11.364	EUR	Ubisoft Entertainment	315.408	0,05
21.218	EUR	Vallourec	205.992	0,03
Deutschland			3.323.157	0,54
127.627	EUR	Commerzbank	918.344	0,15
5.477	EUR	Hensoldt	110.307	0,02
26.832	USD	Immatics	268.320	0,04
7.837	EUR	Siemens	777.282	0,13
35.009	EUR	Talanx	1.248.904	0,20
Griechenland			192.139	0,03
37.702	EUR	Public Power	192.139	0,03
Hongkong			2.144.929	0,35
122.486	HKD	AIA Group	1.021.282	0,17
112.593	GBP	Prudential	1.123.647	0,18
Ungarn			18.635	-
1.087	HUF	Richter Gedeon	18.635	-
Indien			2.430.388	0,39
183.804	INR	Axis Bank	1.661.779	0,27
78.065	INR	Bharti Airtel	767.300	0,12
84	INR	Mahindra & Mahindra	1.309	-
Indonesien			1.114.302	0,18
40.338	IDR	Aneka Tambang	5.139	-
1.316.983	IDR	Bank Rakyat Indonesia Persero	388.327	0,06
2.432.200	IDR	Telkom Indonesia Persero	712.370	0,12
2.325	IDR	United Tractors	5.012	-
8.218	IDR	Vale Indonesia	3.454	-
Irland			4.247.063	0,69
25.847	USD	AerCap Holdings	1.094.104	0,18
961.511	EUR	AIB Group	2.342.629	0,38
1.805	USD	ICON	331.723	0,05

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
126.844	EUR	Irish Continental Group	478.607	0,08
Italien			5.317.149	0,86
2.456	EUR	DiaSorin	276.324	0,04
255.123	EUR	FinecoBank Banca Fineco	3.184.174	0,52
181.148	EUR	UniCredit	1.856.651	0,30
Japan			4.454.140	0,72
14.537	JPY	Astellas Pharma	192.548	0,03
5.800	JPY	Bank of Kyoto	211.995	0,03
41.400	JPY	Chiba Bank	222.833	0,04
24.235	JPY	Chugai Pharmaceutical	607.173	0,10
18.571	JPY	Daiichi Sankyo	518.648	0,08
1.606	JPY	Eisai	85.987	0,01
474	JPY	ENEOS Holdings	1.523	-
60.100	JPY	Fukuoka Financial Group	1.065.547	0,17
14.900	JPY	Japan Steel Works	292.997	0,05
1.282	JPY	Nippon Shinyaku	65.548	0,01
4.136	JPY	Ono Pharmaceutical	96.620	0,02
230	JPY	Panasonic Holdings	1.612	-
106	JPY	Rohm	6.929	-
11.800	JPY	Sanken Electric	360.775	0,06
29.000	JPY	Shiga Bank	523.775	0,09
148	JPY	Sumitomo Mitsui Financial Group	4.115	-
20.700	JPY	T&D Holdings	195.515	0,03
Jordanien			52.097	0,01
3.422	GBP	Hikma Pharmaceuticals	52.097	0,01
Luxemburg			33.705	0,01
41.756	USD	Arrival	33.705	0,01
Malaysia			4.007	-
3.318	MYR	Malaysia Airports Holdings	4.007	-
Mexiko			86.598	0,01
10.083	GBP	Fresnillo	86.598	0,01
Niederlande			3.408.054	0,55
2.957	USD	Argenx	1.043.969	0,17
124.737	GBP	DP Eurasia	56.406	0,01
6.777	EUR	EXOR	434.905	0,07
16.837	EUR	Koninklijke Philips	264.018	0,04
17.013	USD	Merus	340.770	0,06
50.551	GBP	Shell	1.267.986	0,20
Norwegen			1.182.408	0,19
1.235	NOK	Aker BP	35.456	0,01
36.064	NOK	Aker Carbon Capture	46.187	0,01
39.453	NOK	DNB Bank	626.299	0,09
14.330	USD	Equinor	474.466	0,08
Philippinen			6.194	-
17.082	PHP	Bloomberry Resorts	1.952	-

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
3.070	PHP	Security Bank	4.242	-
Puerto Rico			1.647.868	0,27
22.868	USD	Popular	1.647.868	0,27
Singapur			1.761.060	0,29
41.594	SGD	DBS Group Holdings	966.979	0,16
6.570	EUR	STMicroelectronics	207.623	0,03
32.198	SGD	United Overseas Bank	586.458	0,10
Südafrika			705.259	0,11
20.074	GBP	Anglo American	613.125	0,10
4.953	GBP	Thungela Resources	92.134	0,01
Südkorea			182.396	0,03
7.582	USD	Coupang	126.392	0,02
128	KRW	KB Financial Group	3.910	-
3.297	KRW	Korea Electric Power	46.320	0,01
61	KRW	Samsung Electronics	2.264	-
35	KRW	SK Innovation	3.510	-
Spanien			2.020.975	0,33
699.247	EUR	Banco Santander	1.642.999	0,27
43.069	EUR	Bankinter	243.382	0,04
15.462	EUR	Grifols	134.594	0,02
Schweden			769.085	0,12
50.751	SEK	Anleger	748.073	0,12
1.552	SEK	SKF	21.012	-
Schweiz			2.586.119	0,42
9.097	CHF	Alcon	536.029	0,09
98	CHF	Lonza Group	48.300	0,01
9.862	CHF	Novartis	754.917	0,12
595	CHF	Tecan Group	206.836	0,03
70.895	CHF	UBS Group	1.040.037	0,17
Thailand			4.283	-
13.136	THB	Banpu	4.283	-
Vereinigtes Königreich			7.147.760	1,17
11.615	GBP	Abcam	174.429	0,03
45.116	EUR	Allfunds Group	334.936	0,05
10.199	GBP	AstraZeneca	1.132.392	0,17
49.563	GBP	Babcock International Group	154.176	0,03
131.933	GBP	Barclays	212.568	0,03
83.503	GBP	Beazley	525.847	0,09
43.684	GBP	BP	211.246	0,03
5.432	GBP	British American Tobacco	195.690	0,03
32.129	EUR	CNH Industrial	366.206	0,06
17.071	GBP	ConvaTec Group	39.189	0,01
8.127	GBP	Derwent London	183.299	0,03
8.811	GBP	Genus	257.557	0,04

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
11.405	GBP	Harbour Energy	57.037	0,01
69.798	GBP	Hargreaves Lansdown	675.834	0,11
8.383	GBP	IMI	104.739	0,02
970	USD	Immunocore Holdings	45.532	0,01
19.318	GBP	Imperial Brands	400.114	0,07
16.887	GBP	Rotork	44.159	0,01
429.729	GBP	Sabre Insurance Group	465.419	0,08
115.882	GBP	Serco Group	202.233	0,03
30.904	GBP	Smith & Nephew	362.484	0,06
109	GBP	St James's Place	1.261	-
61.309	NOK	Subsea 7	487.049	0,08
41.193	USD	TechnipFMC	348.493	0,06
16.230	USD	Verona Pharma	165.871	0,03
Vereinigte Staaten			118.179.661	19,21
20.948	USD	2seventy bio	304.793	0,05
813	USD	Accenture	209.185	0,03
28.538	USD	Aclaris Therapeutics	449.188	0,07
1.578	USD	Acuity Brands	248.488	0,04
14.799	USD	AdaptHealth	277.925	0,05
1.100	USD	Addus HomeCare	104.764	0,02
5.589	USD	AECOM	382.120	0,06
21.910	USD	AES	495.166	0,08
1.160	USD	Agilent Technologies	140.998	0,02
14.677	USD	agilon health	343.735	0,06
1.204	USD	Align Technology	249.360	0,04
32.060	USD	Alkermes	715.900	0,12
4.128	USD	Allstate	514.060	0,08
5.350	USD	Alnylam Pharmaceuticals	1.070.856	0,17
2.881	USD	Altus Power	31.720	0,01
6.120	USD	Amazon.com	691.560	0,11
2.011	USD	Amedisys	194.644	0,03
15.895	USD	Amerant Bancorporation	394.832	0,06
6.166	USD	American Electric Power	533.051	0,09
18.382	USD	American Express	2.479.915	0,40
57.892	USD	Ameris Bancorporation	2.588.351	0,42
8.666	USD	Amicus Therapeutics	90.473	0,01
29.753	USD	Antero Midstream	273.133	0,04
32.260	USD	Antero Resources	984.898	0,16
14.430	USD	Apellis Pharmaceuticals	985.569	0,16
5.581	USD	Applied Industrial Technologies	573.615	0,09
3.639	USD	Aptiv	284.606	0,05
20.152	USD	Arch Capital Group	917.722	0,15
5.182	USD	Archer-Daniels-Midland	416.892	0,07
27.036	USD	Ares Management	1.674.880	0,27
2.077	USD	Atmos Energy	211.542	0,03

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
1.357	USD	AvalonBay Communities	249.946	0,04	1.988	USD	Edison International	112.481	0,02
3.082	USD	Avantor	60.407	0,01	2.760	USD	Edwards Lifesciences	228.059	0,04
12.456	USD	AZEK	207.019	0,03	6.355	USD	Elanco Animal Health	78.865	0,01
6.767	USD	Baker Hughes	141.836	0,02	1.280	USD	Elevance Health	581.427	0,09
3.524	USD	Baxter International	189.803	0,03	7.869	USD	Eli Lilly	2.544.441	0,41
2.052	USD	Becton Dickinson	457.247	0,07	5.843	USD	Encompass Health	264.279	0,04
443	USD	Bio-Techne	125.812	0,02	27.846	USD	EnLink Midstream	247.551	0,04
4.636	USD	Block	254.934	0,04	1.296	USD	Enstar Group	219.789	0,04
8.492	USD	Blueprint Medicines	559.538	0,09	11.488	USD	Entergy	1.156.037	0,19
8.896	USD	Boston Scientific	344.542	0,06	15.738	USD	Enterprise Financial Services	693.101	0,11
29.898	USD	Brigham Minerals	737.584	0,12	19.974	USD	EOG Resources	2.231.695	0,36
825	USD	Bristol-Myers Squibb	58.649	0,01	19.499	USD	EQT	794.584	0,13
18.161	USD	Builders FirstSource	1.070.046	0,17	20.841	USD	Equitable Holdings	549.160	0,09
3.993	USD	Bunge	329.702	0,05	11.751	USD	Eversource Energy	916.108	0,15
13.364	USD	BWX Technologies	673.145	0,11	9.579	USD	Exact Sciences	311.222	0,05
6.960	USD	Cabot	444.674	0,07	32.247	USD	Exelon	1.207.973	0,20
266	USD	Cactus	10.222	-	52.460	USD	Expro Group Holdings	668.340	0,11
26.044	USD	CareMax	184.652	0,03	5.710	USD	Exxon Mobil	498.540	0,08
15.356	USD	Cargurus	217.595	0,04	12.345	USD	Fidelity National Financial	446.889	0,07
6.223	USD	Celldex Therapeutics	174.929	0,03	4.425	USD	First Solar	585.295	0,10
9.206	USD	Centene	716.319	0,12	1.434	USD	Five9	107.521	0,02
24.616	USD	CenterPoint Energy	693.679	0,11	7.986	USD	Flowserve	194.060	0,03
7.123	USD	ChargePoint Holdings	105.135	0,02	280	USD	Fluence Energy	4.085	-
60.349	USD	Charles Schwab	4.337.282	0,71	10.204	USD	Fluor	253.977	0,04
393	USD	Charter Communications	119.217	0,02	188	USD	Fluor-Preference	233.723	0,04
13.110	USD	Chemours	323.162	0,05	10.611	USD	Ford Motor	118.843	0,02
7.728	USD	Cheniere Energy	1.282.152	0,21	1.167	USD	Gartner	322.897	0,05
18.808	USD	Chesapeake Energy	1.771.902	0,29	26.804	USD	Genworth Financial	93.814	0,02
17.382	USD	Chord Energy	2.377.336	0,39	2.904	USD	Glaukos	154.609	0,03
2.564	USD	Chubb	466.340	0,08	1.984	USD	Global Payments	214.371	0,03
3.270	USD	Clean Harbors	359.635	0,06	8.585	USD	GoDaddy	608.505	0,10
6.610	USD	CNB Financial	155.798	0,03	4.459	USD	Goldman Sachs Group	1.306.710	0,21
9.326	USD	Comerica	663.079	0,11	5.810	USD	Green Plains	168.897	0,03
6.219	USD	ConocoPhillips	636.452	0,10	13.500	GBP	GSK	196.829	0,03
12.653	USD	Consolidated Edison	1.085.121	0,18	3.441	USD	Gulfport Energy	303.806	0,05
3.904	USD	Constellation Energy	324.774	0,05	3.910	USD	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital	117.026	0,02
20.222	USD	Coterra Energy	528.199	0,09	1.833	USD	HCA Healthcare	336.887	0,05
9.019	USD	CTI BioPharma	52.491	0,01	3.655	USD	Health Catalyst	35.453	0,01
2.703	USD	Danaher	698.158	0,11	8.670	USD	Heritage Financial	229.495	0,04
200	USD	Darling Ingredients	13.230	-	2.304	USD	HF Sinclair	124.047	0,02
899	USD	Deere	300.167	0,05	6.407	USD	Hologic	413.380	0,07
2.221	USD	Denbury	191.583	0,03	11.708	USD	Home BancShares	263.547	0,04
3.478	USD	Dexcom	280.118	0,05	3.866	USD	Horizon Therapeutics	239.267	0,04
118.351	USD	Diamond Offshore Drilling	784.667	0,13	1.700	USD	Hubbell	379.100	0,06
31.132	USD	Diamondback Energy	3.750.160	0,62					
433	USD	Domino's Pizza	134.317	0,02					

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
1.957	USD	Humana	949.517	0,15	30.313	USD	Ovintiv	1.394.398	0,23
977	USD	IDEXX Laboratories	318.307	0,05	9.740	USD	Owens & Minor	234.734	0,04
1.240	USD	Illumina	236.580	0,04	2.388	USD	Palo Alto Networks	391.131	0,06
65.941	USD	ImmunoGen	315.198	0,05	810	USD	Paycom Software	267.292	0,04
1.731	USD	Inari Medical	125.740	0,02	806	USD	PayPal Holdings	69.372	0,01
8.902	USD	Incyte	593.229	0,10	21.183	USD	PDC Energy	1.224.166	0,20
1.629	USD	Insulet	373.693	0,06	5.871	USD	Peabody Energy	145.718	0,02
20.472	USD	Intel	527.563	0,09	8.781	USD	Pfizer	384.257	0,06
7.386	USD	Intra-Cellular Therapies	343.670	0,06	3.798	USD	Phillips 66	306.575	0,05
24.067	USD	Ironwood Pharmaceuticals	249.334	0,04	3.454	USD	Pioneer Natural Resources	747.895	0,12
912	USD	Johnson & Johnson	148.984	0,02	9.571	USD	PNM Resources	437.682	0,07
24.221	USD	Johnson Controls International	1.192.158	0,19	13.132	USD	Portland General Electric	570.717	0,09
1.042	USD	Jones Lang LaSalle	157.415	0,03	19.563	USD	ProFrac Holding	297.553	0,05
2.514	USD	Karuna Therapeutics	565.474	0,09	5.860	USD	Progressive	680.991	0,11
11.232	USD	Kymera Therapeutics	244.521	0,04	1.783	USD	Prologis	181.153	0,03
1.335	USD	Laboratory of America Holdings	273.421	0,04	4.537	USD	PTC Therapeutics	227.757	0,04
10.557	USD	Lennar	787.024	0,13	5.196	USD	Public Service Enterprise Group	292.171	0,05
1.051	USD	Livent	32.213	0,01	1.956	USD	QuidelOrtho	139.815	0,02
618	USD	Lululemon Athletica	172.768	0,03	8.869	USD	Range Resources	224.031	0,04
6.900	USD	M&T Bank	1.216.608	0,20	2.166	USD	Raymond James Financial	214.044	0,03
1.885	USD	Marriott International	264.164	0,04	668	USD	Regeneron Pharmaceuticals	460.165	0,07
178	USD	Merck	15.329	-	2.828	USD	Revolution Medicines	55.768	0,01
16.548	USD	MGIC Investment	212.145	0,03	8.096	USD	Rice Acquisition II	80.393	0,01
6.664	USD	Mirati Therapeutics	465.414	0,08	14.906	USD	Rice Acquisition II-XNYS	147.122	0,02
1.643	USD	Moderna	194.285	0,03	438	CHF	Roche Holding	143.581	0,02
1.078	USD	Molina Healthcare	355.568	0,06	6.373	USD	Ross Stores	537.053	0,09
36.607	USD	Morgan Stanley	2.892.319	0,48	2.665	USD	S&P Global	813.758	0,13
11.316	USD	MVB Financial	314.924	0,05	4.635	USD	Sage Therapeutics	181.507	0,03
22.149	USD	Myovant Sciences	397.796	0,06	1.701	USD	Salesforce	244.672	0,04
18.225	USD	NanoString Technologies	232.733	0,04	1.259	USD	Sarepta Therapeutics	139.170	0,02
4.605	USD	National Bank Holdings	170.339	0,03	56.084	USD	Schlumberger	2.013.416	0,33
20.269	USD	Navigator Holdings	232.080	0,04	3.753	EUR	Schneider Electric	430.120	0,07
10.475	USD	NeoGenomics	90.190	0,01	7.302	USD	Seagen	999.133	0,16
1.321	USD	Netflix	311.016	0,05	7.883	USD	Sempra Energy	1.181.977	0,19
20.778	USD	New Jersey Resources	804.109	0,13	10.410	USD	Skyline Champion	550.377	0,09
20.229	USD	NextDecade	121.779	0,02	3.663	USD	Southwest Gas Holdings	255.494	0,04
31.089	USD	NiSource	783.132	0,13	1.743	USD	Stoke Therapeutics	22.380	-
15.955	USD	Noble	471.949	0,08	2.405	USD	Stryker	487.109	0,08
10.690	USD	Northern Oil & Gas	293.013	0,05	3.344	USD	SunPower	77.046	0,01
1.876	USD	Okta	106.688	0,02	2.270	USD	Syndax Pharmaceuticals	54.548	0,01
6.503	USD	ON Semiconductor	405.332	0,07					

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
4.665	USD	Syneos Health	219.955	0,04
72.459	USD	Synovus Financial	2.717.937	0,45
2.377	USD	Take-Two Interactive Software	259.093	0,04
14.228	USD	Talos Energy	236.896	0,04
14.646	USD	Targa Resources	883.740	0,14
305	USD	Teleflex	61.445	0,01
3.323	USD	Tenaris	85.866	0,01
422	USD	Thermo Fisher Scientific	214.034	0,03
11.700	USD	Third Harmonic Bio	221.949	0,04
6.239	USD	T-Mobile US	837.087	0,14
1.703	USD	Tradeweb Markets	96.083	0,02
5.021	USD	Uber Technologies	133.057	0,02
1.249	USD	Ulta Beauty	501.086	0,08
3.779	USD	Ultragenyx Pharmaceutical	156.488	0,03
1.770	USD	UnitedHealth Group	893.921	0,15
2.428	USD	Valaris	118.826	0,02
5.663	USD	Valero Energy	605.092	0,10
2.695	USD	Veeva Systems	444.352	0,07
8.030	USD	Veracyte	133.298	0,02
1.390	USD	Verisk Analytics	237.037	0,04
3.266	USD	Vertex Pharmaceuticals	945.638	0,15
4.496	USD	Visteon	476.846	0,08
1.842	USD	Waters	496.474	0,08
3.004	USD	WESCO International	358.618	0,06
19.942	USD	Western Alliance Bancorporation	1.310.987	0,21
6.018	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	489.564	0,08
13.731	USD	Williams	393.119	0,06
793	USD	Workday	120.710	0,02
17.618	USD	Zentaris Pharmaceuticals	381.606	0,06
4.239	USD	Zoetis	628.601	0,10
550	USD	ZoomInfo Technologies	22.913	-
Summe Aktien			185.569.833	30,15
Anleihen				
Argentinien				
42.724	USD	Cia Latinoamericana de Infraestructura & Servicios 25/07/27, 5.25%	12.972	-
Bulgarien			1.601.452	0,26
1.740.000	EUR	Bulgaria Government International Bond 23/09/29, 4.13%	1.601.452	0,26

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Kanada			2.197.147	0,36
1.350.000	CAD	Ontario Teachers' Finance Trust 16/11/22, ZCP	972.940	0,16
700.000	CAD	Regional Municipality of York 08/11/22, ZCP	504.947	0,08
1.000.000	CAD	Regional Municipality of York 06/12/22, ZCP	719.260	0,12
China			699.738	0,11
700.000	USD	Bank of China 22/11/22, variabel	699.738	0,11
Frankreich			863.667	0,14
910.000	USD	BNP Paribas perpetual, variabel	679.770	0,11
200.165	EUR	Vallourec 30/06/26, 8.50%	183.897	0,03
Deutschland			332.425	0,05
135.000	EUR	Renk 15/07/25, 5.75%	121.531	0,02
300.000	EUR	Wintershall Dea Finance 2 perpetual, variabel	210.894	0,03
Ungarn			2.132.852	0,35
885.000	EUR	Hungary Government International Bond 28/04/26, 1.13%	760.892	0,12
2.205.000	EUR	Hungary Government International Bond 18/11/30, 0.50%	1.371.960	0,23
Luxemburg			369.270	0,06
495.000	EUR	Altice France Holding 15/05/27, 8.00%	369.270	0,06
Mexiko			465.689	0,08
11.110.500	MXN	Mexican Bonos 31/07/53, 8.00%	465.689	0,08
Niederlande			2.096.334	0,34
690.000	USD	ING Groep perpetual, variabel	451.847	0,07
630.000	USD	ING Groep Series * perpetual, variabel	442.450	0,07
685.000	EUR	Koninklijke KPN perpetual, variabel	658.394	0,11
690.000	EUR	UPCB Finance VII 15/06/29, 3.63%	543.643	0,09
Peru			2.605.961	0,42
2.300.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/28, 6.35%	525.513	0,09
3.350.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/32, 6.15%	694.740	0,11
7.390.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/34, 5.40%	1.385.708	0,22
Südafrika			7.065.763	1,15
64.515.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	2.934.363	0,48

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
70.245.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	3.175.384	0,52
9.545.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/36, 6.25%	335.182	0,05
14.810.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/44, 8.75%	620.834	0,10
Südkorea			3.003.800	0,49
200.000	USD	Export-Import Bank of Korea 22/03/23, variabel	200.479	0,03
1.010.000	USD	Export-Import Bank of Korea 27/04/23, variabel	1.015.307	0,17
500.000	USD	Korea Development Bank 30/10/22, variabel	500.077	0,09
400.000	USD	Korea Development Bank 18/02/23, variabel	400.017	0,06
200.000	USD	Korea Development Bank 16/04/23, variabel	201.229	0,03
500.000	USD	Korea Development Bank 26/05/23, ZCP	486.998	0,08
200.000	USD	Korea Development Bank 09/03/24, variabel	199.693	0,03
Supranational			2.685.149	0,44
127.500.000	ZAR	Asian Development Bank 30/04/40, ZCP	1.121.754	0,19
16.000.000	TRY	European Bank for Reconstruction & Development 15/10/26, ZCP	240.223	0,04
40.000.000	MXN	European Bank for Reconstruction & Development 19/01/32, ZCP	842.138	0,14
200.000	USD	European Investment Bank 19/01/23, variabel	199.981	0,03
11.750.000	MXN	International Bank for Reconstruction & Development 25/05/33, ZCP	210.963	0,03
7.200.000	TRY	International Finance 09/05/27, ZCP	70.090	0,01
Schweden			636.329	0,10
680.000	EUR	Telia 21/12/82, variabel	636.329	0,10
Schweiz			2.076.860	0,34
960.000	USD	Credit Suisse Group perpetual, variabel	884.807	0,14
895.000	USD	Credit Suisse Group perpetual, variabel	532.946	0,09
290.000	USD	UBS Group perpetual, variabel	226.563	0,04
510.000	USD	UBS Group perpetual, variabel	432.544	0,07

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Vereinigtes Königreich			2.426.963	0,39
320.000	GBP	AA Bond 31/07/29, 7.38%	317.203	0,05
350.000	GBP	B&M European Value Retail 15/07/25, 3.63%	332.858	0,05
480.000	USD	Barclays perpetual, variabel	421.296	0,07
670.000	EUR	British American Tobacco perpetual, variabel	463.596	0,08
460.000	GBP	Heathrow Funding 09/08/49, 2.75%	268.364	0,04
700.000	GBP	National Express Group perpetual, variabel	623.646	0,10
Summe Anleihen			31.272.371	5,08
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			216.842.204	35,23

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen				
Kanada			18.836.969	3,06
100.000	CAD	Alberta Treasury Bill 01/11/22, ZCP	72.347	0,01
500.000	CAD	Alberta Treasury Bill 15/11/22, ZCP	360.555	0,06
1.000.000	CAD	CDP Financial 25/10/22, ZCP	722.521	0,12
750.000	CAD	CDP Financial 10/11/22, ZCP	541.116	0,09
400.000	USD	CDP Financial 26/06/23, ZCP	389.072	0,06
250.000	USD	CDP Financial 28/06/23, ZCP	243.213	0,04
400.000	CAD	City of Montreal Canada 11/05/23, 0.45%	283.278	0,05
1.000.000	CAD	City of Montreal Canada 01/09/23, 3.50%	719.666	0,12
300.000	CAD	City of Montreal Coupon Strip 01/12/22, ZCP	215.897	0,04
1.000.000	CAD	City of Ottawa Ontario 19/10/22, ZCP	722.752	0,12
310.000	CAD	City of Quebec Canada 25/09/23, 4.00%	223.632	0,04
340.000	CAD	City of Quebec Canada Principal Strip 06/03/23, ZCP	241.769	0,04
700.000	CAD	Hydro Quebec Interest Strip 15/08/23, ZCP	489.607	0,08

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
600.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 12/10/22, ZCP	433.969	0,07	500.000	CAD	Regional Municipality of York 11/10/22, ZCP	361.695	0,06
1.000.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 19/10/22, ZCP	722.825	0,11	1.500.000	CAD	Regional Municipality of York 18/11/22, ZCP	1.080.893	0,17
900.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 02/11/22, ZCP	649.767	0,11	1.000.000	CAD	Regional Municipality of York 22/11/22, ZCP	720.533	0,12
500.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 16/11/22, ZCP	360.503	0,06	China			499.265	0,08
300.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 04/10/22, ZCP	217.134	0,04	500.000	USD	Industrial & Commercial Bank of China 08/11/22, 2.96%	499.265	0,08
700.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 13/10/22, ZCP	506.248	0,08	Frankreich			249.567	0,04
500.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 17/10/22, ZCP	361.485	0,06	250.000	USD	Dexia Credit Local 02/11/22, ZCP	249.567	0,04
600.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 27/10/22, ZCP	433.415	0,07	Deutschland			496.815	0,08
1.000.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 28/11/22, ZCP	719.929	0,12	500.000	USD	Landesbank Baden-Wuerttemberg 10/01/23, ZCP	496.815	0,08
910.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 06/12/22, ZCP	654.512	0,11	Japan			29.967.849	4,87
395.000	CAD	Nova Scotia Treasury Bill 25/10/22, ZCP	285.397	0,05	282.400.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 03/10/22, ZCP	1.951.234	0,32
1.450.000	CAD	Ontario Teachers' Finance Trust 19/10/22, ZCP	1.048.212	0,16	142.400.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 11/10/22, ZCP	983.939	0,16
600.000	CAD	Ontario Treasury Bill 02/11/22, ZCP	433.211	0,07	372.100.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 17/10/22, ZCP	2.571.151	0,42
700.000	CAD	Ontario Treasury Bill 09/11/22, ZCP	505.507	0,08	94.600.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 24/10/22, ZCP	653.696	0,11
1.047.000	CAD	Ontario Treasury Bill 07/12/22, ZCP	753.700	0,11	111.000.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 31/10/22, ZCP	767.035	0,12
600.000	CAD	Prince Edward Island Treasury Note 11/10/22, ZCP	434.006	0,07	61.400.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 07/11/22, ZCP	424.296	0,07
1.300.000	CAD	Province of British Columbia Canada Principal Strip 08/09/23, ZCP	906.482	0,14	225.550.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 14/11/22, ZCP	1.558.634	0,25
600.000	CAD	Province of Manitoba Canada Treasury Bill 16/11/22, ZCP	432.636	0,07	322.550.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 21/11/22, ZCP	2.229.036	0,36
500.000	CAD	Province of Saskatchewan Canada Coupon Strip 27/10/22, ZCP	361.196	0,06	139.000.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 28/11/22, ZCP	960.582	0,16
500.000	CAD	PSP Capital 03/10/22, ZCP	361.923	0,06	383.500.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 05/12/22, ZCP	2.650.286	0,43
800.000	CAD	Quebec Treasury Bill 28/10/22, ZCP	577.869	0,09	147.200.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 12/12/22, ZCP	1.017.298	0,17
400.000	CAD	Quebec Treasury Bill 10/11/22, ZCP	288.497	0,05	583.000.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 19/12/22, ZCP	4.029.219	0,65
					657.850.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 06/01/23, ZCP	4.547.774	0,74
					88.650.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 10/01/23, ZCP	612.807	0,10
					307.000.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 11/01/23, ZCP	2.122.589	0,34
					245.000.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 10/03/23, ZCP	1.694.245	0,28
					172.650.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 20/04/23, ZCP	1.194.028	0,19

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Rumänien			1.256.201	0,20
1.384.000	USD	Romanian Government International Bond 25/11/27, 5.25%	1.256.201	0,20
Südkorea			249.784	0,04
250.000	USD	Korea Development Bank 19/10/22, ZCP	249.784	0,04
Schweiz			3.994.413	0,65
5.221.000	USD	Credit Suisse Group perpetual, variabel	3.994.413	0,65
Vereinigte Staaten			192.459.856	31,27
240.000	USD	Adams Homes 15/02/25, 7.50%	198.438	0,04
363.000	USD	Alynlam Pharmaceuticals 15/09/27, 1.00%	354.288	0,07
105.000	USD	NCL 15/02/29, 7.75%	79.375	0,01
1.670.000	USD	United States Cash Management Bill 13/12/22, ZCP	1.660.620	0,27
3.935.000	USD	United States Cash Management Bill 20/12/22, ZCP	3.906.860	0,63
1.215.000	USD	United States Cash Management Bill 03/01/23, ZCP	1.205.140	0,20
4.110.000	USD	United States Cash Management Bill 10/01/23, ZCP	4.071.584	0,66
2.855.000	USD	United States Cash Management Bill 17/01/23, ZCP	2.824.992	0,46
13.220.000	USD	United States Cash Management Bill 24/01/23, ZCP	13.072.663	2,12
1.500.000	USD	United States Cash Management Bill 31/01/23, ZCP	1.482.249	0,24
9.648.000	USD	United States Treasury Bill 04/10/22, ZCP	9.646.145	1,57
1.000.000	USD	United States Treasury Bill 06/10/22, ZCP	999.778	0,16
52.484.000	USD	United States Treasury Bill 11/10/22, ZCP	52.448.814	8,52
500.000	USD	United States Treasury Bill 13/10/22, ZCP	499.638	0,08
9.637.000	USD	United States Treasury Bill 18/10/22, ZCP	9.626.056	1,56
25.147.000	USD	United States Treasury Bill 20/10/22, ZCP	25.114.459	4,08
1.650.000	USD	United States Treasury Bill 25/10/22, ZCP	1.647.138	0,27
8.870.000	USD	United States Treasury Bill 01/11/22, ZCP	8.849.648	1,44
2.760.000	USD	United States Treasury Bill 03/11/22, ZCP	2.759.357	0,45

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
1.059.000	USD	United States Treasury Bill 08/11/22, ZCP	1.056.506	0,17
5.078.000	USD	United States Treasury Bill 10/11/22, ZCP	5.063.932	0,82
3.890.000	USD	United States Treasury Bill 15/11/22, ZCP	3.876.710	0,63
1.320.000	USD	United States Treasury Bill 17/11/22, ZCP	1.316.186	0,21
3.925.000	USD	United States Treasury Bill 22/11/22, ZCP	3.909.859	0,64
1.525.000	USD	United States Treasury Bill 25/11/22, ZCP	1.518.558	0,25
2.050.000	USD	United States Treasury Bill 01/12/22, ZCP	2.040.015	0,33
15.634.000	USD	United States Treasury Bill 08/12/22, ZCP	15.546.651	2,53
1.060.000	USD	United States Treasury Bill 15/12/22, ZCP	1.053.161	0,17
830.000	USD	United States Treasury Bill 22/12/22, ZCP	823.866	0,13
2.230.000	USD	United States Treasury Bill 02/02/23, ZCP	2.207.680	0,36
455.000	USD	United States Treasury Bill 09/02/23, ZCP	450.000	0,07
2.120.000	USD	United States Treasury Bill 16/02/23, ZCP	2.095.507	0,34
380.000	USD	United States Treasury Bill 23/02/23, ZCP	375.245	0,06
4.330.000	USD	United States Treasury Bill 02/03/23, ZCP	4.270.663	0,69
2.265.000	USD	United States Treasury Bill 09/03/23, ZCP	2.228.735	0,36
1.744.000	USD	United States Treasury Bill 23/03/23, ZCP	1.726.521	0,28
2.500.000	USD	United States Treasury Bill 30/03/23, ZCP	2.452.819	0,40
Summe Anleihen			248.010.719	40,29
TBA-Wertpapiere				
Vereinigte Staaten			21.004.969	3,41
22.038.000	USD	Fannie Mae or Freddie Mac 01/10/52, 4,50 %	21.004.969	3,41
Summe TBA-Wertpapiere			21.004.969	3,41
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			269.015.688	43,70

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Kanada			538.957	0,09
750.000	CAD	Toronto Hydro 10/04/23, 2.91%	538.957	0,09
Summe Anleihen			538.957	0,09
Summe sonstige Wertpapiere			538.957	0,09

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Optionsscheine	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Vereinigte Staaten			1.352	-
3.660	USD	Metals Acquisition Warrants 12/07/26	1.352	-
Summe Optionsscheine			1.352	-
Summe Kapitalanlagen			486.398.201	79,02
Sonstiges Nettovermögen			129.140.372	20,98
Nettoinventarwert			615.538.573	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 68 bis 151 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022

Die Gesellschaft

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft in der Rechtsform einer „Société Anonyme“, die nach den Gesetzen des Großherzogtums Luxemburg gegründet wurde und als Société d'Investissement à Capital Variable („SICAV“) anerkannt ist. 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 Anlagerisiko 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.

Anteilsklassen

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 Anteilsklassen und Teilfonds ausschüttende Anteile erhältlich sind.

Der Verwaltungsrat kann beschließen, in jedem Teilfonds verschiedene Anteilsklassen 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 Anteilsklassen unterscheiden können. Für jede Anteilsklasse wird ein eigener Nettoinventarwert je Anteil berechnet, der aufgrund dieser variablen Faktoren unterschiedlich ausfallen kann. Die für den jeweiligen Teilfonds verfügbaren Anteilsklassen werden im aktuellen Verkaufsprospekt genauer aufgeführt.

Die Anteilsklasse 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.

Anteilsklassen	Ausgabeaufschlag
A ¹ , 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-, S-, X-, Y- und Y1-Anteile	Kein Ausgabeaufschlag

¹ Der Ausgabeaufschlag für die Schroder GAIA Cat Bond Anteilsklasse A beträgt bis zu 1,01010 % des Nettoinventarwerts je Anteil.

Vertriebsgebühr

Zum Zeitpunkt dieses Berichts fällt für alle A1-Anteilsklassen von Schroder GAIA eine Vertriebsgebühr von 0,50 % an. Auf andere zur Anlage angebotene Anteilsklassen der Gesellschaft wird keine weitere Vertriebsgebühr erhoben.

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 Mittelabflüssen 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 2022, dem letzten Berechnungstag des Berichtsjahres, wurden Swing-Pricing-Anpassungen für den Schroder GAIA Contour Tech Equity und den Schroder GAIA Oaktree Credit vorgenommen. Die nachfolgende Tabelle stellt den offiziellen Nettoinventarwert je Anteil dieser Teilfonds nach Anwendung der Swing-Pricing-Anpassung zu diesem Termin dar. Alle sonstigen in diesem Bericht aufgeführten Finanzinformationen werden vor den Swing Pricing-Anpassungen ausgewiesen.

	Währung der Anteilsklasse	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Oaktree Credit
Nettoinventarwert je Anteil* (einschließlich Swing-Pricing-Anpassung) zum 30. September 2022			
Klasse A Thes.	USD	106,55	–
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	96,42	–
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	98,38	–
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	SGD	145,95	–
Klasse A1 Thes.	USD	105,88	–
Klasse A2 Thes.	USD	–	89,93
Klasse A2 Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	–	87,70
Klasse A2 Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	–	87,86
Klasse A2 Aussch.	USD	–	92,80
Klasse A2 Aussch. (in CHF abgesichert)	CHF	–	91,87
Klasse A2 Aussch. (in EUR abgesichert)	EUR	–	97,60
Klasse A2 Aussch. (in GBP abgesichert)	GBP	–	92,41
Klasse C Thes.	USD	110,88	90,36

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Swing-Pricing (Forts.)

	Wahrung der Anteilsklasse	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Oaktree Credit
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	101,61	88,27
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	102,12	88,48
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	GBP	85,11	89,83
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	851,03	-
Klasse C Aussch.	USD	-	92,80
Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert)	CHF	-	91,86
Klasse C Aussch. (in EUR abgesichert)	EUR	-	97,59
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	GBP	-	92,40
Klasse E Thes.	USD	112,31	90,42
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	102,25	88,46
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	103,30	88,69
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	GBP	-	90,02
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	853,54	-
Klasse E Aussch.	USD	-	92,79
Klasse E Aussch. (in CHF abgesichert)	CHF	-	91,86
Klasse E Aussch. (in EUR abgesichert)	EUR	-	97,59
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	GBP	-	92,40
Klasse I Thes.	USD	-	91,39

Mindestanlage bei Erstzeichnung, Mindestanlage bei weiteren Zeichnungen und Mindestanlagebestand

Teilfonds	Anteilsklassen	Mindestanlage bei Erstzeichnung	Mindestanlage bei Folgezeichnungen	Mindestanlagebestand
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*- und Y1*-Anteile	USD 100.000.000	USD 2.500.000	USD 100.000.000
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 Sirios 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 UK Dynamic Absolute Return Fund	C- und K-Anteile	GBP 10.000	GBP 5.000	GBP 10.000
	I-Anteile	GBP 5.000.000	GBP 2.500.000	GBP 5.000.000
	R-Anteile	Entfallt	Entfallt	Entfallt

* Fur nahere Angaben zu den Kapitalmanahmen, die wahrend des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

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

Teilfonds	Anteilklassen	Mindestanlage bei Erstzeichnung	Mindestanlage bei Folgezeichnungen	Mindestanlagebestand
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.

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 bis zu vier Dezimalstellen gerundet. Nähere Angaben zu den Regeln für die Bewertung des Gesamtvermögens finden Sie im aktuellen Verkaufsprospekt.

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.

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

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 2022 wurde die Fair-Value-Anpassung auf die folgenden Wertpapiere angewandt:

Teilfonds	Wertpapiername
Schroder GAIA Cat Bond	Voussoir Re perpetual, variabel
Schroder GAIA Helix	CFD auf MAGNIT PJSC CFD auf TRINITY LIMITED Fix Price Group Softline Holding
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 Dividenderträge 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.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

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	Managementgebühr
Schroder GAIA BlueTrend	A-Anteile	1,60 %
	C-, E- und N-Anteile	1,00 %
	I*-Anteile	Entfällt
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 %)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	1,00 %
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Egerton Equity	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C- und E-Anteile	1,25 %
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25 % (1,25 %)
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Helix	A-Anteile	2,00 %
	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
Schroder GAIA Oaktree Credit	A2-Anteile	1,25 %
	C-Anteile	0,75 %
	E-Anteile	0,60 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Sirios US Equity	A-Anteile	2,00 %
	C-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	1,00 %
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25 % (1,25 %)
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C-Anteile	1,40 %
	K-Anteile	1,90 %
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	C- und R-Anteile	0,75 %
	K-Anteile	1,25 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A- und A1*-Anteile	2,00 %
	C- und C1-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	0,75 %
	I*-Anteile	Entfällt

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

Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

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

* 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 2022 (Forts.)

Performancegebühren

Die an die Wertentwicklung gebundene Gebühr («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 während des Geschäftsjahres pro Anteilsklasse erhobenen Performancegebühren sind auf den Seiten 150–151 aufgeführt.

Teilfonds	Anlageverwalter	Benchmark
Schroder GAIA BlueTrend	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend BRL Abgesichert	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend CHF Abgesichert	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend EUR Abgesichert	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend GBP Abgesichert	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA Cat Bond*	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond (in CHF abgesichert)*	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond (in EUR abgesichert)*	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond (in GBP abgesichert)*	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Contour Tech Equity	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity CHF Abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity EUR Abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity GBP Abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity SEK Abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity SGD Abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Egerton Equity	Egerton Capital (UK) LLP	Euro Short-Term Rate (ESTR) + 1,00 %
Schroder GAIA Egerton Equity GBP Abgesichert	Egerton Capital (UK) LLP	Euro Short-Term Rate (ESTR) + 1,00 %
Schroder GAIA Egerton Equity 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 CHF Abgesichert	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)**
Schroder GAIA Helix EUR Abgesichert	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)**
Schroder GAIA Helix GBP Abgesichert	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)**
Schroder GAIA Helix JPY Abgesichert	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)**
Schroder GAIA Helix SEK Abgesichert	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)**
Schroder GAIA Helix SGD Abgesichert	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)**
Schroder GAIA Sirios US Equity	Sirios Capital Management LP	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Sirios US Equity CHF Abgesichert	Sirios Capital Management LP	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Sirios US Equity EUR Abgesichert	Sirios Capital Management LP	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Sirios US Equity GBP Abgesichert	Sirios Capital Management LP	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified CHF Abgesichert	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified EUR Abgesichert	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified GBP Abgesichert	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund CHF Abgesichert	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund EUR Abgesichert	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund USD Abgesichert	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Wellington Pagosa BRL Abgesichert	Wellington Management International Limited	Brazil CETIP DI Interbank Deposit Rate
Schroder GAIA Wellington Pagosa CHF Abgesichert	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Wellington Pagosa EUR Abgesichert	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Wellington Pagosa GBP Abgesichert	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Wellington Pagosa SGD Abgesichert	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)

Für den Schroder GAIA Contour Tech Equity, den Schroder GAIA Egerton Equity, den Schroder GAIA Two Sigma Diversified und den Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund beträgt die Performancegebühr 20 % der Outperformance.

Für den Schroder GAIA Helix, den Schroder GAIA Sirios US Equity und den 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 den Schroder GAIA BlueTrend beträgt die Performancegebühr 10 % der Outperformance.

Für den Schroder GAIA Cat Bond und den Schroder GAIA Oaktree Credit wird keine Performancegebühr erhoben (mit Ausnahme von Schroder GAIA Cat Bond PI-Anteilen, für die sich die Gebühr auf 10 % der Outperformance beläuft).

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

** Mit Wirkung zum 1. März 2022 wurde für den Schroder GAIA Helix die Secured Overnight Financing Rate (SOFR) als Benchmark eingeführt.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

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.

Zum 30. September 2022 waren die folgenden Teilfonds in Devisenterminkontrakten engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Absicherung des Portfolios					
AUD	29.800.000	USD	19.900.566	19. Okt. 2022	(835.691)
AUD	3.025.000	USD	1.990.529	21. Okt. 2022	(55.200)
BRL	2.578.550	USD	491.635	21. Okt. 2022	(15.688)
BRL	97.924.007	USD	18.540.287	21. Dez. 2022	(711.643)
CAD	20.116.480	USD	15.056.212	19. Okt. 2022	(493.858)
CAD	2.860.000	USD	2.086.277	21. Okt. 2022	(15.932)
CHF	20.610.629	USD	21.417.568	19. Okt. 2022	(501.015)
CHF	18.775.000	USD	19.371.931	21. Okt. 2022	(314.751)
CLP	3.894.434.989	USD	4.196.486	21. Dez. 2022	(232.927)
CNH	13.055.206	USD	1.835.680	11. Okt. 2022	(6.861)
CNH	122.541.805	USD	17.306.016	19. Okt. 2022	(137.883)
CNH	47.693	USD	6.638	16. Nov. 2022	47
EUR	23.100.000	USD	22.753.757	19. Okt. 2022	(90.788)
EUR	5.239.000	USD	5.119.826	21. Okt. 2022	20.793
GBP	15.300.000	USD	16.864.169	19. Okt. 2022	224.694
GBP	1.950.000	USD	2.135.390	21. Okt. 2022	42.702
HKD	21.245.000	USD	2.708.049	21. Okt. 2022	(395)
HUF	2.930.954.185	USD	7.133.688	19. Okt. 2022	(373.928)
IDR	57.622.883.059	USD	3.858.601	21. Dez. 2022	(84.284)
ILS	357.393	USD	100.146	06. Okt. 2022	91
ILS	8.263.709	USD	2.389.997	19. Okt. 2022	(69.484)
INR	3.156.814.697	USD	39.151.725	21. Dez. 2022	(636.253)
JPY	2.159.954.478	USD	15.060.352	19. Okt. 2022	(115.214)
JPY	117.170.000	USD	811.805	21. Okt. 2022	(926)
KRW	23.076.735.059	USD	16.743.447	21. Dez. 2022	(562.419)
MXN	574.827.189	USD	28.704.436	19. Okt. 2022	(242.620)
NOK	112.983.668	USD	10.840.261	19. Okt. 2022	(463.315)
NZD	20.400.000	USD	11.630.865	19. Okt. 2022	(213.387)
PHP	483.771.779	USD	8.247.879	21. Dez. 2022	(10.941)
PLN	44.682.364	USD	9.298.161	19. Okt. 2022	(305.756)
SEK	184.150.368	USD	16.619.338	19. Okt. 2022	(14.551)
SEK	12.815.000	USD	1.175.969	21. Okt. 2022	(20.337)
SGD	51.498.192	USD	36.215.124	19. Okt. 2022	(353.996)
SGD	3.450.000	USD	2.409.370	21. Okt. 2022	(6.895)
SGD	84.635	USD	58.818	16. Nov. 2022	137

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
THB	861.773.292	USD	23.017.045	19. Okt. 2022	(154.087)
THB	4.676.907	USD	123.906	16. Nov. 2022	390
TWD	1.038.217.887	USD	33.720.632	21. Dez. 2022	(819.199)
USD	26.292.360	AUD	39.100.000	19. Okt. 2022	1.277.709
USD	2.864.804	AUD	4.330.000	21. Okt. 2022	94.564
USD	490.623	BRL	2.578.550	21. Okt. 2022	14.676
USD	150.666	BRL	792.523	22. Nov. 2022	5.425
USD	14.785.437	BRL	79.792.513	21. Dez. 2022	257.923
USD	30.215.701	CAD	39.855.096	19. Okt. 2022	1.364.529
USD	2.424.181	CAD	3.245.000	21. Okt. 2022	75.134
USD	32.171.874	CHF	31.229.376	19. Okt. 2022	478.956
USD	19.520.183	CHF	19.030.000	21. Okt. 2022	204.170
USD	10.310.599	CLP	9.874.189.574	21. Dez. 2022	261.148
USD	1.835.869	CNH	13.055.206	11. Okt. 2022	7.050
USD	17.722.269	CNH	122.541.805	19. Okt. 2022	554.137
USD	6.760.150	CNH	48.268.875	16. Nov. 2022	(5.720)
USD	9.227	CZK	230.000	21. Okt. 2022	79
USD	43.219.650	EUR	43.400.000	19. Okt. 2022	640.744
USD	3.917.009	EUR	3.950.000	21. Okt. 2022	41.185
USD	18.794.729	GBP	16.400.000	19. Okt. 2022	477.255
USD	334.819	GBP	295.000	21. Okt. 2022	5.313
USD	806.633	GBP	700.000	21. Juni 2023	27.133
USD	2.075.294	HKD	16.280.000	21. Okt. 2022	425
USD	11.158.372	HUF	4.471.573.656	19. Okt. 2022	845.429
USD	5.156	HUF	2.125.000	21. Okt. 2022	258
USD	7.542.958	IDR	112.965.132.368	21. Dez. 2022	143.705
USD	13.966	ILS	49.516	06. Okt. 2022	78
USD	14.323.344	ILS	49.029.784	19. Okt. 2022	555.412
USD	40.522.107	INR	3.272.285.576	21. Dez. 2022	597.805
USD	37.920.384	JPY	5.471.988.988	19. Okt. 2022	58.643
USD	1.228.149	JPY	175.925.000	21. Okt. 2022	10.654
USD	3.062.800	KRW	4.269.343.884	21. Okt. 2022	77.803
USD	27.969.034	KRW	37.425.155.930	21. Dez. 2022	1.727.127
USD	8.167.991	MXN	166.448.962	19. Okt. 2022	(73.510)
USD	23.963.216	NOK	241.404.812	19. Okt. 2022	1.791.474
USD	21.496.063	NZD	35.900.000	19. Okt. 2022	1.403.535
USD	14.710	NZD	25.000	21. Okt. 2022	718
USD	15.503.567	PHP	876.341.096	21. Dez. 2022	582.550
USD	15.150.159	PLN	72.014.271	19. Okt. 2022	657.158
USD	88.307	PLN	425.000	21. Okt. 2022	2.806
USD	38.156.921	SEK	406.313.900	19. Okt. 2022	1.519.708
USD	1.256.163	SEK	13.560.000	21. Okt. 2022	33.348
USD	36.782.490	SGD	51.498.192	19. Okt. 2022	921.363
USD	2.419.421	SGD	3.465.000	21. Okt. 2022	6.500
USD	17.117.871	SGD	24.600.280	16. Nov. 2022	(18.174)
USD	23.650.896	THB	861.773.292	19. Okt. 2022	787.935
USD	385.464	THB	14.200.922	21. Okt. 2022	8.670
USD	9.790.832	THB	371.486.276	16. Nov. 2022	(82.097)
USD	151.355	TRY	2.855.000	21. Okt. 2022	1.100
USD	45.744.038	TWD	1.384.595.751	21. Dez. 2022	1.865.788

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
USD	15.788.977	ZAR	275.389.165	19. Okt. 2022	595.268
USD	3.514.611	ZAR	63.175.000	21. Okt. 2022	29.794
ZAR	130.469.192	USD	7.379.564	19. Okt. 2022	(181.346)
ZAR	58.010.000	USD	3.242.209	21. Okt. 2022	(42.300)
					USD 12.037.667
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	240.692.929	USD	45.870.288	31. Okt. 2022	(1.551.111)
CHF	2.021.169	USD	2.065.599	31. Okt. 2022	(12.168)
EUR	107.235.692	USD	104.793.019	31. Okt. 2022	504.775
GBP	116.746.740	USD	130.419.158	31. Okt. 2022	13.053
SEK	38.982.139	USD	3.493.998	31. Okt. 2022	22.965
USD	511.236	BRL	2.773.086	31. Okt. 2022	623
USD	1.537	CHF	1.497	31. Okt. 2022	16
USD	904	EUR	919	31. Okt. 2022	2
USD	126.658	GBP	116.695	31. Okt. 2022	(3.717)
USD	-	SEK	3	31. Okt. 2022	-
					USD (1.025.562)
					USD 11.012.105
Schroder GAIA Cat Bond					
Absicherung des Portfolios					
USD	66.981.293	EUR	65.750.000	26. Okt. 2022	2.442.746
					USD 2.442.746
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	243.113.491	USD	248.422.989	31. Okt. 2022	(1.428.722)
EUR	709.526.237	USD	693.598.520	31. Okt. 2022	3.105.578
GBP	8.150.655	USD	8.868.577	31. Okt. 2022	237.526
JPY	1.285.994	USD	9.032	31. Okt. 2022	(124)
SEK	6.830.469.210	USD	612.580.622	31. Okt. 2022	3.663.300
SGD	388.369	USD	273.003	31. Okt. 2022	(2.530)
USD	28.128.685	CHF	27.533.066	31. Okt. 2022	156.114
USD	39.490.800	EUR	40.640.642	31. Okt. 2022	(415.408)
USD	51	GBP	46	31. Okt. 2022	-
USD	1.338.045	SEK	15.077.092	31. Okt. 2022	(22.208)
					USD 5.293.526
					USD 7.736.272
Schroder GAIA Contour Tech Equity					
Absicherung des Portfolios					
AUD	3.157.878	USD	2.164.325	10. Nov. 2022	(143.394)
EUR	1.096.257	USD	1.116.353	10. Nov. 2022	(39.131)
GBP	92.040	USD	99.679	10. Nov. 2022	3.160
JPY	369.394.679	USD	2.677.377	10. Nov. 2022	(115.677)
NOK	43.986.349	USD	4.477.743	10. Nov. 2022	(436.209)
USD	2.592.131	AUD	3.815.116	10. Nov. 2022	150.591
USD	1.116.918	EUR	1.096.257	10. Nov. 2022	39.696
USD	473.908	GBP	427.901	10. Nov. 2022	(4.197)
USD	2.852.525	JPY	395.338.523	10. Nov. 2022	110.908
USD	4.365.282	NOK	43.499.075	10. Nov. 2022	368.521
					USD (65.732)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2.828.495	USD	2.890.313	31. Okt. 2022	(16.667)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)					
EUR	64.701.074	USD	63.264.923	31. Okt. 2022	266.912
GBP	15.385.498	USD	17.217.014	31. Okt. 2022	(27.973)
SEK	122.231.890	USD	10.960.364	31. Okt. 2022	67.379
SGD	774.906	USD	544.640	31. Okt. 2022	(4.969)
USD	11.083	CHF	10.838	31. Okt. 2022	71
USD	3.282.841	EUR	3.364.163	31. Okt. 2022	(20.526)
USD	300.739	GBP	275.035	31. Okt. 2022	(6.537)
USD	49.968	SEK	557.644	31. Okt. 2022	(342)
USD	1.870	SGD	2.663	31. Okt. 2022	15
					USD 257.363
					USD 191.631
Schroder GAIA Egerton Equity					
Absicherung des Portfolios					
CHF	6.069.000	EUR	6.239.077	13. Okt. 2022	38.034
CNY	23.531.000	EUR	3.403.532	14. Okt. 2022	(18.636)
EUR	58.088.038	CAD	75.601.000	13. Okt. 2022	2.279.732
EUR	2.231.069	GBP	1.939.000	13. Okt. 2022	22.948
EUR	4.104.135	HKD	31.865.000	13. Okt. 2022	(36.312)
EUR	13.242.208	JPY	1.867.244.000	13. Okt. 2022	75.228
EUR	5.910.360	SEK	63.296.000	13. Okt. 2022	92.020
EUR	501.848.047	USD	497.096.000	13. Okt. 2022	(5.052.938)
GBP	1.939.000	EUR	2.202.968	13. Okt. 2022	5.153
JPY	970.228.000	EUR	6.971.837	13. Okt. 2022	(130.218)
USD	59.441.000	EUR	60.725.308	13. Okt. 2022	(111.862)
					EUR (2.836.851)
Absicherung der Anteilsklasse					
EUR	1.461.111	GBP	1.311.605	31. Okt. 2022	(31.211)
EUR	5.324.168	USD	5.166.459	31. Okt. 2022	62.629
GBP	59.798.931	EUR	68.491.848	31. Okt. 2022	(453.547)
USD	216.907.356	EUR	221.820.231	31. Okt. 2022	(921.005)
					EUR (1.343.134)
					EUR (4.179.985)
Schroder GAIA Helix					
Absicherung des Portfolios					
AUD	27.537.000	USD	19.161.922	17. Nov. 2022	(1.446.213)
CAD	3.221.000	USD	2.503.815	17. Nov. 2022	(159.739)
CHF	10.528.000	EUR	10.849.854	17. Nov. 2022	78.935
CHF	9.213.000	USD	9.651.257	17. Nov. 2022	(251.560)
DKK	37.048.000	EUR	4.978.285	17. Nov. 2022	4.736
DKK	31.369.000	USD	4.320.448	17. Nov. 2022	(174.086)
EUR	4.112.789	CHF	3.915.000	17. Nov. 2022	47.399
EUR	4.591.917	DKK	34.146.000	17. Nov. 2022	(841)
EUR	2.035.151	GBP	1.771.927	17. Nov. 2022	20.567
EUR	1.451.871	NOK	14.888.000	17. Nov. 2022	59.676
EUR	9.099.344	SEK	96.833.000	17. Nov. 2022	197.164
EUR	124.000	USD	120.990	03. Nov. 2022	745
EUR	44.371.680	USD	45.085.053	17. Nov. 2022	(1.479.950)
GBP	1.766.135	EUR	2.084.330	17. Nov. 2022	(75.366)
GBP	31.801.639	USD	38.233.799	17. Nov. 2022	(2.708.107)
HKD	74.000	JPY	1.337.308	13. Okt. 2022	182

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)					
HKD	976.842.000	USD	124.740.102	17. Nov. 2022	(177.496)
INR	675.713.610	USD	8.409.628	17. Nov. 2022	(140.824)
JPY	4.594.069.344	USD	33.960.378	17. Nov. 2022	(2.078.907)
NOK	43.190.000	EUR	4.287.537	17. Nov. 2022	(247.482)
NOK	11.693.000	USD	1.193.407	17. Nov. 2022	(119.681)
NZD	2.600.000	USD	1.621.052	17. Nov. 2022	(150.072)
SEK	102.597.000	EUR	9.759.033	17. Nov. 2022	(324.909)
SEK	91.083.569	USD	8.878.106	17. Nov. 2022	(652.359)
SGD	19.498.000	USD	14.048.972	17. Nov. 2022	(454.097)
USD	3.840.848	AUD	5.708.000	17. Nov. 2022	168.652
USD	1.030.356	BRL	5.760.000	03. Nov. 2022	(26.554)
USD	8.235.479	BRL	44.574.533	17. Nov. 2022	80.637
USD	1.459.132	BRL	7.990.000	04. Jan. 2023	13.115
USD	492.875	CAD	673.000	17. Nov. 2022	3.100
USD	2.417.917	CHF	2.356.000	17. Nov. 2022	14.174
USD	669.454	CLP	607.985.000	21. Nov. 2022	40.107
USD	205.621	CZK	5.071.000	11. Okt. 2022	3.592
USD	2.564.370	DKK	19.178.000	17. Nov. 2022	29.417
USD	1.643.007	EUR	1.600.000	03. Nov. 2022	72.232
USD	24.630.037	EUR	24.831.200	17. Nov. 2022	227.826
USD	40.571.716	GBP	34.975.546	17. Nov. 2022	1.500.445
USD	36.341.260	HKD	284.852.000	17. Nov. 2022	18.182
USD	12.216.865	JPY	1.725.350.000	17. Nov. 2022	243.451
USD	281.209	NOK	3.001.093	17. Nov. 2022	5.630
USD	7.545	NZD	12.000	17. Nov. 2022	756
USD	411.339	PLN	1.962.000	11. Okt. 2022	14.494
USD	6.250.929	SEK	64.852.514	17. Nov. 2022	394.105
USD	762.871	SGD	1.101.000	17. Nov. 2022	(4.796)
					USD (7.433.720)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	5.887.090	USD	6.015.786	31. Okt. 2022	(34.721)
EUR	239.144.157	USD	233.855.049	31. Okt. 2022	967.435
GBP	165.105.984	USD	184.832.552	31. Okt. 2022	(372.256)
JPY	1.224.601	USD	8.601	31. Okt. 2022	(118)
SEK	132.432	USD	11.878	31. Okt. 2022	71
SGD	29.632	USD	20.830	31. Okt. 2022	(193)
USD	34.075	CHF	33.322	31. Okt. 2022	219
USD	3.198.462	EUR	3.302.662	31. Okt. 2022	(44.515)
USD	8.208.939	GBP	7.423.834	31. Okt. 2022	(85.142)
USD	44	JPY	6.242	31. Okt. 2022	1
USD	71	SEK	792	31. Okt. 2022	-
USD	90	SGD	129	31. Okt. 2022	1
					USD 430.782
					USD (7.002.938)
Schroder GAIA Oaktree Credit					
Absicherung des Portfolios					
AUD	8.193	USD	5.302	20. Okt. 2022	(60)
EUR	518.186	USD	506.540	20. Okt. 2022	1.880
EUR	5.365	USD	5.496	19. Apr. 2023	(160)
GBP	15.537	USD	18.407	20. Okt. 2022	(1.053)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Oaktree Credit (cont)					
JPY	70.011.200	USD	513.716	11. Okt. 2022	(29.671)
JPY	21.604.428	USD	158.713	24. Okt. 2022	(9.156)
JPY	69.617.400	USD	510.859	07. Nov. 2022	(28.238)
USD	1.020.178	AUD	1.520.815	20. Okt. 2022	47.207
USD	5.018.277	EUR	4.901.525	20. Okt. 2022	209.139
USD	6.049.891	EUR	5.509.431	19. Apr. 2023	571.049
USD	2.151.462	GBP	1.805.590	20. Okt. 2022	134.717
USD	556.355	JPY	74.222.333	11. Okt. 2022	43.195
USD	213.359	JPY	29.206.183	24. Okt. 2022	11.177
USD	1.154.070	JPY	152.001.825	07. Nov. 2022	100.321
					USD 1.050.347
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	103.340	USD	105.599	31. Okt. 2022	(609)
EUR	4.555.650	USD	4.454.779	31. Okt. 2022	18.546
GBP	47.489	USD	53.163	31. Okt. 2022	(108)
USD	3.262	CHF	3.197	31. Okt. 2022	14
USD	133.790	EUR	137.292	31. Okt. 2022	(1.024)
USD	1.546	GBP	1.405	31. Okt. 2022	(22)
					USD 16.797
					USD 1.067.144
Schroder GAIA Sirios US Equity					
Absicherung des Portfolios					
CAD	395.000	USD	288.361	21. Dez. 2022	(2.299)
CHF	597.000	USD	623.871	21. Dez. 2022	(13.782)
DKK	4.014.000	USD	541.021	21. Dez. 2022	(8.508)
EUR	10.061.000	USD	9.881.511	21. Dez. 2022	41.235
SEK	4.468.000	USD	401.841	21. Dez. 2022	2.845
USD	4.006.573	CAD	5.354.000	21. Dez. 2022	129.164
USD	273.734	DKK	2.086.000	21. Dez. 2022	(3.002)
USD	15.713.777	EUR	15.677.000	21. Dez. 2022	252.203
USD	16.961.179	GBP	15.070.000	21. Dez. 2022	114.174
USD	4.997.371	SEK	54.370.000	21. Dez. 2022	72.847
					USD 584.877
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2.950.906	USD	3.015.415	31. Okt. 2022	(17.404)
EUR	45.287.078	USD	44.282.973	31. Okt. 2022	185.703
GBP	8.003.444	USD	8.959.831	31. Okt. 2022	(18.195)
USD	66.030	CHF	64.950	31. Okt. 2022	44
USD	1.905.172	EUR	1.965.096	31. Okt. 2022	(24.414)
USD	451.855	GBP	418.664	31. Okt. 2022	(15.886)
					USD 109.848
					USD 694.725
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
AUD	10.871.001	USD	7.323.922	21. Dez. 2022	(360.384)
BRL	4.831.206	USD	913.404	11. Okt. 2022	(19.490)
BRL	4.831.206	USD	897.994	31. Okt. 2022	(8.416)
CAD	6.538.571	USD	4.973.900	21. Dez. 2022	(238.614)
CHF	3.579.044	USD	3.696.433	21. Dez. 2022	(38.916)
CNH	29.696.160	USD	4.270.440	21. Dez. 2022	(104.062)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)						
CZK	7.261.459	USD	292.185	21. Dez. 2022	(4.657)	
GBP	9.115.003	USD	10.407.220	21. Dez. 2022	(217.405)	
ILS	532.724	USD	156.644	21. Dez. 2022	(6.190)	
INR	580.429	USD	7.122	06. Okt. 2022	12	
JPY	1.327.021.195	USD	9.315.697	21. Dez. 2022	(62.346)	
MXN	128.382.635	USD	6.297.309	21. Dez. 2022	(13.788)	
NOK	13.392.484	USD	1.334.940	21. Dez. 2022	(102.563)	
NZD	7.821.243	USD	4.724.602	21. Dez. 2022	(345.426)	
PLN	7.466.416	USD	1.553.839	21. Dez. 2022	(67.960)	
SEK	13.828.772	USD	1.296.791	21. Dez. 2022	(44.260)	
SGD	8.102.930	USD	5.767.864	21. Dez. 2022	(119.963)	
TWD	3.409.000	USD	107.571	06. Okt. 2022	(187)	
TWD	2.215.661	USD	71.972	21. Dez. 2022	(1.757)	
USD	6.635.444	AUD	9.846.185	21. Dez. 2022	328.363	
USD	901.832	BRL	4.831.206	11. Okt. 2022	7.918	
USD	15.697.198	CAD	20.624.804	21. Dez. 2022	760.552	
USD	1.843.697	CHF	1.784.037	21. Dez. 2022	20.544	
USD	1.796.927	CNH	12.488.100	21. Dez. 2022	44.844	
USD	66.358.214	EUR	66.000.000	21. Dez. 2022	1.265.155	
USD	11.691.230	GBP	10.156.925	21. Dez. 2022	336.633	
USD	587.499	HUF	239.934.747	21. Dez. 2022	43.973	
USD	560.138	ILS	1.908.000	21. Dez. 2022	21.271	
USD	7.256	INR	580.429	06. Okt. 2022	122	
USD	7.104	INR	580.429	31. Okt. 2022	(10)	
USD	14.118.250	JPY	2.012.791.505	21. Dez. 2022	83.006	
USD	2.602.274	KRW	3.600.506.566	21. Dez. 2022	77.658	
USD	2.916.812	MXN	59.478.178	21. Dez. 2022	5.730	
USD	2.382.090	NOK	23.824.536	21. Dez. 2022	189.753	
USD	2.004.398	NZD	3.319.081	21. Dez. 2022	146.018	
USD	553.902	PLN	2.659.426	21. Dez. 2022	24.654	
USD	1.658.866	SEK	17.694.924	21. Dez. 2022	56.161	
USD	3.480.753	SGD	4.906.313	21. Dez. 2022	60.957	
USD	111.814	TWD	3.409.000	06. Okt. 2022	4.431	
USD	107.602	TWD	3.409.000	31. Okt. 2022	76	
USD	1.368.752	ZAR	23.953.911	21. Dez. 2022	54.616	
ZAR	27.635.984	USD	1.574.336	21. Dez. 2022	(58.198)	
					USD	1.717.855
Absicherung der Anteilsklasse						
CHF	4.263.396	USD	4.356.787	31. Okt. 2022	(25.335)	
EUR	148.207.306	USD	144.921.926	31. Okt. 2022	607.065	
GBP	168.863.262	USD	188.941.204	31. Okt. 2022	(283.188)	
USD	347.037	EUR	355.713	31. Okt. 2022	(2.247)	
USD	455.653	GBP	418.524	31. Okt. 2022	(11.932)	
					USD	284.363
					USD	2.002.218
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund						
Absicherung der Anteilsklasse						
CHF	362.017	GBP	332.691	31. Okt. 2022	(3.486)	
EUR	15.238.059	GBP	13.305.157	31. Okt. 2022	87.582	
GBP	3.915	CHF	4.174	31. Okt. 2022	120	

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund (Forts.)					
GBP	193.595	EUR	216.767	31. Okt. 2022	3.078
GBP	15.273	USD	16.500	31. Okt. 2022	504
USD	1.474.495	GBP	1.317.202	31. Okt. 2022	2.581
					GBP
					90.379
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Absicherung des Portfolios					
AUD	139.085.000	USD	92.186.173	07. Okt. 2022	(3.217.953)
AUD	3.560.000	USD	2.290.031	07. Nov. 2022	(11.870)
AUD	1.006.000	USD	694.643	30. Nov. 2022	(50.621)
AUD	140.000	USD	93.573	21. Dez. 2022	(3.894)
AUD	1.634.000	USD	1.063.734	28. Dez. 2022	(16.836)
BRL	71.885.000	USD	13.729.831	04. Okt. 2022	(403.851)
BRL	805.000	USD	148.465	03. Nov. 2022	(347)
BRL	3.013.000	USD	554.370	07. Nov. 2022	(452)
BRL	4.060.000	USD	774.809	18. Nov. 2022	(30.132)
BRL	17.665.000	USD	3.371.374	02. Dez. 2022	(140.792)
BRL	6.038.000	USD	1.150.373	26. Jan. 2023	(59.530)
BRL	4.825.000	USD	859.765	30. Jan. 2023	11.223
BRL	3.475.000	USD	595.544	10. Feb. 2023	30.343
CAD	250.000	USD	194.001	03. Okt. 2022	(13.019)
CAD	300.000	USD	233.448	04. Okt. 2022	(16.269)
CAD	49.313.734	USD	36.291.497	07. Okt. 2022	(592.012)
CAD	300.000	USD	232.795	11. Okt. 2022	(15.619)
CAD	350.000	USD	271.594	12. Okt. 2022	(18.223)
CAD	3.550.000	USD	2.590.914	07. Nov. 2022	(21.150)
CAD	500.000	USD	387.994	09. Nov. 2022	(26.052)
CAD	2.216.000	USD	1.665.598	21. Dez. 2022	(60.754)
CAD	1.474.000	USD	1.071.961	04. Jan. 2023	(4.206)
CHF	33.981.035	USD	34.810.459	07. Okt. 2022	(362.374)
CHF	9.065.000	USD	9.238.480	07. Nov. 2022	(22.373)
CHF	813.000	USD	839.227	21. Dez. 2022	(8.402)
CLP	12.351.331.000	USD	13.132.805	07. Okt. 2022	(376.631)
CLP	837.005.000	USD	855.833	12. Okt. 2022	8.150
CLP	1.198.563.000	USD	1.156.914	14. Okt. 2022	79.836
CLP	144.483.000	USD	151.927	20. Okt. 2022	(3.002)
CLP	961.191.000	USD	1.057.998	03. Nov. 2022	(69.738)
CLP	195.100.000	USD	202.491	07. Nov. 2022	(2.063)
CLP	1.176.713.000	USD	1.344.815	07. Dez. 2022	(143.507)
CLP	2.112.027.000	USD	2.228.349	21. Dez. 2022	(78.834)
CLP	1.883.466.000	USD	1.893.250	27. Dez. 2022	21.114
CNH	17.713.000	USD	2.469.551	07. Nov. 2022	12.812
CNH	70.783.000	USD	10.097.790	21. Dez. 2022	(166.920)
CNY	2.156.000	USD	303.054	21. Dez. 2022	2.104
COP	10.821.200.000	USD	2.409.168	07. Okt. 2022	(63.158)
COP	1.869.162.000	USD	485.497	11. Okt. 2022	(80.570)
COP	2.556.261.000	USD	574.402	12. Okt. 2022	(20.742)
COP	10.644.689.000	USD	2.333.850	04. Nov. 2022	(39.301)
COP	3.884.046.000	USD	862.546	16. Dez. 2022	(31.670)
COP	5.651.950.000	USD	1.253.615	21. Dez. 2022	(45.580)
CZK	593.031.880	USD	24.050.181	07. Okt. 2022	(427.660)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
CZK	7.640.000	USD	306.833	21. Dez. 2022	(4.315)
DKK	178.000	USD	23.168	28. Okt. 2022	336
DKK	2.890.000	USD	391.152	21. Dez. 2022	(7.754)
EUR	141.538.000	USD	140.553.672	07. Okt. 2022	(1.811.060)
EUR	4.160.000	USD	4.224.484	11. Okt. 2022	(145.538)
EUR	793.000	USD	794.269	14. Okt. 2022	(16.552)
EUR	4.983.000	USD	4.812.178	28. Okt. 2022	79.714
EUR	1.657.000	USD	1.599.012	31. Okt. 2022	28.044
EUR	2.698.000	USD	2.608.966	02. Nov. 2022	40.660
EUR	42.458.000	USD	41.114.385	07. Nov. 2022	597.351
EUR	1.476.000	USD	1.489.579	01. Dez. 2022	(37.012)
EUR	1.921.000	USD	1.867.945	16. Dez. 2022	25.593
EUR	177.000	USD	177.885	19. Dez. 2022	(3.357)
EUR	8.584.000	USD	8.533.643	21. Dez. 2022	(67.600)
EUR	2.398.000	USD	2.315.029	05. Jan. 2023	53.679
GBP	47.831.000	USD	54.150.079	07. Okt. 2022	(740.979)
GBP	836.000	USD	1.052.932	11. Okt. 2022	(119.357)
GBP	986.000	USD	1.057.081	28. Okt. 2022	44.427
GBP	40.440.000	USD	43.593.291	07. Nov. 2022	1.590.964
GBP	3.897.000	USD	4.473.439	21. Dez. 2022	(116.917)
GBP	1.663.000	USD	1.779.077	05. Jan. 2023	80.471
HKD	4.338.000	USD	552.682	07. Okt. 2022	(2)
HKD	4.045.000	USD	516.204	21. Dez. 2022	(182)
HUF	5.545.372.000	USD	13.458.581	07. Okt. 2022	(622.802)
HUF	153.700.000	USD	366.314	17. Okt. 2022	(11.610)
HUF	682.816.000	USD	1.680.571	28. Okt. 2022	(110.170)
HUF	292.672.000	USD	671.882	07. Nov. 2022	(812)
HUF	217.984.000	USD	536.048	21. Nov. 2022	(38.281)
HUF	73.066.000	USD	175.800	19. Dez. 2022	(10.201)
HUF	1.919.819.000	USD	4.677.553	21. Dez. 2022	(328.572)
HUF	764.073.000	USD	1.766.847	27. Dez. 2022	(38.567)
HUF	537.588.000	USD	1.215.410	09. Jan. 2023	(3.406)
IDR	55.203.000.000	USD	3.677.963	07. Okt. 2022	(53.052)
IDR	18.770.000.000	USD	1.252.837	21. Dez. 2022	(23.396)
IDR	104.598.000.000	USD	7.062.660	21. Feb. 2023	(226.934)
ILS	2.155.000	USD	619.354	03. Okt. 2022	(15.078)
ILS	16.920.629	USD	5.001.906	07. Okt. 2022	(255.733)
ILS	8.993.773	USD	2.571.041	07. Nov. 2022	(41.404)
ILS	1.135.000	USD	342.642	02. Dez. 2022	(22.708)
ILS	3.715.000	USD	1.106.258	21. Dez. 2022	(57.049)
INR	1.658.485.000	USD	20.536.988	07. Okt. 2022	(156.713)
INR	124.159.000	USD	1.553.191	07. Nov. 2022	(32.382)
INR	60.945.000	USD	758.494	18. Nov. 2022	(12.773)
INR	297.269.000	USD	3.652.590	21. Dez. 2022	(25.689)
INR	144.217.000	USD	1.746.603	05. Jan. 2023	10.868
JPY	14.390.348.669	USD	101.078.160	07. Okt. 2022	(1.622.111)
JPY	2.151.615.226	USD	14.934.711	07. Nov. 2022	(18.700)
JPY	418.600.000	USD	2.938.369	21. Dez. 2022	(19.461)
KRW	26.346.800.000	USD	19.115.140	07. Okt. 2022	(698.991)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
KRW	1.123.414.000	USD	889.516	04. Nov. 2022	(103.828)
KRW	2.605.713.000	USD	1.892.292	07. Nov. 2022	(69.724)
KRW	1.234.335.000	USD	918.062	30. Nov. 2022	(53.988)
KRW	262.509.000	USD	189.469	13. Dez. 2022	(5.527)
KRW	3.355.952.000	USD	2.401.816	21. Dez. 2022	(48.677)
MXN	7.870.000	USD	388.259	06. Okt. 2022	2.373
MXN	637.533.638	USD	31.605.148	07. Okt. 2022	33.431
MXN	46.241.000	USD	2.309.798	14. Okt. 2022	(18.020)
MXN	522.718.641	USD	25.822.837	07. Nov. 2022	(35.345)
MXN	61.573.000	USD	3.018.144	21. Dez. 2022	(4.535)
NOK	236.491.000	USD	23.546.056	07. Okt. 2022	(1.827.048)
NOK	104.785.000	USD	9.602.299	07. Nov. 2022	24.515
NZD	84.180.000	USD	50.599.628	07. Okt. 2022	(3.487.445)
NZD	35.183.000	USD	19.878.783	07. Nov. 2022	(186.489)
NZD	1.223.000	USD	750.922	30. Nov. 2022	(66.271)
NZD	28.000	USD	16.496	21. Dez. 2022	(818)
NZD	1.845.000	USD	1.082.093	28. Dez. 2022	(49.003)
PEN	14.898.000	USD	3.744.627	07. Okt. 2022	(6.477)
PEN	1.660.000	USD	422.166	21. Dez. 2022	(9.233)
PHP	187.830.000	USD	3.171.197	07. Okt. 2022	32.480
PHP	108.221.000	USD	1.913.722	02. Dez. 2022	(70.209)
PHP	105.448.000	USD	1.803.247	21. Dez. 2022	(7.837)
PHP	128.521.000	USD	2.158.203	04. Jan. 2023	29.272
PLN	102.255.000	USD	21.524.751	07. Okt. 2022	(904.845)
PLN	2.686.000	USD	563.373	11. Okt. 2022	(22.048)
PLN	51.985.000	USD	10.263.027	07. Nov. 2022	165.099
PLN	73.540.000	USD	16.154.209	17. Nov. 2022	(1.424.715)
PLN	2.619.000	USD	556.642	21. Nov. 2022	(32.397)
PLN	16.667.000	USD	3.470.783	21. Dez. 2022	(153.912)
PLN	2.264.000	USD	475.760	22. Dez. 2022	(25.305)
PLN	6.231.000	USD	1.222.220	09. Jan. 2023	13.342
PLN	9.086.000	USD	1.874.220	12. Jan. 2023	(73.266)
RON	2.520.000	USD	510.328	21. Dez. 2022	(16.591)
SEK	161.183.117	USD	14.946.682	07. Okt. 2022	(420.729)
SEK	125.086.000	USD	11.053.009	07. Nov. 2022	236.511
SGD	14.573.571	USD	10.169.826	07. Okt. 2022	(22.569)
SGD	920.000	USD	657.333	21. Dez. 2022	(16.074)
THB	565.859.400	USD	14.914.586	07. Okt. 2022	88.821
THB	80.145.000	USD	2.189.535	17. Okt. 2022	(63.507)
THB	73.107.000	USD	1.994.190	02. Nov. 2022	(53.186)
THB	12.329.000	USD	337.134	19. Dez. 2022	(8.431)
THB	146.346.000	USD	3.985.121	21. Dez. 2022	(82.458)
THB	26.860.000	USD	713.982	05. Jan. 2023	3.557
TRY	49.226.000	USD	2.624.046	07. Okt. 2022	23.585
TRY	296.000	USD	15.191	07. Nov. 2022	24
TRY	24.760.000	USD	1.315.167	14. Nov. 2022	(53.717)
TRY	5.247.000	USD	257.332	21. Nov. 2022	7.646
TRY	4.027.000	USD	201.855	21. Dez. 2022	(5.258)
TWD	760.656.000	USD	24.237.294	07. Okt. 2022	(275.376)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
TWD	16.955.000	USD	533.069	28. Okt. 2022	1.634
TWD	25.610.000	USD	804.082	07. Nov. 2022	4.092
TWD	42.470.000	USD	1.355.996	21. Dez. 2022	(10.110)
USD	94.257.565	AUD	139.085.000	07. Okt. 2022	5.289.342
USD	45.224.507	AUD	69.865.000	07. Nov. 2022	515.599
USD	264.835	AUD	407.000	30. Nov. 2022	4.281
USD	2.609.594	AUD	3.921.000	21. Dez. 2022	97.954
USD	13.608.375	BRL	71.885.000	04. Okt. 2022	282.394
USD	8.312.460	BRL	45.162.000	03. Nov. 2022	2.755
USD	1.875.474	BRL	9.941.000	02. Dez. 2022	57.460
USD	902.057	BRL	4.605.000	10. Feb. 2023	72.644
USD	596.820	CAD	750.000	03. Okt. 2022	53.873
USD	460.718	CAD	600.000	04. Okt. 2022	26.360
USD	36.950.158	CAD	49.240.897	07. Okt. 2022	1.303.401
USD	1.082.766	CAD	1.400.000	11. Okt. 2022	69.277
USD	732.874	CAD	950.000	12. Okt. 2022	45.151
USD	541.468	CAD	700.000	13. Okt. 2022	34.726
USD	385.882	CAD	500.000	17. Okt. 2022	23.928
USD	2.633.725	CAD	3.450.000	19. Okt. 2022	136.262
USD	1.087.036	CAD	1.395.000	25. Okt. 2022	77.213
USD	857.338	CAD	1.100.000	27. Okt. 2022	61.067
USD	1.475.860	CAD	1.975.000	28. Okt. 2022	46.197
USD	80.000	CAD	100.000	01. Nov. 2022	7.613
USD	1.162.335	CAD	1.500.000	02. Nov. 2022	76.534
USD	26.837.732	CAD	36.818.903	07. Nov. 2022	185.372
USD	534.359	CAD	700.000	08. Nov. 2022	27.642
USD	945.550	CAD	1.200.000	09. Nov. 2022	76.891
USD	872.342	CAD	1.150.000	10. Nov. 2022	39.873
USD	382.664	CAD	500.000	15. Nov. 2022	20.713
USD	1.880.125	CAD	2.450.000	16. Nov. 2022	106.558
USD	1.129.450	CAD	1.500.000	18. Nov. 2022	43.585
USD	770.746	CAD	1.000.000	22. Nov. 2022	46.824
USD	769.902	CAD	1.000.000	28. Nov. 2022	45.961
USD	234.054	CAD	300.000	01. Dez. 2022	16.869
USD	1.458.982	CAD	1.910.000	06. Dez. 2022	76.146
USD	792.130	CAD	1.047.000	07. Dez. 2022	34.090
USD	7.099.187	CAD	9.457.000	21. Dez. 2022	250.354
USD	256.388	CAD	340.000	6. März 2023	9.921
USD	594.777	CAD	750.000	10. Apr. 2023	50.864
USD	317.158	CAD	400.000	11. Mai 2023	26.933
USD	533.649	CAD	700.000	15. Aug. 2023	25.085
USD	763.302	CAD	1.000.000	01. Sept. 2023	36.633
USD	989.996	CAD	1.300.000	08. Sept. 2023	45.247
USD	228.482	CAD	310.000	25. Sept. 2023	3.150
USD	34.820.357	CHF	33.968.598	07. Okt. 2022	384.882
USD	9.797.241	CHF	9.619.764	07. Nov. 2022	17.121
USD	335.630	CHF	320.000	21. Dez. 2022	8.614
USD	13.884.026	CLP	12.351.331.000	07. Okt. 2022	1.127.851
USD	562.231	CLP	485.768.000	12. Okt. 2022	60.806

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	723.409	CLP	654.794.000	14. Okt. 2022	47.753
USD	273.516	CLP	257.981.000	20. Okt. 2022	7.603
USD	387.756	CLP	382.909.000	03. Nov. 2022	(5.936)
USD	5.810.411	CLP	5.598.331.000	07. Nov. 2022	59.193
USD	399.157	CLP	356.048.000	01. Dez. 2022	35.195
USD	863.950	CLP	813.409.000	07. Dez. 2022	33.540
USD	3.193.176	CLP	3.097.727.000	21. Dez. 2022	40.466
USD	3.662.986	CNH	25.542.000	14. Okt. 2022	84.813
USD	28.597.815	CNH	204.633.635	07. Nov. 2022	(80.268)
USD	2.200.175	CNH	15.702.000	16. Dez. 2022	(2.475)
USD	4.590.943	CNH	32.043.000	21. Dez. 2022	95.303
USD	172.650	CNH	1.236.000	29. Dez. 2022	(805)
USD	1.003.908	CNY	7.121.000	21. Dez. 2022	(3.990)
USD	2.385.910	COP	10.821.200.000	07. Okt. 2022	39.900
USD	56.729	COP	252.420.000	11. Okt. 2022	2.046
USD	858.579	COP	3.814.325.000	12. Okt. 2022	32.435
USD	880.738	COP	4.056.000.000	04. Nov. 2022	6.435
USD	182.331	COP	824.200.000	21. Dez. 2022	6.168
USD	23.899.338	CZK	591.553.364	07. Okt. 2022	335.713
USD	9.380.460	CZK	240.487.681	07. Nov. 2022	(166.853)
USD	3.691.973	CZK	92.408.000	21. Dez. 2022	32.944
USD	524.051	DKK	3.875.000	21. Dez. 2022	9.979
USD	140.790.203	EUR	141.538.000	07. Okt. 2022	2.047.588
USD	2.070.277	EUR	2.048.000	11. Okt. 2022	62.179
USD	33.496.233	EUR	34.617.000	28. Okt. 2022	(487.849)
USD	5.351.666	EUR	5.545.000	31. Okt. 2022	(93.127)
USD	1.243.457	EUR	1.209.000	02. Nov. 2022	56.133
USD	33.744.135	EUR	34.875.000	07. Nov. 2022	(517.883)
USD	630.875	EUR	656.000	01. Dez. 2022	(14.710)
USD	21.855.790	EUR	21.874.000	21. Dez. 2022	282.372
USD	475.601	EUR	472.000	22. Dez. 2022	10.035
USD	1.352.324	EUR	1.393.000	27. Dez. 2022	(22.461)
USD	53.557.036	GBP	47.831.000	07. Okt. 2022	147.934
USD	1.046.129	GBP	836.000	11. Okt. 2022	112.553
USD	10.278.148	GBP	9.504.000	28. Okt. 2022	(339.223)
USD	20.675.653	GBP	19.104.000	07. Nov. 2022	(669.550)
USD	4.090.791	GBP	3.585.000	21. Dez. 2022	83.060
USD	553.033	HKD	4.338.000	07. Okt. 2022	354
USD	899.890	HKD	7.060.000	28. Okt. 2022	(56)
USD	789.534	HKD	6.193.000	07. Nov. 2022	(64)
USD	1.599.762	HKD	12.536.000	21. Dez. 2022	538
USD	13.557.027	HUF	5.545.372.000	07. Okt. 2022	721.246
USD	976.929	HUF	399.173.000	17. Okt. 2022	55.729
USD	964.343	HUF	410.810.000	28. Okt. 2022	19.525
USD	8.087.963	HUF	3.488.774.000	07. Nov. 2022	88.518
USD	227.813	HUF	99.782.000	21. Nov. 2022	(40)
USD	5.373.269	HUF	2.290.958.000	21. Dez. 2022	183.543
USD	3.689.520	IDR	55.203.000.000	07. Okt. 2022	64.609
USD	2.626.794	IDR	40.025.000.000	07. Nov. 2022	1.217

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	3.407.630	IDR	51.274.000.000	21. Dez. 2022	49.167
USD	7.141.989	IDR	104.598.000.000	21. Feb. 2023	306.263
USD	2.160.445	ILS	7.315.000	03. Okt. 2022	109.272
USD	4.981.040	ILS	16.971.921	07. Okt. 2022	220.480
USD	1.594.335	ILS	5.635.000	07. Nov. 2022	9.404
USD	297.912	ILS	1.020.000	02. Dez. 2022	10.394
USD	4.425.092	ILS	15.335.000	21. Dez. 2022	94.105
USD	20.636.410	INR	1.658.485.000	07. Okt. 2022	256.133
USD	527.968	INR	43.230.000	28. Okt. 2022	(2.089)
USD	9.711.604	INR	799.435.000	07. Nov. 2022	(80.583)
USD	1.066.251	INR	85.960.000	21. Dez. 2022	17.475
USD	2.105.326	JPY	282.400.000	03. Okt. 2022	154.106
USD	101.270.073	JPY	14.389.125.429	07. Okt. 2022	1.822.476
USD	1.056.961	JPY	142.400.000	11. Okt. 2022	72.434
USD	2.696.599	JPY	372.100.000	17. Okt. 2022	122.468
USD	692.331	JPY	94.600.000	24. Okt. 2022	37.458
USD	1.724.802	JPY	247.500.000	28. Okt. 2022	10.804
USD	837.366	JPY	111.000.000	31. Okt. 2022	68.439
USD	13.993.460	JPY	2.010.773.000	07. Nov. 2022	53.833
USD	1.706.643	JPY	225.550.000	14. Nov. 2022	141.768
USD	2.385.203	JPY	322.550.000	21. Nov. 2022	145.536
USD	1.025.213	JPY	139.000.000	28. Nov. 2022	59.272
USD	2.758.830	JPY	383.500.000	05. Dez. 2022	91.431
USD	1.040.319	JPY	147.200.000	12. Dez. 2022	15.350
USD	4.103.772	JPY	583.000.000	19. Dez. 2022	39.785
USD	3.162.829	JPY	448.301.000	21. Dez. 2022	36.816
USD	4.631.911	JPY	657.850.000	06. Jan. 2023	33.533
USD	664.356	JPY	88.650.000	10. Jan. 2023	44.361
USD	2.146.703	JPY	307.000.000	11. Jan. 2023	(658)
USD	1.736.653	JPY	245.000.000	10. März 2023	9.635
USD	1.227.458	JPY	172.650.000	20. Apr. 2023	3.597
USD	19.305.443	KRW	26.346.800.000	07. Okt. 2022	889.295
USD	492.084	KRW	629.621.000	04. Nov. 2022	51.743
USD	4.652.929	KRW	6.675.707.000	07. Nov. 2022	(16.399)
USD	235.754	KRW	328.877.000	30. Nov. 2022	5.530
USD	5.143.502	KRW	7.168.819.000	21. Dez. 2022	116.845
USD	391.009	MXN	7.870.000	06. Okt. 2022	377
USD	31.633.762	MXN	637.389.062	07. Okt. 2022	2.359
USD	796.236	MXN	16.924.000	14. Okt. 2022	(42.544)
USD	3.818.052	MXN	78.180.000	07. Nov. 2022	(38.834)
USD	670.361	MXN	13.790.000	28. Nov. 2022	(7.272)
USD	445.242	MXN	9.123.000	30. Nov. 2022	(2.890)
USD	1.273.988	MXN	25.811.000	19. Dez. 2022	10.274
USD	2.521.432	MXN	51.222.000	21. Dez. 2022	14.438
USD	533.269	MXN	11.004.000	21. Feb. 2023	837
USD	22.727.210	NOK	236.491.000	07. Okt. 2022	1.008.204
USD	2.049.146	NOK	22.243.000	07. Nov. 2022	5.635
USD	210.880	NOK	2.110.000	21. Dez. 2022	16.718
USD	49.951.199	NZD	84.180.000	07. Okt. 2022	2.839.015

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
USD	18.912.430	NZD	33.325.000	07. Nov. 2022	260.078	
USD	365.664	NZD	624.000	30. Nov. 2022	16.341	
USD	1.584.380	NZD	2.675.000	21. Dez. 2022	86.626	
USD	3.821.472	PEN	14.898.000	07. Okt. 2022	83.321	
USD	5.645.589	PEN	22.543.000	07. Nov. 2022	13.172	
USD	3.266.898	PEN	12.858.000	21. Dez. 2022	68.406	
USD	3.321.436	PHP	187.830.000	07. Okt. 2022	117.759	
USD	3.159.727	PHP	187.830.000	07. Nov. 2022	(41.720)	
USD	218.670	PHP	12.989.000	02. Dez. 2022	(2.594)	
USD	5.474.980	PHP	316.620.000	21. Dez. 2022	84.052	
USD	20.919.480	PLN	102.255.000	07. Okt. 2022	299.574	
USD	1.337.987	PLN	6.310.000	11. Okt. 2022	66.297	
USD	3.473.855	PLN	17.460.000	07. Nov. 2022	(28.599)	
USD	17.041.246	PLN	77.030.000	17. Nov. 2022	1.612.733	
USD	166.831	PLN	845.000	21. Nov. 2022	(2.312)	
USD	4.337.604	PLN	21.450.000	21. Dez. 2022	68.877	
USD	481.054	RON	2.520.000	21. Dez. 2022	(12.684)	
USD	14.605.357	SEK	160.305.840	07. Okt. 2022	158.464	
USD	897.487	SEK	10.099.000	28. Okt. 2022	(13.516)	
USD	5.874.381	SEK	66.041.301	07. Nov. 2022	(86.116)	
USD	692.271	SEK	7.384.000	21. Dez. 2022	23.471	
USD	10.316.822	SGD	14.421.387	07. Okt. 2022	275.528	
USD	8.375.464	SGD	12.102.380	07. Nov. 2022	(53.750)	
USD	2.799.562	SGD	3.950.000	21. Dez. 2022	46.334	
USD	15.413.413	THB	564.737.100	07. Okt. 2022	439.763	
USD	583.897	THB	22.083.000	02. Nov. 2022	(2.410)	
USD	14.918.292	THB	565.850.800	07. Nov. 2022	(110.347)	
USD	12.451.894	THB	463.220.000	21. Dez. 2022	99.028	
USD	2.632.435	TRY	49.226.000	07. Okt. 2022	(15.195)	
USD	425.255	TRY	8.315.000	14. Nov. 2022	1.630	
USD	119.718	TRY	2.380.000	21. Nov. 2022	(474)	
USD	3.709.951	TRY	74.261.000	21. Dez. 2022	84.553	
USD	24.827.180	TWD	760.656.000	07. Okt. 2022	865.262	
USD	7.176.796	TWD	228.896.000	07. Nov. 2022	(46.466)	
USD	1.945.407	TWD	60.410.000	21. Dez. 2022	30.995	
USD	29.641.349	ZAR	527.468.440	07. Okt. 2022	507.370	
USD	1.529.591	ZAR	26.738.000	17. Okt. 2022	54.128	
USD	434.766	ZAR	7.830.000	07. Nov. 2022	3.531	
USD	406.685	ZAR	7.180.000	19. Dez. 2022	12.711	
USD	8.778.845	ZAR	153.712.000	21. Dez. 2022	346.050	
UYU	19.715.000	USD	470.682	21. Dez. 2022	(4.243)	
ZAR	526.291.191	USD	30.581.278	07. Okt. 2022	(1.512.324)	
ZAR	367.824.988	USD	20.423.716	07. Nov. 2022	(165.893)	
ZAR	62.010.000	USD	3.484.178	21. Dez. 2022	(82.248)	
					USD	5.310.080
Absicherung der Anteilsklasse						
BRL	103.254.818	USD	19.689.569	31. Okt. 2022	(677.093)	
CHF	10.192.915	USD	10.416.003	31. Okt. 2022	(60.380)	
EUR	179.603.695	USD	175.633.652	31. Okt. 2022	724.351	

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
GBP	62.335.724	USD	69.784.623	31. Okt. 2022	(141.683)
SGD	2.675.535	USD	1.880.781	31. Okt. 2022	(17.446)
USD	945.995	BRL	5.104.039	31. Okt. 2022	6.179
USD	32.958	CHF	32.077	31. Okt. 2022	368
USD	901.581	EUR	924.065	31. Okt. 2022	(5.786)
USD	659.435	GBP	604.187	31. Okt. 2022	(15.578)
USD	3.704	SGD	5.282	31. Okt. 2022	25
					USD (187.043)
					USD 5.123.037

Die Devisenterminkontrakte bezogen sich auf die folgenden Kontrahenten:

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend	HSBC	(1.025.562)
	UBS	12.037.667
	USD	11.012.105
Schroder GAIA Cat Bond	Brown Brothers Harriman & Co	2.442.746
	HSBC	5.293.526
	USD	7.736.272
Schroder GAIA Contour Tech Equity	HSBC	257.363
	Morgan Stanley	(65.732)
	USD	191.631
Schroder GAIA Egerton Equity	Brown Brothers Harriman & Co	(2.818.215)
	HSBC	(1.361.770)
	EUR	(4.179.985)
Schroder GAIA Helix	Goldman Sachs	(4.975.253)
	HSBC	430.780
	J.P. Morgan	(2.458.465)
	USD	(7.002.938)
Schroder GAIA Oaktree Credit	HSBC	16.797
	State Street	1.050.347
	USD	1.067.144
Schroder GAIA Sirios US Equity	HSBC	109.848
	Morgan Stanley	584.877
	USD	694.725
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	1.109.625
	Deutsche Bank	(457.221)
	HSBC	284.363
	Morgan Stanley	75.900
	Newedge Group	989.551
	USD	2.002.218

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	HSBC	90.379
		GBP 90.379
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Bank of America	1.334.863
	Barclays Bank	1.096.555
	BNP Paribas	1.409.745
	Citi Bank	703.817
	Deutsche Bank	(58.960)
	Goldman Sachs	(933.812)
	HSBC	852.286
	J.P. Morgan	1.448.208
	Morgan Stanley	(1.588.547)
	Standard Chartered Bank	214.367
	UBS	644.515
		USD 5.123.037

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 2022 war der folgende Teilfonds in offenen Kassageschäften engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Abrechnungsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
CAD	345.794	USD	252.000	03. Okt. 2022	(1.669)
EUR	355.713	USD	346.365	03. Okt. 2022	2.251
GBP	418.524	USD	455.453	03. Okt. 2022	11.850
					USD 12.432

Kontrahenten von Kassageschäften

Fonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Brown Brothers Harriman & Co	14.101
	Morgan Stanley	(1.669)
		USD 12.432

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 2022 hielten die folgenden Teilfonds offene Terminkontrakte auf Indizes (in Aktien), festverzinsliche Wertpapiere und Währungen:

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-/ Long-Position)	Marktpreis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Sept. 23	7	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	1.671.275	95,62	1.987
Dez. 23	5	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	1.195.513	95,68	487
März 24	3	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	718.550	95,77	(275)
Juni 25	38	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9.199.963)	96,38	43.862

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Sept. 25	40	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9.694.550)	96,42	53.050
Dez. 25	40	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9.698.038)	96,44	54.038
März 26	39	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9.460.700)	96,46	56.337
Juni 26	38	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9.217.250)	96,45	54.500
Sept. 26	38	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9.216.950)	96,45	54.675
Dez. 26	35	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(8.489.500)	96,44	51.000
Dez. 22	274	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(173.757.678)	9,91	39.907
März 23	163	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(103.252.357)	9,90	58.108
Juni 23	136	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(86.123.528)	9,89	54.314
Sept. 23	13	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	8.237.346	9,89	(9.942)
Okt. 22	16	Amsterdam Index Future	Morgan Stanley	EUR	(2.044.913)	640,65	35.733
Dez. 22	78	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(5.926.719)	117,12	83.461
Dez. 22	332	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(22.838.794)	106,56	208.850
März 23	584	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(101.247.846)	95,53	278.650
Juni 23	46	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(7.964.636)	95,59	6.588
Sept. 23	48	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(8.315.398)	95,70	2.226
Dez. 23	38	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(6.593.722)	95,85	2.145
Okt. 22	942	BIST 30 Index Future	Morgan Stanley	TRY	1.874.861	3.545.50	(68.603)
Okt. 22	14	CAC 40 Index Future	Morgan Stanley	EUR	787.318	5.763.50	3.474
Dez. 22	385	Canada 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	(34.674.847)	123,59	228.726
Nov-22	1	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(29.950)	31,07	(1.122)
Dez. 22	3	Dax Index Future	Morgan Stanley	EUR	(916.886)	12.134.00	24.991
Dez. 22	9	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	J.P. Morgan	USD	(1.411.400)	28.801.00	115.355
Dez. 22	3	E-mini S&P 500 ESG Future	Morgan Stanley	USD	(524.610)	312,92	55.230
Dez. 22	22	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(4.378.158)	3.601.50	416.508
Juni 23	17	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(4.038.394)	96,96	12
Sept. 23	12	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(2.849.201)	96,91	49
Dez. 23	15	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(3.564.074)	96,96	613
März 25	108	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(25.713.718)	97,10	21.071
Dez. 22	12	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(1.857.489)	146,64	132.914
Dez. 22	28	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	(954.804)	3.315.00	45.122
Dez. 22	55	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(6.508.728)	119,75	53.873
Dez. 22	44	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(5.018.268)	111,98	189.444
Dez. 22	25	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(3.468.426)	138,49	75.248
Dez. 22	95	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(12.828.541)	132,12	527.541
Dez. 22	12	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	948.230	6.914.50	(21.784)
Okt. 22	569	FTSE China A50 Future	Morgan Stanley	USD	(7.425.112)	12.916.00	75.908
Dez. 22	6	FTSE MIB Index Future	Morgan Stanley	EUR	621.964	20.529.00	(18.381)
Okt. 22	126	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	(6.063.029)	1.167.50	178.829
Dez. 22	133	FTSE/JSE Top 40 Future	Morgan Stanley	ZAR	(4.472.096)	57.811.00	224.106
Okt. 22	50	Hang Seng Index Future	Morgan Stanley	HKD	(5.496.755)	17.210.00	15.619
Okt. 22	95	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	(3.623.639)	5.914.00	44.945
Okt. 22	21	IBEX 35 Index Future	Morgan Stanley	EUR	(1.569.168)	7.363.40	53.703
Sept. 23	3	ICE 3-Monats-SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(789.429)	94,18	796
Dez. 23	2	ICE 3-Monats-SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(526.509)	94,20	614
März 24	2	ICE 3-Monats-SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(526.942)	94,27	656
Juni 25	103	ICE 3-Monats-SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(27.688.848)	94,83	425.559
Dez. 22	36	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	(36.913.632)	148,30	25.634
Dez. 22	59	KOSPI2 Index Future	J.P. Morgan	KRW	(3.181.381)	282,45	269.424
Dez. 22	45	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(5.171.335)	96,40	327.741
Okt. 22	591	Mini Bovespa Future	Morgan Stanley	BRL	(2.440.274)	110.502.00	18.974
Dez. 22	47	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(4.341.960)	1.660.60	439.550
Dez. 22	95	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(4.649.510)	871,50	509.885
Okt. 22	350	MSCI Singapore Index ETS Future	Morgan Stanley	SGD	(6.802.110)	280,65	(37.054)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)								
Dez. 22	9	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(2.191.319)	11.035.50	204.929	
Dez. 22	2	Nikkei 225 (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	(363.919)	25.940.00	5.458	
Dez. 22	16	Nikkei 225 (SGX) Future	Morgan Stanley	JPY	1.499.067	25.980.00	(63.014)	
Okt. 22	103	OMXS30 Index Future	Morgan Stanley	SEK	1.717.208	1.830.00	(18.740)	
Dez. 22	18	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1.655.883)	1.669.80	153.063	
Dez. 22	5	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1.215.645)	2.208.20	111.545	
Dez. 22	32	S&P/TSX 60 Index Future	J.P. Morgan	CAD	(5.440.605)	1.117.70	262.135	
Dez. 22	920	SET 50 Index Future	J.P. Morgan	THB	4.739.759	951,80	(96.832)	
Okt. 22	17	SGX Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	(576.685)	17.088.00	(4.307)	
Dez. 22	254	Short-Term Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(26.460.046)	105,32	242.455	
Dez. 22	207	South Korea 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	(15.917.138)	107,25	399.734	
Dez. 22	424	South Korea 3 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	(30.602.090)	101,88	409.093	
Dez. 22	24	SPI 200 Future	Morgan Stanley	AUD	2.656.978	6.466.00	(175.392)	
Dez. 22	29	STOXX Euro ESG-X Index Future	Morgan Stanley	EUR	(429.174)	144,20	19.336	
Dez. 22	66	Swiss Market Index Future	Morgan Stanley	CHF	(7.348.140)	10.259.00	485.933	
Dez. 22	15	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	2.005.838	1.836.00	(102.985)	
Dez. 22	51	WIG20 Index Future	Morgan Stanley	PLN	290.900	1.393.00	(4.257)	
							USD	7.313.025
Schroder GAIA Egerton Equity								
Dez. 22	125	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	(25.187.461)	3.601.50	2.219.883	
							EUR	2.219.883
Schroder GAIA Helix								
Dez. 22	11	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	(2.195.725)	3.601.50	214.900	
Dez. 22	151	Euro Stoxx 50 Future	Goldman Sachs	EUR	(5.174.752)	3.315.00	270.967	
Dez. 22	368	Euro Stoxx Future	J.P. Morgan	EUR	(7.191.777)	364,20	626.868	
Dez. 22	231	FTSE 100 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(18.994.910)	6.914,50	1.164.814	
Dez. 22	144	FTSE 250 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(6.244.868)	17.116.50	742.009	
Dez. 22	641	MSCI Asia Future	J.P. Morgan	USD	(33.644.800)	466,00	3.774.200	
Dez. 22	1.152	MSCI China Future	J.P. Morgan	USD	27.856.698	426,50	(3.290.298)	
Dez. 22	172	MSCI EAFE Index Future	J.P. Morgan	USD	(16.002.377)	1.660.60	1.721.217	
Dez. 22	260	MSCI Emerging Market Index Future	J.P. Morgan	USD	(12.386.610)	871,50	1.057.110	
Dez. 22	621	MSCI Europe Future	J.P. Morgan	EUR	(15.587.742)	244,40	719.360	
Dez. 22	144	MSCI Poland Future	Goldman Sachs	USD	(1.576.670)	99,10	149.630	
Dez. 22	751	MSCI World Index Future	J.P. Morgan	USD	(61.702.057)	7.457.00	5.699.987	
Dez. 22	172	Topix Index Future	J.P. Morgan	JPY	(22.827.455)	1.836,00	1.010.329	
							USD	13.861.093
Schroder GAIA Oaktree Credit								
Dez. 22	3	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(625.704)	102,70	9.532	
Dez. 22	9	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(1.001.212)	107,51	33.641	
							USD	43.173
Schroder GAIA Two Sigma Diversified								
Juni 23	99	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	23.905.270	95,58	(249.220)	
Juni 23	24	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	5.786.275	95,34	(66.175)	
Dez. 23	159	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	38.627.188	95,51	(661.962)	
Juni 24	71	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	17.325.023	95,83	(315.198)	
Dez. 24	23	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	5.653.475	96,06	(130.312)	
März 25	42	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	10.196.738	96,12	(104.138)	
Juni 25	27	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	6.549.863	96,16	(59.400)	
Okt. 22	18	Amsterdam Index Future	Newedge Group	EUR	2.406.317	640,65	(145.988)	
Dez. 22	114	Australia 10 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	(8.689.459)	117,12	149.313	
Dez. 22	63	Australia 3 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	4.336.724	106,56	(42.488)	
Dez. 22	5	Australian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	335.784	64,16	(15.009)	

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
März 23	7	Bankers' Acceptance Future	Newedge Group	CAD	(1.216.138)	95,53	5.891
Dez. 22	1	British Pound Future	Morgan Stanley	USD	71.869	111,81	(1.988)
Okt. 22	50	CAC 40 Index Future	Newedge Group	EUR	3.030.805	5.763,50	(206.546)
Dez. 22	126	Canada 10 Year Bond Future	Newedge Group	CAD	(11.415.340)	123,59	142.064
Dez. 22	1	Canadian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(75.360)	72,40	2.965
Okt. 22	224	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(5.997.170)	31,52	(1.062.414)
Nov-22	56	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(1.533.678)	31,07	(206.337)
Dez. 22	17	Dax Index Future	Newedge Group	EUR	5.610.586	12.134,00	(556.517)
Dez. 22	43	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Morgan Stanley	USD	6.622.885	28.801,00	(430.670)
Okt. 22	2	Dubai IRD FX Future	Newedge Group	USD	48.860	122,40	100
Dez. 22	294	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(58.458.273)	3.601,50	5.516.223
März 23	26	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	6.181.462	97,20	10.494
Sept. 23	83	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	19.969.217	96,91	(262.580)
Dez. 23	96	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	23.123.005	96,96	(316.850)
März 24	89	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	21.087.097	97,00	63.741
Dez. 22	3	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Newedge Group	EUR	(468.072)	146,64	36.928
Dez. 22	3	Euro FX Future	Morgan Stanley	USD	(377.126)	0,99	7.320
Dez. 22	466	Euro Stoxx 50 Future	Newedge Group	EUR	16.649.809	3.315,00	(1.510.095)
Dez. 22	5	Euro Stoxx Bank Future	Morgan Stanley	EUR	(20.135)	78,00	1.024
Dez. 22	99	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	11.825.420	119,75	(206.683)
Dez. 22	80	Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	9.184.895	111,98	(405.216)
Dez. 22	74	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	10.318.868	138,49	(275.061)
Dez. 22	78	Euro-OAT Future	Newedge Group	EUR	10.546.319	132,12	(446.551)
Dez. 22	69	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	7.262.925	107,17	(16.058)
Dez. 22	3	FTSE 100 Index Future	Newedge Group	GBP	231.126	6.914,50	486
Okt. 22	73	FTSE China A50 Future	Newedge Group	USD	(949.101)	12.916,00	6.233
Dez. 22	13	FTSE MIB Index Future	Newedge Group	EUR	(1.379.102)	20.529,00	71.338
Dez. 22	65	FTSE/JSE Top 40 Future	Newedge Group	ZAR	(2.275.530)	57.811,00	199.445
Okt. 22	25	IBEX 35 Index Future	Newedge Group	EUR	(1.982.886)	7.363,40	178.761
März 23	35	ICE 3-Monats-SONIA Index Future	Newedge Group	GBP	9.560.487	95,00	(279.165)
Dez. 22	55	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Newedge Group	JPY	56.340.582	148,30	16.082
Dez. 22	4	Japanese Yen Future	Morgan Stanley	USD	(351.900)	69,64	3.725
Dez. 22	203	KOSDAQ150 Index Future	Newedge Group	KRW	1.529.034	963,00	(162.647)
Dez. 22	95	KOSPI2 Index Future	Newedge Group	KRW	(5.107.033)	282,45	418.288
Dez. 22	173	Long Gilt Future	Newedge Group	GBP	(20.469.420)	96,40	1.848.493
Dez. 22	13	Mexican Peso Future	Morgan Stanley	USD	321.009	4,90	(2.444)
Dez. 22	42	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(3.950.480)	1.660,60	463.220
Dez. 22	211	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(10.373.330)	871,50	1.179.005
Okt. 22	171	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	(3.327.378)	280,65	(14.043)
Dez. 22	190	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(47.076.763)	11.035,50	5.141.863
Dez. 22	1	New Zealand Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(59.715)	56,14	3.580
Dez. 22	47	Nikkei 225 (OSE) Future	Newedge Group	JPY	(8.778.070)	25.940,00	354.246
Dez. 22	42	Nikkei 225 (YEN) Future	Morgan Stanley	JPY	(3.946.832)	25.930,00	184.447
Okt. 22	55	OMXS30 Index Future	Newedge Group	SEK	954.982	1.830,00	(48.034)
Dez. 22	121	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	11.242.282	1.669,80	(1.139.992)
Dez. 22	13	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	3.197.675	2.208,20	(327.015)
Dez. 22	45	S&P/TSX 60 Index Future	Newedge Group	CAD	7.838.805	1.117,70	(556.581)
Dez. 22	32	SET 50 Index Future	Newedge Group	THB	165.307	951,80	(3.814)
Okt. 22	193	SGX Nifty 50 Future	Newedge Group	USD	6.506.372	17.088,00	89.596
Dez. 22	56	Short-Term Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	5.844.597	105,32	(64.340)
Dez. 22	51	South Korea 10 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	3.873.747	107,25	(50.619)
Dez. 22	27	South Korea 3 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	1.940.351	101,88	(17.684)
Dez. 22	45	SPI 200 Future	Newedge Group	AUD	4.864.378	6.466,00	(211.404)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Dez. 22	8	Stoxx 600 Bank Future	Newedge Group	EUR	(51.539)	118,85	4.947
Dez. 22	94	Stoxx Europe 600 Future	Newedge Group	EUR	1.970.732	387,50	(185.816)
Dez. 22	1	Swiss Franc Future	Morgan Stanley	USD	131.290	102,14	(3.615)
Okt. 22	19	TAIEX Future	Morgan Stanley	TWD	1.725.391	13.394,00	(122.279)
Dez. 22	111	Topix Index Future	Newedge Group	JPY	(14.623.755)	1.836,00	542.638
Dez. 22	1	UD Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	109.539	112,08	2.545
Dez. 22	721	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	81.697.563	112,06	(900.500)
Dez. 22	27	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	3.369.861	118,48	(170.782)
Dez. 22	289	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	60.190.725	102,70	(832.834)
Dez. 22	6	US 3 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	1.282.359	104,38	(29.766)
Dez. 22	155	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	17.022.799	107,51	(359.088)
Okt. 22	34	US Dollar Index Future	Newedge Group	KRW	331.247	1.432,20	9.110
Dez. 22	34	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(4.620.483)	126,41	322.670
Dez. 22	3	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	453.375	137,00	(42.375)
Okt. 22	110	VSTOXX Mini Future	Newedge Group	EUR	(300.933)	31,15	(34.881)
Dez. 22	25	WIG20 Index Future	Newedge Group	PLN	(153.887)	1.393,00	13.375
						USD	3.736.982
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund							
Dez. 22	24	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	(1.798.080)	6.914,50	138.600
						GBP	138.600
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Dez. 22	930	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	70.582.402	117,12	(912.790)
Dez. 22	24	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	1.652.620	106,56	(16.720)
Dez. 22	1.653	Canada 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	(149.394.795)	123,59	1.500.148
Dez. 22	70	Canada 5 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	(5.724.813)	112,39	29.442
Okt. 22	31	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	942.650	31,52	34.346
Dez. 22	3	Dax Index Future	Morgan Stanley	EUR	(906.938)	12.134,00	15.044
Dez. 22	6	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(1.497.190)	3.601,50	416.740
Dez. 22	52	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(7.593.564)	146,64	120.409
Dez. 22	42	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(5.057.460)	119,75	128.298
Dez. 22	220	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(24.184.919)	111,98	40.800
Dez. 22	81	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(11.457.656)	138,49	463.760
Dez. 22	31	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(4.180.021)	132,12	166.011
Dez. 22	129	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(13.674.030)	107,17	125.540
Okt. 22	6	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	(289.975)	1.167,50	9.776
Okt. 22	61	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	2.371.144	5.914,00	(73.245)
Dez. 22	43	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	(44.070.165)	148,30	9.500
Dez. 22	254	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(27.285.846)	96,40	(53.550)
Dez. 22	83	Micro E-mini Nasdaq-100 Index Future	Morgan Stanley	USD	1.952.065	11.035,50	(120.172)
Dez. 22	8	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(754.600)	1.660,60	90.360
Dez. 22	26	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	5.917.930	11.035,50	(179.470)
Dez. 22	5	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(463.940)	1.669,80	46.490
Okt. 22	22	SGX Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	(751.546)	17.088,00	(327)
Dez. 22	1.293	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	146.929.228	112,06	(2.032.416)
Dez. 22	38	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(4.657.513)	118,48	155.107
Dez. 22	252	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(52.015.846)	102,70	257.408
Dez. 22	377	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	40.519.938	107,51	10.508
Dez. 22	48	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	6.206.182	126,41	(138.682)
Dez. 22	144	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	20.422.055	137,00	(694.055)
						USD	(601.740)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (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 2022 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)
Schroder GAIA BlueTrend						
(1.156.704)	Put auf UBS ETC Linked to a Systematica Strategy Delta-1 Basket on Commodity Future Ausübungskurs 47,04 Läuft am 3. Okt. 2022 ab	UBS	USD	(3.879)	-	3.879
				USD	-	3.879
Schroder GAIA Helix						
380	Put auf Deutsche Börse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 11.600,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	UBS	EUR	196.632	311.773	115.141
30	Put auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 900,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	UBS	USD	30.012	115.650	85.638
80	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.550,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	UBS	USD	197.898	634.400	436.502
				USD	1.061.823	637.281
Schroder GAIA Oaktree Credit						
2	Put auf S&P 500 Future Ausübungskurs 3.400,00 Läuft am 7. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	353	775	422
				USD	775	422
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
198	Call auf 3-Monats-SOFR-Optionen Ausübungskurs 97,25 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	71.373	8.663	(62.710)
(198)	Call auf 3-Monats-SOFR-Optionen Ausübungskurs 97,88 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(26.831)	(6.188)	20.643
135.777	Call auf Alibaba Group Holding Limited Ausübungskurs 109,92 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	HKD	93.288	22.920	(70.368)
(135.777)	Call auf Alibaba Group Holding Limited Ausübungskurs 146,57 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	HKD	(21.535)	(4.747)	16.788
48	Call auf Biogen Inc, Ausübungskurs 240,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	50.189	145.200	95.011
(48)	Call auf Biogen Inc, Ausübungskurs 290,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(20.163)	(24.000)	(3.837)
21.198	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 8,00 Läuft am 17. März 2023 ab	Goldman Sachs	EUR	16.245	15.241	(1.004)
30.396	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 9,00 Läuft am 17. März 2023 ab	Goldman Sachs	EUR	16.248	13.037	(3.211)
23.525	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 12,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	10.137	666	(9.471)
33.535	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 13,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	10.496	606	(9.890)
47.951	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 14,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	11.413	589	(10.824)
15.000	Call auf Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 559,36 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	CNY	112.365	7.912	(104.453)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(15.000)	Call auf Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 639,27 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	CNY	(55.351)	(3.041)	52.310
353	Call auf DAX 30 Index Ausübungskurs 14.000,00 Läuft am 18. Nov. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	8.044	6.330	(1.714)
246	Call auf DAX 30 Index Ausübungskurs 14.000,00 Läuft am 18. Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	EUR	18.243	4.411	(13.832)
2.139	Call auf Euro Stoxx 50 Index Ausübungskurs 3.800,00 Läuft am 18. Nov. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	27.545	11.367	(16.178)
19.487.029	Call auf Euro Stoxx 50 Index versus S&P 500 Index Ausübungskurs 2,50 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	216.902	2.669	(214.233)
1.395.000	Call auf Foreign Exchange AUD/JPY Ausübungskurs 93,34 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Citi Bank	AUD	15.167	10.286	(4.881)
1.305.000	Call auf Foreign Exchange AUD/JPY Ausübungskurs 96,00 Läuft am 24. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	AUD	14.336	2.365	(11.971)
2.095.000	Call auf Foreign Exchange AUD/USD Ausübungskurs 0,64 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	AUD	23.476	19.895	(3.581)
(5.955.000)	Call auf Foreign Exchange AUD/USD Ausübungskurs 0,65 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	AUD	(106.852)	(77.686)	29.166
5.955.000	Call auf Foreign Exchange AUD/USD Ausübungskurs 0,68 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	AUD	37.261	24.688	(12.573)
(1.358.000)	Call auf Foreign Exchange EUR/BRL Ausübungskurs 5,13 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	(31.590)	(62.519)	(30.929)
(1.289.000)	Call auf Foreign Exchange EUR/BRL Ausübungskurs 5,33 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	(31.156)	(26.418)	4.738
(2.758.000)	Call auf Foreign Exchange EUR/JPY Ausübungskurs 145,00 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	(28.863)	(9.523)	19.340
1.422.000	Call auf Foreign Exchange EUR/MXN Ausübungskurs 19,78 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	19.548	21.306	1.758
1.074.000	Call auf Foreign Exchange EUR/NZD Ausübungskurs 1,65 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	J.P. Morgan	EUR	12.573	58.850	46.277
1.316.000	Call auf Foreign Exchange EUR/PLN Ausübungskurs 4,75 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	HSBC	EUR	12.316	36.003	23.687
1.358.000	Call auf Foreign Exchange EUR/PLN Ausübungskurs 4,78 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Citi Bank	EUR	14.999	34.190	19.191
1.422.000	Call auf Foreign Exchange EUR/SEK Ausübungskurs 10,89 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	12.006	11.531	(475)
940.000	Call auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 0,96 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	13.276	23.493	10.217
(4.087.000)	Call auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 0,97 Läuft am 27. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	(92.680)	(134.136)	(41.456)
(8.242.000)	Call auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 0,97 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	EUR	(207.771)	(316.914)	(109.143)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
4.791.000	Call auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,01 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	59.409	8.618	(50.791)
8.242.000	Call auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,01 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	EUR	72.993	128.481	55.488
4.791.000	Call auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,02 Läuft am 13. Okt. 2022 ab	Citi Bank	EUR	60.635	3.470	(57.165)
4.792.000	Call auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,02 Läuft am 14. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	59.666	4.970	(54.696)
(3.789.000)	Call auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,04 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	Citi Bank	EUR	(29.200)	(16.878)	12.322
734.000	Call auf Foreign Exchange GBP/JPY Ausübungskurs 161,21 Läuft am 5. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	11.763	8.773	(2.990)
(5.520.000)	Call auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,07 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	Barclays Bank	GBP	(209.817)	(393.253)	(183.436)
5.738.000	Call auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,09 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	GBP	116.802	220.590	103.788
(1.202.000)	Call auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,11 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	GBP	(15.044)	(33.025)	(17.981)
5.520.000	Call auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,14 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	Barclays Bank	GBP	69.820	174.029	104.209
4.152.000	Call auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,16 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	70.808	14.610	(56.198)
4.152.000	Call auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,17 Läuft am 13. Okt. 2022 ab	Citi Bank	GBP	70.630	8.773	(61.857)
4.153.000	Call auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,17 Läuft am 14. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	66.736	9.191	(57.545)
414.000	Call auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,42 Läuft am 4. Mai 2023 ab	Barclays Bank	GBP	35.096	613	(34.483)
(4.620.000)	Call auf Foreign Exchange NZD/JPY Ausübungskurs 87,50 Läuft am 19. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	NZD	(17.583)	(685)	16.898
2.375.000	Call auf Foreign Exchange NZD/USD Ausübungskurs 0,57 Läuft am 1. Nov. 2022 ab	UBS	NZD	26.239	16.737	(9.502)
(6.525.000)	Call auf Foreign Exchange NZD/USD Ausübungskurs 0,59 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	NZD	(98.374)	(38.720)	59.654
1.415.000	Call auf Foreign Exchange NZD/USD Ausübungskurs 0,61 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Bank of America	NZD	12.711	34	(12.677)
6.525.000	Call auf Foreign Exchange NZD/USD Ausübungskurs 0,61 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	NZD	33.222	11.215	(22.007)
1.748.000	Call auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 5,76 Läuft am 24. Jan. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	49.468	56.927	7.459
1.836.000	Call auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 6,23 Läuft am 26. Jan. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	43.262	27.073	(16.189)
1.489.000	Call auf Foreign Exchange USD/CAD Ausübungskurs 1,32 Läuft am 05. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	13.890	70.165	56.275

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1.117.000	Call auf Foreign Exchange USD/CAD Ausübungskurs 1,32 Läuft am 7. Dez. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	18.202	53.497	35.295
(4.939.000)	Call auf Foreign Exchange USD/CHF Ausübungskurs 0,96 Läuft am 17. Okt. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	(81.098)	(137.386)	(56.288)
4.939.000	Call auf Foreign Exchange USD/CHF Ausübungskurs 0,96 Läuft am 17. Okt. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	48.150	137.386	89.236
788.000	Call auf Foreign Exchange USD/CHF Ausübungskurs 0,96 Läuft am 29. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	14.174	21.580	7.406
858.000	Call auf Foreign Exchange USD/CHF Ausübungskurs 0,97 Läuft am 11. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	15.590	14.037	(1.553)
5.525.000	Call auf Foreign Exchange USD/CHF Ausübungskurs 0,97 Läuft am 11. Nov. 2022 ab	Bank of America	USD	55.278	121.987	66.709
(5.525.000)	Call auf Foreign Exchange USD/CHF Ausübungskurs 0,97 Läuft am 11. Nov. 2022 ab	Barclays Bank	USD	(97.296)	(121.987)	(24.691)
(8.287.000)	Call auf Foreign Exchange USD/CHF Ausübungskurs 0,99 Läuft am 11. Nov. 2022 ab	Bank of America	USD	(48.586)	(114.795)	(66.209)
(1.756.000)	Call auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 892,00 Läuft am 29. Nov. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(78.054)	(164.573)	(86.519)
(1.918.000)	Call auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 943,85 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	USD	(84.933)	(123.307)	(38.374)
1.939.000	Call auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 945,00 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	43.852	71.163	27.311
(1.939.000)	Call auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 945,00 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	(94.497)	(71.163)	23.334
1.756.000	Call auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 971,00 Läuft am 29. Nov. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	33.522	71.834	38.312
1.815.000	Call auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,44 Läuft am 10. März 2023 ab	Morgan Stanley	USD	34.921	170.027	135.106
872.000	Call auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,47 Läuft am 13. März 2023 ab	Morgan Stanley	USD	17.575	77.725	60.150
3.944.000	Call auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 7,16 Läuft am 23. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	54.822	52.725	(2.097)
(1.805.000)	Call auf Foreign Exchange USD/CZK Ausübungskurs 25,74 Läuft am 3. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	(19.569)	(17.583)	1.986
9.473.000	Call auf Foreign Exchange USD/HKD Ausübungskurs 8,00 Läuft am 19. Dez. 2022 ab	Bank of America	USD	15.413	1.096	(14.317)
(2.841.000)	Call auf Foreign Exchange USD/HUF Ausübungskurs 413,67 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	(113.583)	(215.876)	(102.293)
(1.805.000)	Call auf Foreign Exchange USD/HUF Ausübungskurs 426,65 Läuft am 03. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	(29.692)	(70.450)	(40.758)
991.000	Call auf Foreign Exchange USD/IDR Ausübungskurs 14.998,00 Läuft am 4. Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	17.184	21.891	4.707
1.052.000	Call auf Foreign Exchange USD/IDR Ausübungskurs 15.015,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	16.827	29.397	12.570

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1.532.000	Call auf Foreign Exchange USD/IDR Ausübungskurs 15,548,00 Lauft am 16. Dez. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	10.715	20.549	9.834
(3.518.000)	Call auf Foreign Exchange USD/ILS Ausübungskurs 3,31 Lauft am 30. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	(71.503)	(237.669)	(166.166)
1.035.000	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 80,16 Lauft am 12. Dez. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	11.132	27.430	16.298
1.020.000	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 80,42 Lauft am 21. Okt. 2022 ab	HSBC	USD	11.118	16.417	5.299
(1.323.000)	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 81,30 Lauft am 25. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	(10.288)	(12.444)	(2.156)
3.610.000	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 81,60 Lauft am 03. Nov. 2022 ab	UBS	USD	18.050	33.202	15.152
2.446.000	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 81,65 Lauft am 7. Okt. 2022 ab	Citi Bank	USD	12.218	7.532	(4.686)
1.784.000	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 82,07 Lauft am 16. Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	8.288	15.783	7.495
2.424.000	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 82,26 Lauft am 25. Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	11.356	22.674	11.318
3.943.000	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 84,80 Lauft am 03. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	24.132	22.217	(1.915)
800.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 95,99 Lauft am 17. Juni 2024 ab	BNP Paribas	USD	55.269	210.520	155.251
826.000	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 137,58 Lauft am 21. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	17.983	40.867	22.884
4.771.000	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 141,80 Lauft am 14. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	77.042	107.789	30.747
4.770.000	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 141,98 Lauft am 12. Okt. 2022 ab	Citi Bank	USD	80.482	101.582	21.100
4.770.000	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 142,25 Lauft am 13. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	77.989	95.290	17.301
876.000	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 143,28 Lauft am 20. Okt. 2022 ab	Citi Bank	USD	13.092	14.392	1.300
(1.361.000)	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 144,38 Lauft am 27. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	(19.404)	(18.013)	1.391
(5.403.000)	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 145,50 Lauft am 25. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	USD	(35.930)	(49.340)	(13.410)
(8.253.000)	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 147,00 Lauft am 10. Nov. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(70.811)	(68.771)	2.040
(1.868.000)	Call auf Foreign Exchange USD/KRW Ausübungskurs 1.385,50 Lauft am 9. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	(40.900)	(75.151)	(34.251)
1.023.000	Call auf Foreign Exchange USD/PHP Ausübungskurs 56,51 Lauft am 24. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	15.946	40.370	24.424
1.038.000	Call auf Foreign Exchange USD/PHP Ausübungskurs 57,12 Lauft am 09. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	14.625	37.317	22.692

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
2.034.000	Call auf Foreign Exchange USD/PHP Ausübungskurs 57,54 Läuft am 8. Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	12.438	52.135	39.697
(1.784.000)	Call auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 4,86 Läuft am 15. Nov. 2022 ab	Bank of America	USD	(21.283)	(73.062)	(51.779)
1.004.000	Call auf Foreign Exchange USD/SGD Ausübungskurs 1,38 Läuft am 28. Okt. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	11.388	38.800	27.412
1.038.000	Call auf Foreign Exchange USD/SGD Ausübungskurs 1,40 Läuft am 09. Dez. 2022 ab	HSBC	USD	11.179	31.416	20.237
(4.736.000)	Call auf Foreign Exchange USD/THB Ausübungskurs 36,53 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	(87.999)	(173.813)	(85.814)
(7.887.000)	Call auf Foreign Exchange USD/THB Ausübungskurs 37,60 Läuft am 03. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(162.945)	(164.263)	(1.318)
2.228.000	Call auf Foreign Exchange USD/ZAR Ausübungskurs 17,55 Läuft am 11. Okt. 2022 ab	HSBC	USD	39.881	73.660	33.779
2.841.000	Call auf Foreign Exchange USD/ZAR Ausübungskurs 17,59 Läuft am 14. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	91.495	138.461	46.966
1.112.000	Call auf Foreign Exchange USD/ZAR Ausübungskurs 18,07 Läuft am 7. Okt. 2022 ab	HSBC	USD	15.869	12.060	(3.809)
3.788.000	Call auf Foreign Exchange USD/ZAR Ausübungskurs 18,64 Läuft am 14. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	45.967	81.071	35.104
68	Call auf MSCI Emerging Märzkets Index Ausübungskurs 1.010,00 Läuft am 30. Sept. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	50.296	4.080	(46.216)
1.360	Call auf S&P Regional Banks Select Industry Index Ausübungskurs 2.020,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	50.039	5.070	(44.969)
315.702	Call auf Sinoma Science & Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 28,04 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	CNY	116.405	11.998	(104.407)
(315.702)	Call auf Sinoma Science & Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 33,39 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	CNY	(47.073)	(4.755)	42.318
1.145	Call auf XPeng Inc, Ausübungskurs 97,47 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	HKD	1.988	83	(1.905)
(1.145)	Call auf XPeng Inc, Ausübungskurs 120,68 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	HKD	(964)	(36)	928
(120)	Put auf 3-Monats-LIBOR-Optionen Ausübungskurs 99,00 Läuft am 18. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	EUR	(66.285)	(619.637)	(553.352)
120	Put auf 3-Monats-LIBOR-Optionen Ausübungskurs 99,50 Läuft am 18. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	EUR	107.751	756.354	648.603
714	Put auf A.P. Moeller – Maersk A/S Ausübungskurs 14.000,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	DKK	31.454	78.293	46.839
(135.777)	Put auf 3-Monats-LIBOR-Optionen Ausübungskurs 73,28 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	HKD	(64.060)	(106.885)	(42.825)
119	Put auf Apple Inc. Ausübungskurs 140,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	59.290	73.185	13.895

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(48)	Put auf Biogen Inc. Ausübungskurs 155,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(9.896)	(840)	9.056
(15.000)	Put auf Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 452,82 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	CNY	(50.640)	(141.556)	(90.916)
(3.330)	Put auf Euro Stoxx 50 Index Ausübungskurs 2,950,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	(35.703)	(38.784)	(3.081)
3.330	Put auf Euro Stoxx 50 Index Ausübungskurs 3,300,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	212.642	259.883	47.241
1.395.000	Put auf Foreign Exchange AUD/JPY Ausübungskurs 93,34 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Citi Bank	AUD	15.167	19.393	4.226
1.305.000	Put auf Foreign Exchange AUD/JPY Ausübungskurs 96,00 Läuft am 24. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	AUD	14.336	34.668	20.332
2.095.000	Put auf Foreign Exchange AUD/USD Ausübungskurs 0,64 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	AUD	23.476	26.896	3.420
(1.358.000)	Put auf Foreign Exchange EUR/BRL Ausübungskurs 5,13 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	(31.590)	(15.109)	16.481
(1.289.000)	Put auf Foreign Exchange EUR/BRL Ausübungskurs 5,33 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	(31.156)	(30.804)	352
1.422.000	Put auf Foreign Exchange EUR/MXN Ausübungskurs 19,78 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	19.548	15.841	(3.707)
1.074.000	Put auf Foreign Exchange EUR/NZD Ausübungskurs 1,65 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	J.P. Morgan	EUR	12.573	147	(12.426)
(1.901.000)	Put auf Foreign Exchange EUR/PLN Ausübungskurs 4,67 Läuft am 20. Dez. 2022 ab	Citi Bank	EUR	(10.360)	(1.215)	9.145
1.316.000	Put auf Foreign Exchange EUR/PLN Ausübungskurs 4,75 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	HSBC	EUR	12.316	2.481	(9.835)
1.358.000	Put auf Foreign Exchange EUR/PLN Ausübungskurs 4,78 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Citi Bank	EUR	14.880	4.852	(10.028)
1.422.000	Put auf Foreign Exchange EUR/SEK Ausübungskurs 10,89 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	12.006	12.022	16
238.000	Put auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 0,94 Läuft am 7. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	6.603	-	(6.603)
940.000	Put auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 0,96 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	13.276	7.539	(5.737)
237.000	Put auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 0,97 Läuft am 7. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	9.425	-	(9.425)
(3.789.000)	Put auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 0,97 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	Citi Bank	EUR	(30.772)	(64.562)	(33.790)
(3.009.000)	Put auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 0,97 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	EUR	(70.650)	(52.375)	18.275
(4.087.000)	Put auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 0,97 Läuft am 27. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	(92.679)	(74.197)	18.482
4.791.000	Put auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,01 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	59.408	137.877	78.469

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
4.791.000	Put auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,02 Läuft am 13. Okt. 2022 ab	Citi Bank	EUR	60.636	197.985	137.349
4.792.000	Put auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,02 Läuft am 14. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	59.667	186.071	126.404
1.168.000	Put auf Foreign Exchange GBP/AUD Ausübungskurs 1,70 Läuft am 24. Okt. 2022 ab	Bank of America	GBP	13.417	6.796	(6.621)
734.000	Put auf Foreign Exchange GBP/JPY Ausübungskurs 161,21 Läuft am 5. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	11.763	6.981	(4.782)
(1.202.000)	Put auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,04 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	GBP	(10.847)	(5.983)	4.864
5.738.000	Put auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,09 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	GBP	117.052	79.682	(37.370)
4.152.000	Put auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,16 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	70.808	181.055	110.247
4.152.000	Put auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,17 Läuft am 13. Okt. 2022 ab	Citi Bank	GBP	70.630	231.112	160.482
4.153.000	Put auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,17 Läuft am 14. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	66.736	238.691	171.955
350.000	Put auf Foreign Exchange NZD/JPY Ausübungskurs 80,00 Läuft am 28. Okt. 2022 ab	Bank of America	NZD	21.016	44.502	23.486
(4.620.000)	Put auf Foreign Exchange NZD/JPY Ausübungskurs 82,70 Läuft am 19. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	NZD	(17.584)	(71.519)	(53.935)
2.375.000	Put auf Foreign Exchange NZD/USD Ausübungskurs 0,57 Läuft am 1. Nov. 2022 ab	UBS	NZD	26.239	34.900	8.661
1.415.000	Put auf Foreign Exchange NZD/USD Ausübungskurs 0,61 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Bank of America	NZD	12.711	76.495	63.784
2.623.000	Put auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 4,87 Läuft am 16. Nov. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	41.174	7.807	(33.367)
1.805.000	Put auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 5,05 Läuft am 3. Nov. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	27.721	10.209	(17.512)
(1.836.000)	Put auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 5,11 Läuft am 24. Jan. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	(36.445)	(29.668)	6.777
(1.836.000)	Put auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 5,11 Läuft am 26. Jan. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	(36.355)	(29.759)	6.596
(2.623.000)	Put auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 5,24 Läuft am 16. Nov. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	(115.819)	(43.810)	72.009
(1.805.000)	Put auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 5,44 Läuft am 03. Nov. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	(79.460)	(51.451)	28.009
1.489.000	Put auf Foreign Exchange USD/CAD Ausübungskurs 1,32 Läuft am 5. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	13.890	2	(13.888)
1.117.000	Put auf Foreign Exchange USD/CAD Ausübungskurs 1,32 Läuft am 7. Dez. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	18.202	2.795	(15.407)
(3.943.000)	Put auf Foreign Exchange USD/CAD Ausübungskurs 1,33 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	UBS	USD	(28.035)	(23.174)	4.861

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
788.000	Put auf Foreign Exchange USD/CHF Ausübungskurs 0,96 Läuft am 29. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	14.174	7.778	(6.396)
858.000	Put auf Foreign Exchange USD/CHF Ausübungskurs 0,97 Läuft am 11. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	15.590	2.892	(12.698)
4.767.000	Put auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 880,00 Läuft am 19. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	72.292	30.838	(41.454)
5.841.000	Put auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 930,20 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	89.075	111.267	22.192
(1.918.000)	Put auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 943,85 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	USD	(74.004)	(46.408)	27.596
(4.767.000)	Put auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 944,50 Läuft am 19. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(210.811)	(116.146)	94.665
1.939.000	Put auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 945,00 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	47.544	21.402	(26.142)
(1.939.000)	Put auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 945,00 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	(94.497)	(21.402)	73.095
(5.841.000)	Put auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 998,80 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(258.581)	(308.821)	(50.240)
1.815.000	Put auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,44 Läuft am 10. März 2023 ab	Morgan Stanley	USD	34.921	988	(33.933)
872.000	Put auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,47 Läuft am 13. März 2023 ab	Morgan Stanley	USD	17.575	593	(16.982)
3.944.000	Put auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 7,16 Läuft am 23. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	54.822	67.807	12.985
2.836.000	Put auf Foreign Exchange USD/COP Ausübungskurs 4.249,40 Läuft am 14. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	35.393	11.624	(23.769)
(2.836.000)	Put auf Foreign Exchange USD/COP Ausübungskurs 4.503,00 Läuft am 14. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(99.657)	(46.195)	53.462
1.805.000	Put auf Foreign Exchange USD/CZK Ausübungskurs 23,55 Läuft am 03 Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	15.529	1.435	(14.094)
1.805.000	Put auf Foreign Exchange USD/HUF Ausübungskurs 372,89 Läuft am 03 Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	23.916	688	(23.228)
5.916.000	Put auf Foreign Exchange USD/HUF Ausübungskurs 405,70 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	81.108	64.075	(17.033)
3.895.000	Put auf Foreign Exchange USD/HUF Ausübungskurs 412,02 Läuft am 5. Jan. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	61.444	61.682	238
(2.841.000)	Put auf Foreign Exchange USD/HUF Ausübungskurs 413,67 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	(100.373)	(42.104)	58.269
(5.916.000)	Put auf Foreign Exchange USD/HUF Ausübungskurs 432,45 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(232.174)	(188.881)	43.293
(3.895.000)	Put auf Foreign Exchange USD/HUF Ausübungskurs 442,31 Läuft am 5. Jan. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	(174.917)	(174.885)	32
991.000	Put auf Foreign Exchange USD/IDR Ausübungskurs 14.998,00 Läuft am 4. Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	17.184	4.382	(12.802)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1.052.000	Put auf Foreign Exchange USD/IDR Ausübungskurs 15.015,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	16.827	9.546	(7.281)
(3.518.000)	Put auf Foreign Exchange USD/ILS Ausübungskurs 3,31 Läuft am 30. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	(70.342)	(4.482)	65.860
(3.610.000)	Put auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 78,39 Läuft am 03 Nov. 2022 ab	UBS	USD	(14.620)	(940)	13.680
(1.784.000)	Put auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 78,85 Läuft am 16 Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	(7.290)	(1.419)	5.871
1.035.000	Put auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 80,16 Läuft am 12. Dez. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	11.131	4.067	(7.064)
1.020.000	Put auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 80,42 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	HSBC	USD	11.118	2.019	(9.099)
(3.943.000)	Put auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 80,69 Läuft am 03. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(19.715)	(25.219)	(5.504)
(1.323.000)	Put auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 81,30 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	(10.288)	(7.857)	2.431
800.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 95,99 Läuft am 17. Juni 2024 ab	BNP Paribas	USD	55.269	2.393	(52.876)
705.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 112,00 Läuft am 23. Feb. 2023 ab	Barclays Bank	USD	27.495	2.908	(24.587)
452.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 122,00 Läuft am 10. Nov. 2022 ab	Bank of America	USD	56.138	1.605	(54.533)
495.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 130,00 Läuft am 17. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	USD	25.245	1.378	(23.867)
216.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 132,00 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	USD	22.032	1.905	(20.127)
826.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 137,58 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	17.983	1.569	(16.414)
272.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 140,00 Läuft am 6. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	USD	34.952	6.749	(28.203)
(5.403.000)	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 140,00 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	USD	(41.765)	(21.820)	19.945
4.771.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 141,80 Läuft am 14. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	77.042	16.852	(60.190)
4.770.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 141,98 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Citi Bank	USD	80.482	14.845	(65.637)
4.770.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 142,25 Läuft am 13. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	77.990	17.890	(60.100)
876.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 143,28 Läuft am 20. Okt. 2022 ab	Citi Bank	USD	13.092	6.977	(6.115)
(1.361.000)	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 144,38 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	(19.404)	(17.724)	1.680
5.683.000	Put auf Foreign Exchange USD/KRW Ausübungskurs 1.342,00 Läuft am 19. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	40.508	15.899	(24.609)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(1.868.000)	Put auf Foreign Exchange USD/KRW Ausübungskurs 1.385,50 Läuft am 9. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	(40.900)	(13.752)	27.148
(5.683.000)	Put auf Foreign Exchange USD/KRW Ausübungskurs 1.394,00 Läuft am 19. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(122.639)	(59.090)	63.549
1.683.000	Put auf Foreign Exchange USD/MXN Ausübungskurs 19,41 Läuft am 28. Nov. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	19.627	6.202	(13.425)
2.487.000	Put auf Foreign Exchange USD/MXN Ausübungskurs 19,50 Läuft am 23. Nov. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	29.464	10.029	(19.435)
4.726.000	Put auf Foreign Exchange USD/MXN Ausübungskurs 19,51 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	40.360	27.215	(13.145)
(1.743.000)	Put auf Foreign Exchange USD/MXN Ausübungskurs 19,52 Läuft am 16. Feb. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	(20.536)	(15.964)	4.572
1.743.000	Put auf Foreign Exchange USD/MXN Ausübungskurs 20,64 Läuft am 16. Feb. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	61.296	54.555	(6.741)
1.023.000	Put auf Foreign Exchange USD/PHP Ausübungskurs 56,51 Läuft am 24. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	15.946	244	(15.702)
1.038.000	Put auf Foreign Exchange USD/PHP Ausübungskurs 57,12 Läuft am 09. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	14.625	2.862	(11.763)
(3.944.000)	Put auf Foreign Exchange USD/PHP Ausübungskurs 59,55 Läuft am 03. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(63.589)	(76.995)	(13.406)
1.784.000	Put auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 4,40 Läuft am 15. Nov. 2022 ab	Bank of America	USD	16.770	1.322	(15.448)
2.899.000	Put auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 4,52 Läuft am 10. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	41.511	14.283	(27.228)
2.899.000	Put auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 4,54 Läuft am 10. Jan. 2023 ab	Citi Bank	USD	41.325	15.915	(25.410)
3.965.000	Put auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 4,81 Läuft am 4. Jan. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	51.188	67.516	16.328
(2.899.000)	Put auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 4,83 Läuft am 10. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(123.353)	(57.229)	66.124
(2.899.000)	Put auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 4,86 Läuft am 10. Jan. 2023 ab	Citi Bank	USD	(123.092)	(63.244)	59.848
(3.965.000)	Put auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 5,10 Läuft am 04. Jan. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	(148.445)	(180.127)	(31.682)
1.004.000	Put auf Foreign Exchange USD/SGD Ausübungskurs 1,38 Läuft am 28. Okt. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	11.388	317	(11.071)
1.038.000	Put auf Foreign Exchange USD/SGD Ausübungskurs 1,40 Läuft am 09. Dez. 2022 ab	HSBC	USD	11.179	3.347	(7.832)
(4.736.000)	Put auf Foreign Exchange USD/THB Ausübungskurs 36,53 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	(82.127)	(33.959)	48.168
(7.887.000)	Put auf Foreign Exchange USD/THB Ausübungskurs 37,60 Läuft am 03. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(162.946)	(172.661)	(9.715)
3.788.000	Put auf Foreign Exchange USD/ZAR Ausübungskurs 16,76 Läuft am 14. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	43.922	16.276	(27.646)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
2.841.000	Put auf Foreign Exchange USD/ZAR Ausübungskurs 17,59 Läuft am 14. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	83.512	42.314	(41.198)
1.038	Put auf FTSE China A50 Index Ausübungskurs 12.327,00 Läuft am 28. Okt. 2022 ab	BNP Paribas	CNY	27.320	24.656	(2.664)
15.740	Put auf InterContinental Hotels Group Ausübungskurs 40,00 Läuft am 17. März 2023 ab	Goldman Sachs	GBP	26.527	38.486	11.959
61	Put auf MSCI EAFE Index Ausübungskurs 1.630,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	273.116	194.895	(78.221)
93	Put auf Russell 2000 Index Ausübungskurs 1,620,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	364.185	328.755	(35.430)
13	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.600,00 Läuft am 30. Sept. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	7.973	15.080	7.107
21	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.750,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	144.970	392.070	247.100
(315.702)	Put auf Sinoma Science & Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 22,70 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	CNY	(59.016)	(159.562)	(100.546)
(1.145)	Put auf XPeng Inc. Ausübungskurs 69,62 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	HKD	(780)	(3.676)	(2.896)
				USD	1.514.443	185.482

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 2022 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)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf	CDX „iTraxx Europe Crossover Series 38 20/12/2027“, Call, Ausübungskurs 525,00, 19. Okt. 2022	Bank of America	EUR	24.069	8.420.000	7.842	(16.227)
Kauf	CDX „iTraxx Europe Crossover Series 38 20/12/2027“, Call, Ausübungskurs 525,00, 19. Okt. 2022	Barclays Bank	EUR	8.844	4.240.000	3.949	(4.895)
Kauf	CDX „iTraxx Europe Crossover Series 38 20/12/2027“, Call, Ausübungskurs 550,00, 16. Nov. 2022	J.P. Morgan	EUR	75.697	16.260.000	84.259	8.562
Kauf	CDX „iTraxx Europe Series 38 20/12/2027“, Call, Ausübungskurs 90,00, 21. Dez. 2022	Barclays Bank	EUR	43.938	51.720.000	43.085	(853)
Kauf	CDX „North America High Yield Series 38 20/06/2027“, Call, Ausübungskurs 100,00, 16. Nov. 2022	Goldman Sachs	USD	81.708	12.137.000	65.086	(16.622)
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 7,69 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIE Mar 2026“, Put 7,69 %, 13. März 2026	J.P. Morgan	MXN	384.124	157.510.000	396.512	12.388

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Swaptions (Forts.)

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 8,50 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIE Apr 2028“, Put, 8,50 %, 6. Apr. 2028“	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	57.021	(38.904)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 5,97 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE Mar 2023“, Call, 5,97 %, 30. März 2023“	J.P. Morgan	MXN	69.383	46.495.000	28	(69.355)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 6,80 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE Feb 2025“, Call, 6,80 %, 7. Feb. 2025“	J.P. Morgan	MXN	541.676	228.495.000	70.873	(470.803)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 7,29 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE Mar 2026“, Call, 7,29%, 5. März 2026	J.P. Morgan	MXN	396.524	157.510.000	97.006	(299.518)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 8,50 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE Apr 2028“, Call, 8,50 %, 6. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95.924	17.150.000	31.464	(64.460)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 9,15 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE May 2023“, Call, 9,15 %, 3. Mai 2023	J.P. Morgan	MXN	192.030	301.280.000	96.013	(96.017)
Verkauf	IRS „Erhält Festzinssatz 8,35 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE May 2023“, Call 8,35 %, 3. Mai 2023	J.P. Morgan	MXN	(122.810)	(451.920.000)	(50.282)	72.528
USD						902.856	(984.176)

Total Return Swapkontrakte

Der Fonds kann 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-Swaps“ aufgeführt.

Zum 30. September 2022 waren folgende Teilfonds in Total Return Swap-kontrakten engagiert:

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	23.453.417	(2.156.046)	05. Dez. 2022	1.401.827
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	EUR	12.449.482	(4.259.028)	21. Feb. 2023	(3.985.153)
Kauf Long	Bekleidung	Morgan Stanley	EUR	18.366.811	653.335	05. Dez. 2022	525.069
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	GBP	16.887.477	(6.040.186)	7. Aug. 2024	(6.109.059)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	CHF	8.280.103	(2.638.337)	18. Juni 2024	(1.901.545)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	1.710.282	343.188	27. März 2023	483.694
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	1.466.520	170.533	21. Aug. 2023	129.349
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	USD	5.951.250	1.383.380	18. Sept. 2023	1.396.953
Verkauf Short	Bekleidung	Merrill Lynch	USD	2.390.547	274.509	31. Okt. 2023	276.009
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	USD	856.577	102.116	13. Juli 2023	104.104

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	EUR	2.200.399	711.937	05. Dez. 2022	641.250
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	971.992	195.736	19. Mai 2032	343.175
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	1.036.549	752.282	25. Sept. 2023	752.282
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	1.032.432	170.002	26. Apr. 2023	(26.502)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1.315.612	614.465	6. März 2023	897.878
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	613.072	41.922	26. Aug. 2025	43.122
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1.716.541	358.094	29. Sept. 2023	359.258
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	350.424	10.291	31. Okt. 2023	10.291
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	CHF	2.260.785	362.406	24. Juli 2025	353.734
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	6.021.854	723.367	14. Juni 2023	591.612
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	1.497.742	552.894	07. Aug. 2025	554.320
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	3.778.379	1.325.757	13. Juli 2023	1.300.482
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	JPY	2.349.348	115.437	24. Okt. 2023	337.911
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.218.730	388.465	06. Aug. 2025	389.129
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	2.000.650	344.546	27. Feb. 2023	506.318
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	564.615	379.358	28. Feb. 2024	380.585
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	1.863.009	462.073	30. Juli 2025	434.292
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	1.533.765	112.181	24. Okt. 2023	90.188
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	839.734	58.710	25. Sept. 2023	59.774
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	2.114.042	22.643	16. Jan. 2024	56.724
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	1.518.081	576.633	17. Sept. 2024	662.773
Verkauf Short	Lebensmitteldienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.409.496	389.401	24. Juli 2024	714.283
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	HKD	6.015.936	2.869.800	23. Dez. 2022	3.246.114
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	1.191.644	28.721	31. Okt. 2023	28.721
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	1.380.101	776.324	26. Apr. 2023	563.759
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	1.169.830	55.655	18. Sept. 2025	55.655
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	1.784.803	(38.440)	5. Juni 2023	152.419
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	5.438.019	724.698	13. Juli 2023	978.431
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	2.416.893	436.326	04. Sept. 2025	436.560
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	USD	2.448.826	441.280	07. Aug. 2025	446.544
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	885.460	37.757	24. Okt. 2023	37.757
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Goldman Sachs	USD	5.053.504	472.348	31. Juli 2024	794.176
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Merrill Lynch	USD	2.365.182	146.949	31. Mai 2023	158.397
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	USD	1.747.944	386.902	13. Juli 2023	462.807
Verkauf Short	Haushaltswaren	Merrill Lynch	USD	4.013.885	1.868.231	31. Juli 2023	1.779.878
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	3.593.930	1.602.952	23. Jan. 2025	2.496.498
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	2.623.712	450.466	16. Apr. 2025	626.522
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	1.204.939	66.436	31. Okt. 2023	67.534
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	865.122	203.262	13. Juli 2023	203.162
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Morgan Stanley	EUR	958.320	158.206	05. Dez. 2022	162.232
Verkauf Short	Maschinen – Bau u. Bergbau	Merrill Lynch	USD	681.872	(174.272)	30. Juni 2023	(204.542)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	EUR	1.375.171	154.741	29. Juli 2025	158.387
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	SEK	3.094.641	118.404	9. Juli 2025	109.663
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	1.338.924	695.685	05. Dez. 2024	692.186
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	888.993	54.553	13. Juli 2023	55.076
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	CHF	2.208.086	644.014	24. Juli 2024	686.563
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	2.030.476	128.173	16. Juli 2025	98.019
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	3.783.473	445.356	6. März 2023	691.753
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	EUR	2.718.340	1.235.696	05. Dez. 2022	1.491.367
Verkauf Short	Büro- und Geschäftsausstattung	Morgan Stanley	JPY	2.343.905	77.076	24. Okt. 2023	155.413

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	J.P. Morgan	USD	5.267.197	1.821.217	21. Feb. 2023	2.094.644
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1.636.101	(525.964)	23. Jan. 2023	(486.132)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2.360.840	85.089	25. Sept. 2023	85.959
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	SEK	641.339	293.843	12. Juni 2024	298.062
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	2.634.702	247.358	2. Juli 2025	258.517
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	1.609.539	(95.955)	31. Okt. 2022	59.612
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	EUR	2.602.907	565.988	05. Dez. 2022	590.733
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	4.725.693	1.148.308	13. Juli 2023	1.219.021
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	SEK	2.345.905	387.082	7 Mai 2025	383.442
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	621.767	41.908	28. Aug. 2023	41.830
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	1.205.825	3.119	30. Juni 2023	104.453
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	553.086	572.467	5. Sept. 2024	587.143
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	7.522.489	2.638.910	30. Juni 2023	3.043.817
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	2.255.083	476.420	28. Apr. 2023	507.531
Verkauf Short	Schiffbau	Morgan Stanley	SGD	701.781	(112.709)	8 Mai 2024	(110.049)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	1.987.643	440.523	22. Juli 2025	441.585
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	899.046	7.299	18. Sept. 2025	7.046
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	1.304.689	488.776	31. Okt. 2022	644.862
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	907.734	165.403	11. Sept. 2023	165.403
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	5.637.099	1.417.217	28. Apr. 2023	1.488.314
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	4.084.155	232.357	31. Okt. 2023	233.102
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	5.156.858	806.191	13. Juli 2023	1.385.295
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	4.674.322	759.676	25. Aug. 2023	766.891
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	1.509.218	360.368	13. Juli 2023	360.368
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	CHF	1.174.453	175.982	28 Mai 2025	212.924
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	USD	1.725.380	221.904	13. Juli 2023	225.675
Verkauf Short	Diverse*	Morgan Stanley	EUR	2.293.401	48.982	29. Dez. 2023	188.916
Verkauf Short	Diverse*	Morgan Stanley	USD	30.503.004	878.453	17. Mai 2023	2.346.075
EUR							35.550.217
Schroder GAIA Helix							
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	EUR	40.498.435	315.808	5. Sept. 2023	315.808
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	JPY	47.068.312	64.700	5. Sept. 2023	64.700
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	USD	31.936.247	50.414	5. Sept. 2023	50.414
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	128.004.816	11.768.121	5. Sept. 2023	11.768.121
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	AUD	14.232.409	495.672	5. Sept. 2023	495.672
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	JPY	17.797.737	835.246	5. Sept. 2023	835.246
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	223.680.004	16.887.312	5. Sept. 2023	16.887.312
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	JPY	108.645.253	5.090.054	5. Sept. 2023	5.090.054
USD							35.507.327
Schroder GAIA Sirius US Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	3.805.503	39.279	13. Dez. 2023	39.279
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	4.841.791	(565.330)	27. Feb. 2023	(565.330)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	584.518	(94.756)	14. Aug. 2023	(94.756)
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	USD	754.815	(57.344)	13. Dez. 2023	(57.344)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	15.055.815	(2.118.459)	27. Feb. 2023	(2.119.023)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	620.240	(35.058)	29. Mai 2024	(142.164)
Kauf Long	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	5.817.552	(1.285.242)	14. März 2023	(1.288.257)
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	USD	4.292.012	(736.051)	28. Juni 2023	(736.051)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Barclays Bank	USD	2.007.840	106.334	17. Okt. 2022	96.144

* Der Kontrakt wird auf einen Korb mit verschiedenen amerikanischen Aktien aus mehreren Branchen gehalten.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	2.730.206	309.961	13. Sept. 2023	310.201
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	1.179.839	45.204	27. Dez. 2022	45.493
Verkauf Short	Baustoffe	Merrill Lynch	USD	979.629	98.725	31. Juli 2023	98.725
Verkauf Short	Baustoffe	Merrill Lynch	USD	287.823	30.901	19. Sept. 2023	30.901
Verkauf Short	Baustoffe	Merrill Lynch	USD	512.480	40.419	29. Sept. 2023	40.419
Verkauf Short	Chemie	Merrill Lynch	USD	292.035	96.103	18. Sept. 2023	96.103
Verkauf Short	Chemie	Merrill Lynch	USD	200.080	28.704	19. Sept. 2023	28.704
Verkauf Short	Chemie	Merrill Lynch	USD	422.117	25.919	02. Okt. 2023	25.919
Verkauf Short	Chemie	Merrill Lynch	USD	299.087	24.479	06. Okt. 2023	24.479
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	3.865.625	720.997	21. Feb. 2023	720.997
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	348.801	8.934	02. Okt. 2023	8.934
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	695.815	204.974	16. Okt. 2023	204.974
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	1.347.799	335.644	13. Sept. 2023	335.644
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Merrill Lynch	USD	1.575.874	121.997	30. Mai 2023	121.997
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	308.441	59.043	14. März 2023	59.043
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.250.838	393.960	13. Sept. 2023	393.960
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	117.577	28.620	3. Apr. 2023	28.620
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	740.680	117.148	14. Apr. 2023	120.099
Verkauf Short	Umweltschutz	Goldman Sachs	USD	478.935	61.998	15. Nov. 2022	61.998
Verkauf Short	Umweltschutz	Merrill Lynch	USD	796.620	60.936	9. Juni 2023	60.936
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	3.930.624	704.618	17. Nov. 2022	704.618
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	9.271.819	1.196.173	14. März 2023	1.196.173
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	3.995.484	716.403	14. Juni 2023	716.403
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	4.292.501	877.880	13. Sept. 2023	877.880
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	4.958.199	499.319	13. Dez. 2023	499.319
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	4.936.399	453.370	28. März 2023	453.370
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	3.926.953	486.081	26. Mai 2023	486.081
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	4.135.505	617.480	23. Aug. 2023	617.480
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	10.483.112	1.431.634	30. Aug. 2023	1.431.634
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	444.407	52.889	12. Juni 2023	52.889
Verkauf Short	Forstprodukte und Papier	Merrill Lynch	USD	197.199	50.491	18. Sept. 2023	50.491
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	941.262	(367)	30. Okt. 2023	(367)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	302.633	19.577	9. März 2023	19.577
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	311.977	67.757	18. Apr. 2023	67.757
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	824.448	76.207	13. Sept. 2023	76.207
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Merrill Lynch	USD	509.660	106.365	25. Sept. 2023	106.365
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	USD	487.589	93.135	13. Sept. 2023	93.135
Verkauf Short	Versicherungen	Merrill Lynch	USD	443.529	38.552	27. Dez. 2022	38.552
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	983.805	166.197	30. Mai 2023	166.197
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	626.475	142.162	13. Juli 2023	142.162
Verkauf Short	Freizeit	Merrill Lynch	USD	1.418.284	256.778	25. Sept. 2023	256.778
Verkauf Short	Medien	Merrill Lynch	USD	275.505	115.046	30. Mai 2023	115.046
Verkauf Short	Medien	Merrill Lynch	USD	470.531	22.076	30. Okt. 2023	22.076
Verkauf Short	Bergbau	Merrill Lynch	USD	200.621	(262)	02. Okt. 2023	(262)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Merrill Lynch	USD	3.305.162	362.245	25. Sept. 2023	362.640
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	423.567	78.381	13. Dez. 2023	80.075
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Goldman Sachs	USD	222.921	34.727	14. Juni 2023	34.727
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Merrill Lynch	USD	195.483	7.493	23. Okt. 2023	7.493
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	918.720	16.872	13. Juni 2023	16.872

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	516.186	42.611	25. Sept. 2023	42.611
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	1.152.156	120.722	24. Okt. 2023	121.143
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1.234.726	9.068	13. Sept. 2023	8.543
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	961.919	100.435	16. Juni 2023	100.435
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	480.056	65.601	14. März 2023	65.601
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	825.460	90.232	27. Dez. 2022	90.232
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	1.365.645	54.994	14. Aug. 2023	57.245
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	508.111	25.606	16. Okt. 2023	25.606
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	1.170.950	105.145	7. Aug. 2023	105.217
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	349.116	18.170	16. Okt. 2023	18.170
Verkauf Short	Telekommunikation	Merrill Lynch	USD	479.783	75.467	17. Juli 2023	79.655
Verkauf Short	Transport	Merrill Lynch	USD	995.051	339.215	25. Sept. 2023	339.111
USD							7.695.581
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	563.309.009	18.017.797	21. Okt. 2022	18.017.797
USD							18.017.797
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	80.081	4.120	24. Mai 2023	4.120
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	GBP	174.936	(8.035)	24. Mai 2023	(8.035)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	J.P. Morgan	GBP	6.453	737	9. Mai 2023	737
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	GBP	188.979	(11.202)	15. Mai 2029	(11.202)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	USD	108.703	(11.793)	15. Mai 2029	(11.793)
Kauf Long	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	207	(52)	24. Mai 2023	(52)
Kauf Long	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	61.342	(14.080)	15. Mai 2029	(14.080)
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	USD	23.958	(1.344)	25. Mai 2023	(1.344)
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	J.P. Morgan	USD	20.353	(3.393)	9. Mai 2023	(3.393)
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	102.585	(4.444)	15. Mai 2029	(4.444)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	4.161.777	(114.814)	24. Mai 2023	(114.814)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	6.862.395	(576.496)	24. Mai 2023	(576.496)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	DKK	223.774	(17.899)	10. Mai 2023	(17.899)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	4.803.606	(82.942)	9. Mai 2023	(78.068)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	GBP	1.727.134	(181.642)	9. Mai 2023	(176.508)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	517.416	(9.466)	9. Mai 2023	(9.466)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	USD	2.517.912	(116.652)	9. Mai 2023	(116.652)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	EUR	759.782	(56.015)	15. Mai 2029	(56.015)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	JPY	357.287	(1.044)	15. Mai 2029	(1.044)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	545.389	(61.340)	30. Sept. 2022	(61.340)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	6.236.073	(384.146)	15. Mai 2029	(384.146)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	624.621	(29.731)	24. Mai 2023	(29.731)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	GBP	1.799	(105)	24. Mai 2023	(105)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	154.087	(10.140)	24. Mai 2023	(10.140)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	3.289.666	(86.152)	24. Mai 2023	(86.152)
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	803.934	(54.698)	9. Mai 2023	(54.698)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	234.055	(20.172)	15. Mai 2029	(20.172)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	GBP	86.705	(3.731)	15. Mai 2029	(3.731)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	8.763.398	(356.173)	15. Mai 2029	(356.173)
Kauf Long	Baustoffe	Morgan Stanley	HKD	430	(81)	15. Mai 2029	(81)
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	HKD	95.790	(19.378)	24. Mai 2023	(19.378)

* Der Kontrakt wird auf einen Korb mit verschiedenen amerikanischen Aktien aus mehreren Branchen gehalten.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	USD	280.116	(19.631)	25. Mai 2023	(19.631)
Kauf Long	Kohle	J.P. Morgan	USD	222.857	(16.541)	9. Mai 2023	(16.541)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	246.595	(30.751)	24. Mai 2023	(30.751)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	165.603	(16.592)	24. Mai 2023	(16.592)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	HKD	165	(29)	9. Mai 2023	(29)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	30.286	(4.003)	15. Mai 2029	(4.003)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.245.228	(175.452)	15. Mai 2029	(175.452)
Kauf Long	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	GBP	213.937	(26)	15. Mai 2029	(26)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	699.499	(9.187)	24. Mai 2023	(9.187)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.150.930	(29.723)	24. Mai 2023	(29.723)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	335.661	(11.584)	9. Mai 2023	(11.584)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	79.673	(1.831)	9. Mai 2023	(1.831)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.937.128	(33.038)	9. Mai 2023	(33.038)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	526.601	(6.321)	15. Mai 2029	(6.321)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	65.333	(2.128)	15. Mai 2029	(2.128)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	517.868	(27.306)	15. Mai 2029	(27.306)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	3.749.923	(323.631)	15. Mai 2029	(323.631)
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	EUR	62.470	(635)	24. Mai 2023	(635)
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	USD	390.984	(29.088)	24. Mai 2023	(29.088)
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	EUR	139.239	(13.954)	9. Mai 2023	(13.954)
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	USD	26.609	(3.959)	9. Mai 2023	(3.959)
Kauf Long	Elektrik	Morgan Stanley	USD	169.431	2.009	15. Mai 2029	2.009
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	J.P. Morgan	EUR	8.443	(103)	9. Mai 2023	(103)
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	391.596	(20.139)	24. Mai 2023	(20.139)
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	564	(42)	25. Mai 2023	(42)
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	USD	456.946	(27.388)	9. Mai 2023	(27.388)
Kauf Long	Elektronik	Morgan Stanley	USD	139.175	(16.012)	15. Mai 2029	(16.012)
Kauf Long	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	6.756	(379)	25. Mai 2023	(379)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	242.719	(8.379)	24. Mai 2023	(8.379)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	129.671	(7.589)	25. Mai 2023	(7.589)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	144.304	(15.682)	15. Mai 2029	(15.682)
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	1.758	(257)	15. Mai 2029	(257)
Kauf Long	Aktienindex	J.P. Morgan	JPY	168.551	(6.095)	9. Mai 2023	(6.095)
Kauf Long	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	1.062.239	(42.641)	9. Mai 2023	(42.641)
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	1.207.268	(51.388)	15. Mai 2029	(51.388)
Kauf Long	Lebensmittel	Morgan Stanley	HKD	44.175	(3.379)	15. Mai 2029	(3.379)
Kauf Long	Gas	Morgan Stanley	HKD	74.088	(12.173)	15. Mai 2029	(12.173)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	CHF	98.136	(7.037)	24. Mai 2023	(7.037)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	EUR	190.862	(18.040)	24. Mai 2023	(18.040)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	GBP	29.970	356	24. Mai 2023	356
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	HKD	2.865	33	24. Mai 2023	33
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	4.287.279	(201.538)	24. Mai 2023	(201.538)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	90.718	(997)	25. Mai 2023	(997)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	EUR	2.030	(127)	9. Mai 2023	(127)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	2.842.743	(158.027)	9. Mai 2023	(158.027)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	CHF	125.486	(4.512)	15. Mai 2029	(4.512)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	EUR	56.821	(5.653)	15. Mai 2029	(5.653)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	GBP	123.529	(1.081)	15. Mai 2029	(1.081)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	HKD	107.993	(8.395)	15. Mai 2029	(8.395)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	907.128	(80.755)	15. Mai 2029	(80.755)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	CHF	5.790	252	24. Mai 2023	252
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	5.543.582	(223.072)	24. Mai 2023	(223.072)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	CHF	63.805	(3.499)	9. Mai 2023	(3.499)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	2.171.333	(158.015)	9. Mai 2023	(158.015)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	CHF	242.350	731	15. Mai 2029	731
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.929.780	(132.938)	15. Mai 2029	(132.938)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	JPY	39.322	(3.513)	24. Mai 2023	(3.513)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	USD	4.373	(388)	25. Mai 2023	(388)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	J.P. Morgan	JPY	13.411	(1.028)	9. Mai 2023	(1.028)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	26.088	(2.634)	15. Mai 2029	(2.634)
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	JPY	101.445	(10.348)	24. Mai 2023	(10.348)
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	396.404	(41.567)	24. Mai 2023	(41.567)
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	GBP	438.882	(10.295)	9. Mai 2023	(10.295)
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	HKD	84.127	(11.569)	9. Mai 2023	(11.569)
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	JPY	457.815	(38.376)	9. Mai 2023	(38.376)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	231.699	(17.873)	15. Mai 2029	(17.873)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	HKD	47.916	(7.566)	15. Mai 2029	(7.566)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	JPY	769.320	(65.982)	15. Mai 2029	(65.982)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	391.950	(35.453)	15. Mai 2029	(35.453)
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	HKD	78.659	(9.377)	9. Mai 2023	(9.377)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	HKD	536	(56)	15. Mai 2029	(56)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	705.723	(129.874)	15. Mai 2029	(129.874)
Kauf Long	Investmentgesellschaften	J.P. Morgan	SEK	395.201	(14.952)	9. Mai 2023	(14.952)
Kauf Long	Investmentgesellschaften	Morgan Stanley	SEK	724.915	(36.121)	15. Mai 2029	(36.121)
Kauf Long	Eisen / Stahl	J.P. Morgan	USD	83.206	(16.988)	9. Mai 2023	(16.988)
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	EUR	4.690	(140)	24. Mai 2023	(140)
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	68.650	(3.396)	24. Mai 2023	(3.396)
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	60.467	(7.056)	15. Mai 2029	(7.056)
Kauf Long	Medien	Goldman Sachs	USD	21.283	(3.069)	24. Mai 2023	(3.069)
Kauf Long	Medien	J.P. Morgan	USD	105.591	(17.937)	9. Mai 2023	(17.937)
Kauf Long	Metallprodukte/Eisenwaren	Goldman Sachs	EUR	59.830	2.213	24. Mai 2023	2.213
Kauf Long	Metallprodukte/Eisenwaren	Morgan Stanley	SEK	33.231	118	15. Mai 2029	118
Kauf Long	Metallprodukte/Eisenwaren	Morgan Stanley	USD	309.322	(18.777)	15. Mai 2029	(18.777)
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	GBP	313.026	(150)	24. Mai 2023	(150)
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	GBP	482.573	(1.351)	9. Mai 2023	(1.351)
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	CAD	544.114	(11.838)	15. Mai 2029	(11.838)
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	USD	178.229	(14.282)	15. Mai 2029	(14.282)
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	3.797	(254)	25. Mai 2023	(254)
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	NOK	69.422	(2.699)	24. Mai 2023	(2.699)
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	USD	6.485	(413)	24. Mai 2023	(413)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	CAD	105.992	(4.368)	9. Mai 2023	(4.368)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	JPY	3.469	(332)	9. Mai 2023	(332)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	USD	1.718.748	(116.418)	9. Mai 2023	(116.418)
Kauf Long	Öl u. Gas	Morgan Stanley	CAD	142.915	(8.066)	15. Mai 2029	(8.066)
Kauf Long	Öl u. Gas	Morgan Stanley	USD	985.859	(102.070)	15. Mai 2029	(102.070)
Kauf Long	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	141.557	(5.532)	9. Mai 2023	(5.532)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Öl- u. Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	HKD	964	(46)	15. Mai 2029	(46)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	1.034.755	(2.615)	24. Mai 2023	(2.615)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	446.210	15.804	24. Mai 2023	15.804
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	2.151.033	(10.920)	24. Mai 2023	(10.920)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	HKD	5.694	252	24. Mai 2023	252
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	1.712.935	82.802	24. Mai 2023	82.802
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	3.193.097	28.491	24. Mai 2023	28.491
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	139.043	(7.452)	9. Mai 2023	(7.452)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	439.969	(27.622)	9. Mai 2023	(27.622)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	HUF	125.316	(7.120)	9. Mai 2023	(7.120)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	304.372	(6.892)	9. Mai 2023	(6.892)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	4.158.242	(104.578)	9. Mai 2023	(104.578)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	181.509	(18.190)	15. Mai 2029	(18.190)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	GBP	208.604	5.989	15. Mai 2029	5.989
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	394.142	(635)	15. Mai 2029	(635)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2.082.127	(136.865)	15. Mai 2029	(136.865)
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	1.147.872	(68.921)	9. Mai 2023	(68.921)
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	CAD	361.535	(38.847)	15. Mai 2029	(38.847)
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	656.683	(59.352)	15. Mai 2029	(59.352)
Kauf Long	Private Equity	Goldman Sachs	USD	933.295	(149.008)	24. Mai 2023	(149.008)
Kauf Long	Private Equity	J.P. Morgan	USD	1.468.908	(223.713)	9. Mai 2023	(223.713)
Kauf Long	Private Equity	Morgan Stanley	USD	617.013	(65.166)	15. Mai 2029	(65.166)
Kauf Long	Immobilien	Goldman Sachs	SEK	203.809	4.395	24. Mai 2023	4.395
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	GBP	77.524	(9.763)	24. Mai 2023	(9.763)
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	USD	214.282	(26.912)	24. Mai 2023	(26.912)
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	GBP	84.786	(13.984)	9. Mai 2023	(13.984)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	98.957	(2.485)	24. Mai 2023	(2.485)
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	475.501	(52.659)	15. Mai 2029	(52.659)
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	EUR	2.469	(237)	24. Mai 2023	(237)
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	JPY	65.409	(7.224)	24. Mai 2023	(7.224)
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	57.027	(4.324)	24. Mai 2023	(4.324)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	JPY	22.272	(2.288)	9. Mai 2023	(2.288)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	218.562	(33.043)	9. Mai 2023	(33.043)
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	227.049	(34.071)	9. Mai 2023	(34.071)
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	496.008	(39.040)	15. Mai 2029	(39.040)
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	EUR	453.304	(50.909)	15. Mai 2029	(50.909)
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	27.189.493	330.563	27. März 2023	330.563
Kauf Long	Wasser	Morgan Stanley	USD	127.212	(2.733)	15. Mai 2029	(2.733)
Verkauf Short	Werbung	Goldman Sachs	USD	802.681	32.598	24. Mai 2023	32.598
Verkauf Short	Fluggesellschaften	Goldman Sachs	USD	132.653	27.325	24. Mai 2023	27.325
Verkauf Short	Fluggesellschaften	Morgan Stanley	USD	125.723	16.332	15. Mai 2029	16.332
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	EUR	164.152	6.293	9. Mai 2023	6.293
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	EUR	49.834	3.346	24. Mai 2023	3.346
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	HKD	65.344	5.905	24. Mai 2023	5.905
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	633.871	79.408	24. Mai 2023	79.408
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	USD	71.369	3.670	9. Mai 2023	3.670
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	HKD	97.588	12.328	15. Mai 2029	12.328
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	921.464	111.926	15. Mai 2029	111.926

* Der Kontrakt wird auf einen Korb mit verschiedenen amerikanischen Aktien aus mehreren Branchen gehalten.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	HKD	164.825	9.955	24. Mai 2023	9.955
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	JPY	113.549	3.028	24. Mai 2023	3.028
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	USD	223.217	20.443	24. Mai 2023	20.443
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	J.P. Morgan	USD	1.063	169	9. Mai 2023	169
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	JPY	2.172	65	15. Mai 2029	65
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	264.052	39.787	15. Mai 2029	39.787
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	AUD	535.873	31.086	24. Mai 2023	31.086
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CZK	158.803	3.437	24. Mai 2023	3.437
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	5.897.573	441.655	24. Mai 2023	442.933
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	GBP	1.793.461	177.476	24. Mai 2023	177.476
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	PLN	774.836	46.809	24. Mai 2023	46.809
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SEK	814.549	24.297	24. Mai 2023	24.297
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	13.179.606	1.069.922	24. Mai 2023	1.069.922
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	CHF	443.042	24.865	9. Mai 2023	24.865
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	CZK	409.250	(40.773)	9. Mai 2023	(40.773)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	6.960.206	442.397	9. Mai 2023	421.076
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	GBP	1.929.442	154.793	9. Mai 2023	146.929
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	1.302.943	(25.876)	9. Mai 2023	(25.876)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SGD	2.643	5	9. Mai 2023	5
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	2.110.092	57.025	9. Mai 2023	57.025
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	AUD	718.325	28.596	15. Mai 2029	28.596
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CAD	1.268.559	48.446	15. Mai 2029	48.446
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	EUR	995.173	97.890	15. Mai 2029	97.890
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	17.908.113	1.361.538	15. Mai 2029	1.361.538
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	HKD	63.780	636	24. Mai 2023	636
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	HKD	961	(63)	9. Mai 2023	(63)
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	HKD	4.517	(186)	15. Mai 2029	(186)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	AUD	418.246	(2.825)	24. Mai 2023	(2.825)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	CHF	564.080	41.279	24. Mai 2023	41.279
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	EUR	190.876	12.068	24. Mai 2023	12.068
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	256.881	4.053	24. Mai 2023	4.053
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	NOK	76.234	4.717	24. Mai 2023	4.717
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	1.602.082	(26.115)	24. Mai 2023	(26.115)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	AUD	2.387	75	9. Mai 2023	75
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	CHF	50.030	3.466	9. Mai 2023	3.466
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	EUR	14.869	701	9. Mai 2023	701
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	HKD	118.509	11.379	9. Mai 2023	11.379
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	NOK	15.442	3.925	9. Mai 2023	3.925
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	2.194.020	165.739	9. Mai 2023	165.739
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	AUD	546.556	4.695	15. Juni 2032	4.695
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	HKD	79.676	5.913	15. Mai 2029	5.913
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	NOK	154.214	47.300	15. Mai 2029	47.300
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	6.210.406	643.920	15. Mai 2029	643.920
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	CHF	4.460	144	24. Mai 2023	144
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	417.639	7.759	24. Mai 2023	7.759
Verkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	JPY	115.154	2.453	9. Mai 2023	2.453
Verkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	USD	54.657	(10)	9. Mai 2023	(10)
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	175.000	2.678	15. Mai 2029	2.678

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	USD	165.264	10.849	24. Mai 2023	10.849
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	USD	3.415	(95)	25. Mai 2023	(95)
Verkauf Short	Chemie	Morgan Stanley	USD	879.684	31.739	15. Mai 2029	31.739
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	177.651	18.171	24. Mai 2023	18.171
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	85.822	12.627	9. Mai 2023	12.627
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.500.258	119.086	15. Mai 2029	119.086
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	59.151	7.050	24. Mai 2023	7.050
Verkauf Short	Computer	J.P. Morgan	USD	92.051	964	9. Mai 2023	964
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	1.585.237	92.805	15. Mai 2029	92.805
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	EUR	144.206	1.627	24. Mai 2023	1.627
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	JPY	2.978	(21)	24. Mai 2023	(21)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	47.788	1.703	15. Mai 2029	1.703
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	USD	241.620	19.672	15. Mai 2029	19.672
Verkauf Short	Rentenfonds	Goldman Sachs	EUR	111.364	1.458	24. Mai 2023	1.458
Verkauf Short	Rentenfonds	Goldman Sachs	USD	5.579	117	24. Mai 2023	117
Verkauf Short	Rentenfonds	Morgan Stanley	EUR	4.093.723	79.126	15. Mai 2029	79.126
Verkauf Short	Rentenfonds	Morgan Stanley	USD	255.385	5.945	15. Mai 2029	5.945
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Goldman Sachs	EUR	260.444	3.399	24. Mai 2023	3.399
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Goldman Sachs	USD	125.803	8.125	24. Mai 2023	8.125
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	J.P. Morgan	USD	129.689	1.330	5. Mai 2023	1.330
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Morgan Stanley	USD	142.701	5.136	15. Mai 2029	5.136
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	1.575.919	140.673	24. Mai 2023	140.673
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	1.269.603	105.040	24. Mai 2023	105.040
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	SEK	172.747	(10.542)	24. Mai 2023	(10.542)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	3.176.651	233.262	24. Mai 2023	233.262
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	691.476	41.862	9. Mai 2023	41.862
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	215.540	10.467	9. Mai 2023	10.467
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	15.400	1.003	9. Mai 2023	1.003
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	SEK	216.931	26.477	9. Mai 2023	26.477
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	SGD	2.633	(4)	9. Mai 2023	(4)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.796.327	122.288	9. Mai 2023	122.288
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	544.919	104.781	15. Mai 2029	104.781
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	582.358	25.053	15. Mai 2029	25.053
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	653.180	59.330	15. Mai 2029	59.330
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	SEK	455.840	(8.555)	15. Mai 2029	(8.555)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	253.501	15.461	30. Sept. 2022	15.461
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	4.886.018	335.668	15. Mai 2029	335.668
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	5.399.202	649.580	24. Mai 2023	649.580
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	863.212	97.002	5. Mai 2023	97.002
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	1.695.777	203.453	9. Mai 2023	203.453
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	HKD	53.402	5.566	15. Mai 2029	5.566
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	2.373.890	242.801	15. Mai 2029	242.801
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	28.770	2.940	24. Mai 2023	2.940
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley	USD	409.719	64.874	15. Mai 2029	64.874
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	JPY	824.140	14.864	24. Mai 2023	14.864
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	JPY	61.256	2.952	9. Mai 2023	2.952
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	EUR	156.136	81.910	15. Mai 2029	81.910
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	477.549	43.203	15. Mai 2029	43.203

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	NOK	167.935	(2.669)	24. Mai 2023	(2.669)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	SEK	28.094	(51)	24. Mai 2023	(51)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	270.415	22.850	24. Mai 2023	22.850
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	HKD	1.101	177	9. Mai 2023	177
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	SEK	92.587	13.483	9. Mai 2023	13.483
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	274.144	30.079	9. Mai 2023	30.079
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	NOK	31.570	1.737	15. Mai 2029	1.737
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	SEK	46.319	2.042	15. Mai 2029	2.042
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	USD	504.300	73.538	15. Mai 2029	73.538
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	246.581	9.594	24. Mai 2023	9.594
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	171.980	2.915	24. Mai 2023	2.915
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	EUR	155.163	24.206	9. Mai 2023	24.206
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	388.762	38.981	15. Mai 2029	38.981
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	96.167	2.737	15. Mai 2029	2.737
Verkauf Short	Umweltschutz	Morgan Stanley	USD	90.070	16.649	15. Mai 2029	16.649
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	EUR	308.101	26.698	24. Mai 2023	26.698
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	JPY	1.936.851	89.783	24. Mai 2023	89.783
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	7.011.862	306.810	24. Mai 2023	306.810
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	712.252	(3.018)	5. Mai 2023	(3.018)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	5.448.272	522.204	9. Mai 2023	528.884
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	3.277.270	272.511	15. Mai 2029	272.511
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	24.914.303	2.267.906	15. Mai 2029	2.268.911
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	EUR	106.765	4.833	24. Mai 2023	4.833
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	GBP	26.001	5.657	24. Mai 2023	5.657
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	129.798	4.202	24. Mai 2023	4.202
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	147.194	12.203	9. Mai 2023	12.203
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	JPY	3.755	(35)	9. Mai 2023	(35)
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	USD	63.464	665	22. Mai 2023	665
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	257.959	13.398	15. Mai 2029	13.398
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	GBP	56.784	15.144	15. Mai 2029	15.144
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	131.816	(2.544)	15. Mai 2029	(2.544)
Verkauf Short	Gas	Goldman Sachs	USD	1.252.302	134.432	24. Mai 2023	134.432
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	USD	260.305	28.370	15. Mai 2029	28.370
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	CHF	512.343	19.273	24. Mai 2023	19.273
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	DKK	123.842	(1.233)	24. Mai 2023	(1.233)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	HKD	38.688	4.098	24. Mai 2023	4.098
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	388.386	5.217	24. Mai 2023	5.217
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	958.898	66.389	24. Mai 2023	66.389
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	DKK	138.032	9.457	9. Mai 2023	9.457
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	SEK	210.388	8.751	9. Mai 2023	8.751
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	327.979	(5.262)	9. Mai 2023	(5.262)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	HKD	213.328	25.815	15. Mai 2029	25.815
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	SEK	167.547	7.038	15. Mai 2029	7.038
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	856.439	67.954	15. Mai 2029	67.954
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	490.706	14.798	24. Mai 2023	14.798
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	JPY	224.355	7.930	24. Mai 2023	7.930
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	2.181.651	107.829	24. Mai 2023	107.829
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	235.592	21.112	9. Mai 2023	21.112
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	32.637	2.904	9. Mai 2023	2.904

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	476.324	41.759	9. Mai 2023	41.759
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	541.066	39.872	15. Mai 2029	39.872
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	220.365	8.371	15. Mai 2029	8.371
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	902.106	73.219	15. Mai 2029	73.219
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	161.799	9.437	24. Mai 2023	9.437
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	208.454	8.584	15. Mai 2029	8.354
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	USD	169.670	12.886	15. Mai 2029	12.886
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	CHF	92.781	7.924	24. Mai 2023	7.924
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	EUR	739.973	(4.505)	24. Mai 2023	(4.505)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	GBP	1.633.875	139.492	24. Mai 2023	139.492
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	4.051.062	291.464	24. Mai 2023	291.464
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	AUD	451.839	–	9. Mai 2023	–
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	CHF	217.026	15.337	9. Mai 2023	15.337
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	EUR	789.276	6.957	9. Mai 2023	6.957
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	GBP	88.514	12.034	9. Mai 2023	12.034
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	JPY	425.448	19.168	9. Mai 2023	19.168
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	USD	1.564.824	64.701	9. Mai 2023	64.701
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	CHF	422.836	47.389	15. Mai 2029	47.389
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	445.957	35.669	30. Sept. 2022	35.669
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	222.971	9.912	15. Mai 2029	9.912
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	JPY	424.378	36.971	15. Mai 2029	36.971
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	395.133	26.381	30. Sept. 2022	26.381
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	3.130.178	175.967	15. Mai 2029	178.793
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	EUR	123.253	30.623	24. Mai 2023	30.623
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	GBP	17.453	2.905	15. Mai 2029	2.905
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	HKD	118.339	(2.757)	15. Mai 2029	(2.757)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	146.110	13.551	15. Mai 2029	13.551
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Goldman Sachs	SEK	46.769	363	24. Mai 2023	363
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Goldman Sachs	USD	451.506	66.982	24. Mai 2023	66.982
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	J.P. Morgan	SEK	409.610	16.903	9. Mai 2023	16.903
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Morgan Stanley	SEK	1.481.483	75.227	15. Mai 2029	75.227
Verkauf Short	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	USD	166.415	552	15. Mai 2029	552
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	JPY	115.229	837	24. Mai 2023	837
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	USD	309.741	12.013	9. Mai 2023	12.013
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	CAD	85.720	1.639	15. Mai 2029	1.639
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	JPY	2.208	33	15. Mai 2029	33
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	110.784	18.391	15. Mai 2029	18.391
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	GBP	194.608	23.274	24. Mai 2023	23.274
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	USD	106.964	8.585	9. Mai 2023	8.585
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	GBP	163.617	22.946	15. Mai 2029	22.946
Verkauf Short	Maschinen – Bau u. Bergbau	Goldman Sachs	USD	215.724	16.859	24. Mai 2023	16.859
Verkauf Short	Maschinen – Bau u. Bergbau	Morgan Stanley	USD	219.067	22.675	15. Mai 2029	23.637
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	245.658	18.739	24. Mai 2023	18.739
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	227.531	16.095	15. Mai 2029	16.095
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	391.898	49.491	15. Mai 2029	49.491
Verkauf Short	Bergbau	J.P. Morgan	USD	109.832	4.386	5. Mai 2023	4.474
Verkauf Short	Bergbau	Morgan Stanley	USD	18.255	1.502	15. Mai 2029	1.502
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	151.825	10.670	24. Mai 2023	10.670

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	688.558	50.620	15. Mai 2029	51.345
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	AUD	214.656	19.486	24. Mai 2023	19.486
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	CAD	188.208	10.460	25. Mai 2023	10.460
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	EUR	609.721	2.139	24. Mai 2023	2.139
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	JPY	294.865	28.837	24. Mai 2023	28.837
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	USD	1.690.728	74.686	24. Mai 2023	74.686
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	CAD	928.472	92.424	9. Mai 2023	92.424
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	EUR	114.727	13.536	9. Mai 2023	13.536
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	USD	7.288.436	787.045	9. Mai 2023	796.239
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	AUD	114.891	11.979	15. Juni 2032	11.979
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	CAD	1.955.589	144.738	15. Mai 2029	144.738
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	HKD	2.898	22	15. Mai 2029	22
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	USD	3.030.840	368.725	15. Mai 2029	368.725
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	663.874	72.108	24. Mai 2023	72.108
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.125.907	56.531	9. Mai 2023	56.531
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	189.143	10.279	15. Mai 2029	10.279
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Goldman Sachs	USD	2.958	63	22. Mai 2023	63
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Goldman Sachs	USD	171.399	10.418	24. Mai 2023	10.418
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Morgan Stanley	USD	214.608	20.747	15. Mai 2029	20.747
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	DKK	631.748	(19.964)	24. Mai 2023	(19.964)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	1.194.272	23.648	24. Mai 2023	23.648
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	68.738	6.954	24. Mai 2023	6.954
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	HKD	165.304	10.885	24. Mai 2023	10.885
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	274.054	(272)	24. Mai 2023	(272)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	692.272	42.882	24. Mai 2023	42.882
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	17.791	228	25. Mai 2023	228
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	DKK	17.724	480	9. Mai 2023	480
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	38.694	924	9. Mai 2023	924
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	165.963	25.914	9. Mai 2023	25.914
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	2.506	(12)	9. Mai 2023	(12)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	28.746	2.128	9. Mai 2023	2.128
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	DKK	259.837	2.346	15. Mai 2029	2.346
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	5.338	142	15. Mai 2029	142
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	HKD	16.024	1.980	15. Mai 2029	1.980
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	587.645	9.569	15. Mai 2029	9.569
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1.075.679	22.519	15. Mai 2029	22.519
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	1.030.628	72.547	24. Mai 2023	72.547
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	1.829.441	216.637	9. Mai 2023	216.637
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	USD	523.937	64.623	15. Mai 2029	64.623
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	USD	1.409.093	92.738	24. Mai 2023	92.738
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	USD	179.677	2.440	9. Mai 2023	2.440
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	SEK	154.070	20.334	15. Mai 2029	20.334
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	USD	1.407.043	120.103	15. Mai 2029	120.103
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	SEK	536.917	21.772	24. Mai 2023	21.772
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	USD	642	110	25. Mai 2023	110
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	SEK	348.941	46.677	9. Mai 2023	46.677
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	USD	5.058	527	9. Mai 2023	527
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	SEK	621.479	49.762	15. Mai 2029	49.762

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	EUR	9.843	1.107	24. Mai 2023	1.107
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	1.542.014	290.642	24. Mai 2023	290.642
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	SGD	2.508	99	9. Mai 2023	99
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	USD	22.565	2.964	9. Mai 2023	2.964
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	1.164.291	156.626	15. Mai 2029	156.626
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	JPY	3.657	50	24. Mai 2023	50
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	SEK	5.263	162	24. Mai 2023	162
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	631.689	32.251	24. Mai 2023	32.251
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	HKD	421.939	62.556	9. Mai 2023	62.556
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	1.084.889	120.407	9. Mai 2023	120.407
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	HKD	404.196	62.840	15. Mai 2029	62.840
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	JPY	1.582	2	15. Mai 2029	2
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	SEK	15.046	604	15. Mai 2029	604
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	SGD	2.626	137	15. Mai 2029	137
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	1.612.267	103.478	15. Mai 2029	103.478
Verkauf Short	Spar- und Darlehensgeschäft	Goldman Sachs	USD	691.559	59.331	24. Mai 2023	59.331
Verkauf Short	Spar- und Darlehensgeschäft	Morgan Stanley	USD	615.821	28.819	15. Mai 2029	28.819
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	187.624	22.994	24. Mai 2023	22.994
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	EUR	108.512	6.548	9. Mai 2023	6.548
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	442.487	43.675	15. Mai 2029	43.675
Verkauf Short	Schiffbau	Morgan Stanley	USD	159.563	16.567	15. Mai 2029	16.567
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	CHF	33.751	2.664	24. Mai 2023	2.664
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	GBP	18.364	1.802	24. Mai 2023	1.802
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	156.548	(14.051)	24. Mai 2023	(14.051)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	570.573	21.091	24. Mai 2023	21.091
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	AUD	162.264	4.263	9. Mai 2023	4.263
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	51.257	5.126	9. Mai 2023	5.126
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	45.501	2.900	15. Mai 2029	2.900
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	EUR	29.922	299	15. Mai 2029	299
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	685.175	74.617	15. Mai 2029	74.617
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	329.881	22.483	24. Mai 2023	22.483
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	JPY	80.424	8.613	9. Mai 2023	8.613
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	171.846	42.473	9. Mai 2023	42.473
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	318.613	26.990	15. Mai 2029	26.990
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	DKK	76.208	4.344	24. Mai 2023	4.344
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	JPY	662.873	131.926	24. Mai 2023	131.926
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	USD	111.004	19.997	24. Mai 2023	19.997
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	DKK	314.143	51.379	9. Mai 2023	51.379
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	JPY	46.669	10.195	9. Mai 2023	10.195
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	USD	150.627	16.143	9. Mai 2023	16.143
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	DKK	43.772	4.401	15. Mai 2029	4.401
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	HKD	52.714	4.929	15. Mai 2029	4.929
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	JPY	45.481	8.762	15. Mai 2029	8.762
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	USD	276.752	8.285	15. Mai 2029	8.806
Verkauf Short	Wasser	Goldman Sachs	USD	96.161	9.469	24. Mai 2023	9.469
Verkauf Short	Wasser	Morgan Stanley	USD	483.431	45.507	15. Mai 2029	45.507
USD							12.526.162

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Differenzkontrakte

Differenzkontrakte („CFD“) 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 2022 wiesen die folgenden Teilfonds Differenzkontrakte auf Finanzindizes und Futures-Kontrakte auf:

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD auf den Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Bank of America	(1.082)	(505.605)	43.179
CFD auf den Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Bank of America	(857)	(100.016)	(330)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Bank of America	45	24.194	(6.152)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Bank of America	(623)	(643.396)	30.745
CFD auf den Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Bank of America	(1.347)	(610.678)	50.663
CFD auf den Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Bank of America	(891)	(466.826)	40.009
CFD auf den Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Bank of America	281	204.260	(11.765)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Bank of America	276	252.722	(11.913)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Index	Bank of America	(1.125)	(622.095)	55.869
CFD auf den Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Bank of America	467	125.780	(89.802)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Media Price Index	Bank of America	(1.437)	(423.218)	15.274
CFD auf den Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Bank of America	576	174.484	(13.385)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Bank of America	(218)	(189.602)	1.448
CFD auf den Stoxx Europe 600 Retail Price Index	Bank of America	(583)	(142.094)	15.181
CFD auf den Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Bank of America	(1.367)	(698.266)	61.393
CFD auf den Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Bank of America	992	187.141	(27.309)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Bank of America	(2.962)	(498.110)	39.225
CFD auf den Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Bank of America	968	307.138	(30.016)
CFD auf den S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	(940)	(1.054.974)	83.864
CFD auf den S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	(8)	(5.566)	429
CFD auf den S&P 500 Energy Sector Index	Goldman Sachs	229	126.536	(13.566)
CFD auf den S&P 500 Financials Sector Index	Goldman Sachs	(3.575)	(1.803.197)	145.674
CFD auf den S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	(709)	(1.000.652)	(61.702)
CFD auf den S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	(1.849)	(1.295.406)	31.904
CFD auf den S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	(692)	(1.439.253)	162.548
CFD auf den S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	(2.771)	(1.185.345)	153.046
CFD auf den S&P 500 Utilities Sector Index	Goldman Sachs	1.380	458.881	(85.800)
			USD (10.823.163)	578.711
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
CFD auf australische Aktien	Morgan Stanley	(56.367)	334.592	334.592
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	260.000	278.625	278.625
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	(151.937)	338.380	338.380
CFD auf neuseeländische Aktien	Morgan Stanley	(40.917)	299.019	299.019
CFD auf norwegische Aktien	Morgan Stanley	408.000	322.248	322.248
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	(38.517)	109.773	109.773
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(1.027.576)	6.515.711	6.529.607
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(1.971.428)	8.202.479	8.217.327
			USD 16.400.827	16.429.571
Schroder GAIA Helix				
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	3.044.520	(738.984)	(738.984)
CFD auf australische Aktien	J.P. Morgan	1.408.819	(510.869)	(510.869)
CFD auf österreichische Aktien	Goldman Sachs	78.259	(25.175)	(24.365)
CFD auf österreichische Aktien	J.P. Morgan	21.623	(51.019)	(56.521)
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	46.935	(96.858)	(96.749)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf belgische Aktien	J.P. Morgan	7.388	(26.818)	(26.818)
CFD auf brasilianische Aktien	Goldman Sachs	218	(6.573)	(6.573)
CFD auf brasilianische Aktien	J.P. Morgan	781	(82.255)	(82.255)
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	1.880.690	(2.406.757)	(2.374.401)
CFD auf britische Aktien	J.P. Morgan	2.014.789	(472.271)	(472.271)
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	18.466	(24.831)	(24.831)
CFD auf kanadische Aktien	J.P. Morgan	11.782	(49.093)	(49.093)
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	13.316.895	(5.552.136)	(5.554.769)
CFD auf chinesische Aktien	J.P. Morgan	5.638.834	(2.284.290)	(2.284.290)
CFD auf dänische Aktien	Goldman Sachs	51.256	(192.562)	(192.562)
CFD auf dänische Aktien	J.P. Morgan	39.612	(68.056)	(68.056)
CFD auf niederländische Aktien	Goldman Sachs	778.654	(640.735)	(641.697)
CFD auf niederländische Aktien	J.P. Morgan	112.773	(136.614)	(136.614)
CFD auf finnische Aktien	Goldman Sachs	68.555	355.671	366.836
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	366.741	(1.296.388)	(1.303.894)
CFD auf französische Aktien	J.P. Morgan	340.369	(607.998)	(607.998)
CFD auf georgische Aktien	Goldman Sachs	(39.384)	33.853	33.853
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	268.990	(1.026.145)	(1.026.774)
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	52.127	(86.892)	(86.892)
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	4.748.801	(2.065.264)	(2.061.036)
CFD auf Aktien aus Hongkong	J.P. Morgan	1.709.900	(594.041)	(594.041)
CFD auf ungarische Aktien	Goldman Sachs	(25.015)	31.394	31.394
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	90.161	(190.620)	(190.620)
CFD auf indische Aktien	J.P. Morgan	81.335	(586.256)	(595.178)
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	200.699	(220.087)	(220.087)
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	4.501	(79.713)	(79.713)
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	161.304	(105.526)	(97.462)
CFD auf italienische Aktien	J.P. Morgan	379.003	(256.834)	(256.834)
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	1.268.400	(813.682)	(813.682)
CFD auf japanische Aktien	J.P. Morgan	15.737.000	(9.963.828)	(9.963.828)
CFD auf luxemburgische Aktien	Goldman Sachs	23.374	(22.435)	(22.110)
CFD auf Aktien aus Macau	Goldman Sachs	262.000	141.849	141.849
CFD auf Aktien aus Monaco	J.P. Morgan	3.583	(4.192)	(4.192)
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	342.464	(97.921)	(97.921)
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P. Morgan	511.325	(8.677)	(8.677)
CFD auf norwegische Aktien	Goldman Sachs	90.862	(254.102)	(254.102)
CFD auf norwegische Aktien	J.P. Morgan	75.114	(148.943)	(148.943)
CFD auf portugiesische Aktien	J.P. Morgan	115.005	(39.660)	(39.660)
CFD auf russische Aktien	Goldman Sachs	6.978	-	-
CFD auf saudi-arabische Aktien	J.P. Morgan	221.073	(34.256)	(34.256)
CFD auf Aktien aus Singapur	Goldman Sachs	653.174	(38.538)	(38.538)
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	1.610.800	(245.264)	(245.264)
CFD auf südkoreanische Aktien	Goldman Sachs	(36.336)	107.823	107.823
CFD auf südkoreanische Aktien	J.P. Morgan	(19.122)	(33.459)	(33.459)
CFD auf spanische Aktien	Goldman Sachs	371.362	(210.959)	(210.959)
CFD auf spanische Aktien	J.P. Morgan	896.108	(278.613)	(278.613)
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	262.120	(200.656)	(203.062)
CFD auf schwedische Aktien	J.P. Morgan	120.050	(14.525)	(14.525)
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	19.876	(79.121)	(80.064)
CFD auf Schweizer Aktien	J.P. Morgan	8.392	(51.631)	(51.631)
CFD auf taiwanische Aktien	Goldman Sachs	11.844	(135.851)	(135.851)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf taiwanische Aktien	J.P. Morgan	(1.425.891)	143.416	143.416
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	1.740.483	(4.727.028)	(4.739.142)
CFD auf US-Aktien	J.P. Morgan	757.474	(1.039.483)	(1.042.929)
CFD auf FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(251)	381.004	381.004
CFD auf GS UK Custom Basket	Goldman Sachs	(55.905)	414.674	414.674
CFD auf GS Tactical Factor Value United States Bottom PR USD	Goldman Sachs	(6.681)	1.031.279	1.031.279
CFD auf GS Tactical Factor Value United States Top PR USD	Goldman Sachs	9.859	(1.199.150)	(1.199.150)
CFD auf HXE Europe Banks Index	Goldman Sachs	77.817	(474.737)	(474.737)
CFD auf HXE Pharma Index	Goldman Sachs	84.335	148.782	148.782
CFD auf HXE Staples Index	Goldman Sachs	202.383	(220.140)	(220.140)
CFD auf HXE-Telefonindex	Goldman Sachs	51.402	(89.889)	(89.889)
CFD auf MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(57.757)	8.165.107	8.165.107
CFD auf MSCI EM Europe 10/40 Index	Goldman Sachs	(838)	24.622	24.622
			USD (29.928.926)	(29.916.932)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	(1.221.894)	(114.327)	(111.365)
CFD auf niederländische Aktien	Morgan Stanley	46.784	(26.199)	(26.199)
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(62.441)	134.368	134.368
CFD auf FTSE 250 Index	Bank of America	(94)	127.821	127.821
CFD auf MSBEUK01 Index	Morgan Stanley	(23.338)	138.628	138.628
			GBP 260.291	263.253

Credit Default Index-Swapkontrakte

Ein Credit Default Index Swap ermöglicht die Übertragung des Ausfallrisikos. Dadurch kann der Fonds einen effektiven Versicherungsschutz in Bezug auf eine von ihm gehaltene Referenzindexanleihe erwerben (Absicherung der Anlage) oder 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 festgelegt wird) eine Ausgleichszahlung. Tritt das Kreditereignis nicht ein, zahlt der Sicherungsnehmer alle erforderlichen Prämien und das Swappgeschäft 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-Spreads, 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.

Zum 30. September 2022 waren die folgenden Teilfonds in Credit Default Index-Kontrakten auf Finanzindizes engagiert:

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten %	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 38 20/12/2027	J.P. Morgan	EUR	10.000.000	5,00	20. Dez. 2027	504.426
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 38 20/12/2027	J.P. Morgan	EUR	42.000.000	1,00	20. Dez. 2027	636.426
Verkauf	CDX North America High Yield Series 39 20/12/2027	J.P. Morgan	USD	7.000.000	5,00	20. Dez. 2027	276.581
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 39 20/12/2027	J.P. Morgan	USD	24.000.000	1,00	20. Dez. 2027	72.480
						USD	1.489.913
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 38 20/12/2027	Citi Bank	EUR	10.000.000	5,00	20. Dez. 2027	(196.908)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 38 20/12/2027	Citi Bank	EUR	10.000.000	1,00	20. Dez. 2027	75.184
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 38 20/12/2027	Citi Bank	EUR	74.000.000	1,00	20. Dez. 2027	460.221
Verkauf	CDX North America High Yield Series 39 20/12/2027	Citi Bank	USD	20.000.000	5,00	20. Dez. 2027	44.214

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Credit Default Index Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten %	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 39 20/12/2027	Citi Bank	USD	30.000.000	1,00	20. Dez. 2027	153.396
							USD
							536.107
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	CDX Emerging Markets Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	USD	9.882.000	1,00	20. Dez. 2027	21.522
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	2.380.000	5,00	20. Dez. 2027	22.736
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 37 20/06/2027	Morgan Stanley	EUR	10.380.000	1,00	20. Juni 2027	150.842
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	1.000.000	1,00	20. Dez. 2027	7.226
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	EUR	4.405.000	1,00	20. Dez. 2026	(26.448)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	23.360.000	1,00	20. Dez. 2027	33.750
Verkauf	CDX iTraxx Europe Subordinated Financial Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	3.970.000	1,00	20. Dez. 2027	45.888
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 39 20/12/2027	Morgan Stanley	USD	6.445.000	1,00	20. Dez. 2027	(6.821)
							USD
							248.695

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 erwerben (Absicherung der Anlage) oder 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-Spreads, der zum Schlusstermin 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 2022 war der folgende Teilfonds in Credit-Default-Swap-Kontrakten engagiert:

Schutz- position	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	Österreich	Telekommunikation	Morgan Stanley	EUR	5.530.000	20. Dez. 2027	44.713
Verkauf	Belgien	Chemie	Morgan Stanley	EUR	1.280.000	20. Dez. 2027	5.473
Verkauf	China	Banken	Goldman Sachs	USD	2.255.000	20. Juni 2027	(9.822)
Verkauf	China	Banken	Morgan Stanley	USD	6.717.428	20. Juni 2027	74.715
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	8.927.382	20. Juni 2027	(105.219)
Verkauf	Dänemark	Getränke	Morgan Stanley	EUR	1.270.000	20. Dez. 2027	3.191
Verkauf	Finnland	Forstprodukte und Papier	Morgan Stanley	EUR	4.090.000	20. Dez. 2027	62.145
Verkauf	Frankreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1.210.000	20. Dez. 2027	11.478
Verkauf	Frankreich	Bekleidung	Morgan Stanley	EUR	3.715.000	20. Dez. 2027	19.832
Verkauf	Frankreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	710.000	20. Juni 2027	18.854
Verkauf	Frankreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	700.000	20. Dez. 2027	25.444
Kauf	Frankreich	Banken	Barclays Bank	EUR	2.173.750	20. Dez. 2026	75.932
Verkauf	Frankreich	Banken	Morgan Stanley	EUR	114.500	20. Dez. 2026	2.164
Verkauf	Frankreich	Baustoffe	Morgan Stanley	EUR	3.040.000	20. Juni 2027	43.445
Verkauf	Frankreich	Elektrik	Morgan Stanley	EUR	2.110.000	20. Juni 2027	8.384
Verkauf	Frankreich	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	2.160.000	20. Juni 2027	35.716
Verkauf	Frankreich	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	1.430.000	20. Dez. 2027	12.675

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Credit Default Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf	Frankreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	2.375.000	20. Dez. 2027	7.863
Verkauf	Frankreich	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	EUR	1.685.000	20. Dez. 2027	6.907
Verkauf	Frankreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	3.550.000	20. Dez. 2027	21.606
Verkauf	Frankreich	REITS	Morgan Stanley	EUR	2.760.000	20. Dez. 2027	45.225
Verkauf	Frankreich	Telekommunikation	Morgan Stanley	EUR	350.000	20. Juni 2027	(2.995)
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Barclays Bank	EUR	1.440.000	20. Juni 2027	(14.350)
Kauf	Deutschland	Automobilhersteller	Barclays Bank	EUR	1.765.000	20. Dez. 2027	18.629
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	4.851.000	20. Juni 2027	131.017
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1.795.000	20. Dez. 2027	11.160
Verkauf	Deutschland	Banken	Morgan Stanley	EUR	1.420.000	20. Dez. 2027	7.471
Verkauf	Deutschland	Chemie	Morgan Stanley	EUR	1.825.000	20. Juni 2027	116.449
Verkauf	Deutschland	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	EUR	895.000	20. Dez. 2027	2.230
Verkauf	Deutschland	Medien	Morgan Stanley	EUR	3.210.000	20. Dez. 2027	27.389
Kauf	Italien	Banken	BNP Paribas	EUR	1.385.000	20. Dez. 2027	5.038
Verkauf	Luxemburg	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	EUR	850.000	20. Juni 2027	87.407
Verkauf	Niederlande	Chemie	Morgan Stanley	EUR	2.715.000	20. Dez. 2027	9.036
Verkauf	Niederlande	Medien	Morgan Stanley	EUR	1.050.000	20. Juni 2027	(8.025)
Verkauf	Niederlande	Transport	Morgan Stanley	EUR	1.280.000	20. Dez. 2027	3.966
Verkauf	Südkorea	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2.855.000	20. Dez. 2024	58.597
Verkauf	Schweiz	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	1.930.000	20. Juni 2027	33.699
Verkauf	Schweiz	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	700.000	20. Dez. 2027	4.439
Verkauf	Vereinigte Arabische Emirate	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2.655.000	20. Dez. 2027	7.009
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1.355.000	20. Dez. 2027	13.991
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	410.000	20. Dez. 2025	50.905
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	805.000	20. Juni 2027	72.571
Kauf	Vereinigtes Königreich	Banken	Goldman Sachs	EUR	3.765.000	20. Dez. 2027	14.615
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Banken	Morgan Stanley	EUR	2.110.000	20. Dez. 2027	24.235
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	5.520.000	20. Dez. 2027	22.749
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	4.095.000	20. Dez. 2027	26.925
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Unterhaltung	Morgan Stanley	EUR	205.000	20. Dez. 2026	(10.568)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Unterhaltung	Morgan Stanley	EUR	460.000	20. Juni 2027	(12.262)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Unterhaltung	Morgan Stanley	EUR	130.000	20. Dez. 2027	(2.084)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	475.000	20. Dez. 2024	(81.724)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	255.000	20. Dez. 2026	(62.097)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmitteldienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	1.895.000	20. Dez. 2027	7.675
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	590.000	20. Dez. 2026	3.053
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	2.610.000	20. Juni 2027	93.031
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	2.980.000	20. Dez. 2027	78.327
Verkauf	Vereinigte Staaten	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1.935.000	20. Dez. 2027	42.981
Kauf	Vereinigte Staaten	Banken	Barclays Bank	USD	2.910.000	20. Juni 2027	8.971
Kauf	Vereinigte Staaten	Banken	J.P. Morgan	USD	940.000	20. Juni 2027	7.792
Verkauf	Vereinigte Staaten	Banken	Morgan Stanley	USD	2.920.000	20. Juni 2027	16.304
Kauf	Vereinigte Staaten	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	500.000	20. Dez. 2024	35.867
Verkauf	Vereinigte Staaten	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	910.000	20. Juni 2025	(35.017)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	3.595.000	20. Dez. 2027	20.380
Kauf	Vereinigte Staaten	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	USD	1.035.000	20. Dez. 2027	10.732
Verkauf	Vereinigte Staaten	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	1.035.000	20. Dez. 2027	(11.417)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Medien	Morgan Stanley	USD	1.155.000	20. Dez. 2024	160.625
Kauf	Vereinigte Staaten	Immobilien	J.P. Morgan	USD	705.000	20. Juni 2024	17.878

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Credit Default Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf	Vereinigte Staaten	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	630.000	20. Dez. 2027	(269)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	960.000	20. Dez. 2027	(410)
USD							1.422.646

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 2022 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)
Schroder GAIA Wellington Pagosa								
BNP Paribas	CNH	12.436.000	USD	1.807.295	15. März 2025	2,96 %	USD SOFR 1 Tag	2.594
HSBC	CNH	773.000	USD	110.492	15. März 2025	2,96 %	USD SOFR 1 Tag	161
Morgan Stanley	USD	26.174.214	AUD	35.860.000	15. März 2028	USD SOFR 1 Tag	AUD BBR 3 Monate	(6.901)
Morgan Stanley	USD	25.181.581	CAD	31.827.000	15. März 2028	USD SOFR 1 Tag	CAD BA 3 Monate	8.349
Morgan Stanley	USD	23.684.003	GBP	18.883.000	21. Dez. 2027	USD SOFR 1 Tag	GBP SONIA 1 Tag	105.301
Morgan Stanley	USD	27.410.471	NOK	242.558.000	15. März 2028	USD SOFR 1 Tag	NOK NIBOR 3 Monate	(66.718)
Morgan Stanley	USD	27.152.378	NZD	39.977.000	15. März 2028	USD SOFR 1 Tag	NZD BBR 3 Monate	(7.278)
Morgan Stanley	USD	26.799.244	SEK	259.414.000	15. März 2028	USD SOFR 1 Tag	SEK STIBOR 3 Monate	(41.476)
USD								(5.968)

Inflations-Swapkontrakte

Ein Inflations-Swap ermöglicht die Übertragung des Inflationsrisikos. 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 Berechnungstag des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Inflations-Swapkontrakten“ aufgeführt.

Zum 30. September 2022 war der folgende Teilfonds in Swaps auf Inflationsraten engagiert:

Nennbetrag	Währung	Kontrahent	Wertpapierbeschreibung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
4.804.000	EUR	Goldman Sachs	Zahlt Festzinssatz 2,78 %, Erhält variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Juli 2027	10.781
1.832.000	EUR	Goldman Sachs	Zahlt Festzinssatz 3,45 %, Erhält variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. März 2027	3.659
1.835.000	EUR	Goldman Sachs	Zahlt Festzinssatz 3,53 %, Erhält variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. März 2027	(3.554)
4.088.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 3,00 %, Erhält variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Juli 2027	(34.944)
3.235.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 3,28 %, Erhält variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. März 2027	33.835
USD					9.777

Zins-Swapkontrakte

Zur Absicherung gegen Zinsschwankungen kann die Gesellschaft Zins-Swap-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.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Zins-Swaps 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 Schlusstermin in die Währung des Fonds umgerechnet wird. Das Ergebnis dieser Neubewertungen ist zusammen mit allen ausstehenden/zahlbaren Zinsen in Verbindung mit den Zins-Swaps in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(- wertverlust) aus Zins-Swapkontrakte“ aufgeführt.

Zum 30. September 2022 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Zinssätze engagiert:

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Zahlt Festzinssatz 12,44 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	47.523.796	BRL	2. Jan. 2024	10.427
Zahlt Festzinssatz 10,62 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	32.476.204	BRL	2. Jan. 2024	105.531
Erhält Festzinssatz 4,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	5.000.000	USD	21. Dez. 2024	18.849
Erhält Festzinssatz 3,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	1.000.000	USD	21. Dez. 2042	9.118
Erhält Festzinssatz 3,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	1.000.000	USD	21. Dez. 2047	9.767
Erhält Festzinssatz 2,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	2.000.000	CHF	21. Dez. 2027	27.695
Erhält Festzinssatz 3,96 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	3.000.000	USD	21. Dez. 2026	14.743
Erhält Festzinssatz 3,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	2.000.000	USD	21. Dez. 2029	12.143
Zahlt Festzinssatz 0,78 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	900.000.000	JPY	21. Dez. 2042	184.659
Zahlt Festzinssatz 0,78 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	800.000.000	JPY	21. Dez. 2042	164.142
Zahlt Festzinssatz 0,95 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	4.000.000	CHF	21. Dez. 2027	159.613
Zahlt Festzinssatz 0,95 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	8.000.000	CHF	21. Dez. 2027	319.227
Zahlt Festzinssatz 1,24 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	4.000.000	CHF	21. Dez. 2032	322.620
Zahlt Festzinssatz 1,24 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	2.000.000	CHF	21. Dez. 2032	161.310
Zahlt Festzinssatz 2,34 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	12.263.788	USD	21. Dez. 2029	975.736
Zahlt Festzinssatz 2,35 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	20.364.366	USD	21. Dez. 2026	1.134.920
Zahlt Festzinssatz 2,46 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	33.718.921	USD	21. Dez. 2024	1.116.587
Zahlt Festzinssatz 2,50 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	1.500.000	USD	21. Dez. 2047	165.805
Zahlt Festzinssatz 2,50 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	4.000.000	USD	21. Dez. 2047	442.146
Zahlt Festzinssatz 2,68 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	7.000.000	USD	21. Dez. 2042	645.207
Zahlt Festzinssatz 11,72 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	2.220.718	BRL	02. Jan. 2025	(2.800)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 3,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	1.000.000	USD	21. Dez. 2042	5.734
Erhält Festzinssatz 3,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	2.000.000	USD	21. Dez. 2029	4.780
Erhält Festzinssatz 3,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	263.788	USD	21. Dez. 2029	2.008
Erhält Festzinssatz 3,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	3.000.000	USD	21. Dez. 2026	4.453
Erhält Festzinssatz 4,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	2.364.366	USD	21. Dez. 2026	16.821
Erhält Festzinssatz 4,44 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	3.718.921	USD	21. Dez. 2024	21.238
Erhält Festzinssatz 10,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	2.220.718	BRL	02. Jan. 2025	(4.127)
Zahlt Festzinssatz 3,98 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	2.000.000	NZD	21. Dez. 2032	48.446
Zahlt Festzinssatz 4,23 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	2.000.000	NZD	21. Dez. 2032	26.799
Erhält Festzinssatz 3,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	50.000.000	SEK	21. Dez. 2024	15.760
Erhält Festzinssatz 8,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	100.000.000	ZAR	21. Dez. 2024	16.835
Zahlt Festzinssatz 1,27 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	16.193.851	EUR	21. Dez. 2024	515.005
Zahlt Festzinssatz 2,87 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	50.000.000	SEK	21. Dez. 2032	121.051
Erhält Festzinssatz 3,44 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	6.193.851	EUR	21. Dez. 2024	56.367
Zahlt Festzinssatz 2,55 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	100.000.000	SEK	21. Dez. 2024	156.660
Zahlt Festzinssatz 2,55 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	50.000.000	SEK	21. Dez. 2024	78.330
Zahlt Festzinssatz 7,36 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	400.000.000	ZAR	21. Dez. 2024	411.685
Zahlt Festzinssatz 8,39 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	50.000.000	ZAR	21. Dez. 2027	63.432
Zahlt Festzinssatz 8,39 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	100.000.000	ZAR	21. Dez. 2027	126.865
Zahlt Festzinssatz 2,64 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	80.000.000	SEK	21. Dez. 2027	233.645
Zahlt Festzinssatz 9,49 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	394.235.953	MXN	18. Dez. 2024	189.015
Erhält Festzinssatz 8,08 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	21.220.930	MXN	08. Dez. 2032	(73.389)
Erhält Festzinssatz 7,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	85.425.776	MXN	15. Dez. 2027	(210.466)
Erhält Festzinssatz 8,52 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	194.235.953	MXN	18. Dez. 2024	(258.337)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 8,94 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	J.P. Morgan	185.425.776	MXN	15. Dez. 2027	112.988
Erhält Festzinssatz 3,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	5.000.000	EUR	21. Dez. 2024	22.677
Erhält Festzinssatz 8,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	100.000.000	ZAR	21. Dez. 2024	(686)
Erhält Festzinssatz 8,96 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	50.000.000	ZAR	21. Dez. 2027	(513)
				USD	7.700.521
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Zahlt Festzinssatz 6,79 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	BNP Paribas	2.591.114.000	COP	20. Dez. 2026	39.045
Erhält Festzinssatz 1,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10.789.000	USD	20. März 2027	(249.446)
Erhält Festzinssatz 1,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10.320.000	USD	20. März 2026	(438.411)
Zahlt Festzinssatz 1,45 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.185.000	USD	20. März 2034	336.387
Erhält Festzinssatz 1,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10.370.000	USD	20. März 2026	(440.251)
Zahlt Festzinssatz 1,46 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.190.000	USD	20. März 2034	335.838
Erhält Festzinssatz 1,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10.300.000	USD	20. März 2026	(429.009)
Zahlt Festzinssatz 1,48 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.180.000	USD	20. März 2034	331.648
Zahlt Festzinssatz 1,47 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.177.000	USD	20. März 2034	331.746
Erhält Festzinssatz 1,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10.299.000	USD	20. März 2026	(432.159)
Zahlt Festzinssatz 1,49 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	440.000	USD	20. März 2034	66.485
Erhält Festzinssatz 1,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6.240.000	USD	20. März 2026	(262.465)
Erhält Festzinssatz 1,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.080.000	USD	20. März 2026	(87.412)
Zahlt Festzinssatz 1,48 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.320.000	USD	20. März 2034	200.196
Erhält Festzinssatz 1,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10.400.000	USD	20. März 2026	(442.569)
Zahlt Festzinssatz 1,47 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.200.000	USD	20. März 2034	335.428
Zahlt Festzinssatz 1,45 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.200.000	USD	20. März 2034	339.974
Erhält Festzinssatz 1,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10.400.000	USD	20. März 2026	(455.329)
Erhält Festzinssatz 1,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	12.476.000	USD	20. März 2026	(552.198)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 1,41 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.642.000	USD	20. März 2034	416.713
Erhält Festzinssatz 5,62 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	265.567.000	CLP	17. März 2032	(276)
Zahlt Festzinssatz 1,73 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.110.000	USD	20. März 2034	277.838
Erhält Festzinssatz 1,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	9.835.000	USD	20. März 2026	(367.011)
Zahlt Festzinssatz 1,77 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	485.000	USD	20. März 2034	62.470
Erhält Festzinssatz 1,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.100.000	USD	20. März 2026	(76.533)
Zahlt Festzinssatz 6,16 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	186.645.000	INR	19. Juni 2027	37.820
Zahlt Festzinssatz 6,25 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Bank of America	57.301.200	INR	19. Juni 2027	9.531
Zahlt Festzinssatz 1,63 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.745.000	USD	6. Feb. 2028	117.190
Erhält Festzinssatz 0,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	1.581.000	GBP	16. Juni 2032	(91.259)
Zahlt Festzinssatz 1,65 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.550.000	USD	04. März 2034	354.495
Erhält Festzinssatz 1,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	11.960.000	USD	04. März 2026	(485.537)
Zahlt Festzinssatz 1,66 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.860.000	USD	04. März 2034	395.399
Erhält Festzinssatz 1,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	13.395.000	USD	04. März 2026	(537.416)
Erhält Festzinssatz 1,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6.697.740	USD	04. März 2026	(268.263)
Zahlt Festzinssatz 1,66 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.428.070	USD	04. März 2034	196.568
Erhält Festzinssatz 1,52 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	15.787.200	USD	04. März 2026	(628.912)
Zahlt Festzinssatz 1,66 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3.365.000	USD	04. März 2034	463.046
Zahlt Festzinssatz 7,58 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Goldman Sachs	378.716.000	INR	18. Sept. 2027	(83.742)
Zahlt Festzinssatz 7,52 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Bank of America	253.612.000	INR	18. Sept. 2027	(51.458)
Zahlt Festzinssatz 2,74 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3.315.000	USD	18. Mai 2033	196.902
Zahlt Festzinssatz 2,74 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3.315.000	USD	18. Mai 2033	197.477
Erhält Festzinssatz 2,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	14.885.000	USD	18. Mai 2025	(353.870)
Erhält Festzinssatz 2,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	14.885.000	USD	18. Mai 2025	(354.577)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 5,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.411.000	PLN	15. Sept. 2032	(6.707)
Erhält Festzinssatz 2,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	62.645.000	USD	20. März 2026	(1.119.491)
Zahlt Festzinssatz 2,75 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	9.076.000	USD	20. März 2034	445.360
Zahlt Festzinssatz 2,75 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	7.425.000	USD	20. März 2034	367.970
Zahlt Festzinssatz 2,60 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6.632.000	USD	18. Mai 2033	472.203
Erhält Festzinssatz 2,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	29.764.000	USD	18. Mai 2025	(722.131)
Erhält Festzinssatz 8,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	38.250.000	MXN	25. Apr. 2042	(93.700)
Erhält Festzinssatz 2,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	9.660.000	SGD	18. Sept. 2027	(112.614)
Zahlt Festzinssatz 3,04 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	28.958.000	ILS	21. Dez. 2024	119.558
Erhält Festzinssatz 8,96 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	9.402.752.000	COP	15. Dez. 2032	(22.636)
Erhält Festzinssatz 7,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	117.339.000	INR	21. Dez. 2027	38.991
Erhält Festzinssatz 2,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	5.912.000	USD	15. Dez. 2032	(77.322)
Zahlt Festzinssatz 3,08 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2.465.000	SGD	21. Dez. 2027	29.140
Zahlt Festzinssatz 3,11 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2.467.000	SGD	21. Dez. 2027	26.603
Erhält Festzinssatz 2,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	9.014.000	GBP	21. Dez. 2027	(1.027.724)
Erhält Festzinssatz 2,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	2.549.000	GBP	20. Dez. 2024	(58.123)
Erhält Festzinssatz 3,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	9.646.000	CAD	21. Dez. 2032	125.038
Zahlt Festzinssatz 0,63 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	78.928.000	JPY	15. Dez. 2032	(3.300)
Zahlt Festzinssatz 0,53 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	159.370.000	JPY	17. Juni 2032	(4.282)
Zahlt Festzinssatz 0,28 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	633.915.000	JPY	17. Juni 2027	(10.684)
Erhält Festzinssatz 2,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	39.599.000	GBP	21. Dez. 2024	(178.439)
Erhält Festzinssatz 12,55 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	5.628.755	BRL	1. Feb. 2025	21.732
Erhält Festzinssatz 2,95 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	8.755.000	ILS	21. Dez. 2027	(75.738)
Zahlt Festzinssatz 2,85 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	3.053.000	SGD	21. Dez. 2027	58.804

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 2,80 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	8.346.000	SGD	20. Dez. 2024	46.278
Erhält Festzinssatz 9,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29.400.000	MXN	17. Juni 2032	(17.729)
Erhält Festzinssatz 3,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	3.938.821.000	KRW	21. Dez. 2027	(88.396)
Erhält Festzinssatz 2,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Standard Chartered Bank	4.339.000	CNY	21. Dez. 2024	2.920
Zahlt Festzinssatz 3,13 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	3.527.632.000	KRW	21. Dez. 2032	139.468
Erhält Festzinssatz 3,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	8.551.473.000	KRW	21. Dez. 2027	(231.832)
Zahlt Festzinssatz 9,05 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	50.730.000	MXN	13. Juli 2027	24.126
Erhält Festzinssatz 8,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	62.737.000	MXN	18. Dez. 2024	(85.554)
Zahlt Festzinssatz 8,22 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	34.117.500	MXN	28. Juli 2027	70.305
Erhält Festzinssatz 6,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	24.152.000	PLN	21. Dez. 2024	(102.143)
Erhält Festzinssatz 8,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	80.430.000	MXN	18. Dez. 2024	(89.037)
Zahlt Festzinssatz 8,13 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	34.117.500	MXN	30. Juli 2027	76.259
Erhält Festzinssatz 12,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	7.111.934	BRL	02. Jan. 2025	10.302
Erhält Festzinssatz 11,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	5.281.640	BRL	4. Jan. 2027	14.992
Erhält Festzinssatz 11,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	BNP Paribas	4.758.179	BRL	02. Jan. 2025	5.207
Erhält Festzinssatz 11,92 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	12.706.584	BRL	02. Jan. 2025	11.058
Erhält Festzinssatz 11,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	12.715.349	BRL	02. Jan. 2025	9.165
Erhält Festzinssatz 8,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	103.955.000	MXN	8. Aug. 2025	(155.799)
Erhält Festzinssatz 11,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Barclays Bank	6.524.367	BRL	2. Jan. 2029	2.965
Erhält Festzinssatz 2,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.830.000	ILS	21. Dez. 2027	(52.396)
Erhält Festzinssatz 6,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7.011.000	PLN	21. Dez. 2027	(46.406)
Erhält Festzinssatz 12,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Goldman Sachs	12.459.473	BRL	02. Jan. 2025	18.239
Zahlt Festzinssatz 3,71 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	6.528.383.000	KRW	21. Dez. 2024	58.189
Erhält Festzinssatz 3,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	10.870.000	ILS	21. Dez. 2027	(78.427)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 8,64 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	38.158.000	MXN	15. Dez. 2027	45.298
Zahlt Festzinssatz 10,28 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	9.851.431.000	COP	21. Dez. 2024	23.814
Zahlt Festzinssatz 10,35 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.216.652.000	COP	21. Dez. 2024	4.741
Zahlt Festzinssatz 10,63 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6.843.801.000	COP	21. Dez. 2024	7.537
Zahlt Festzinssatz 3,17 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	5.572.000	SGD	21. Dez. 2024	51.281
Zahlt Festzinssatz 9,77 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	4.406.237.000	COP	21. Dez. 2027	16.022
Zahlt Festzinssatz 2,38 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.400.000	EUR	21. Dez. 2027	121.964
Zahlt Festzinssatz 3,02 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	837.000	SGD	15. März 2028	18.819
Erhält Festzinssatz 2,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	10.919.000	SGD	15. März 2033	(407.313)
Zahlt Festzinssatz 3,17 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	26.454.000	SGD	21. Sept. 2025	308.927
Zahlt Festzinssatz 5,78 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	50.952.000	PLN	20. März 2025	91.333
Erhält Festzinssatz 7,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	990.523.000	HUF	15. Dez. 2032	(35.105)
Zahlt Festzinssatz 3,16 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	10.477.000	GBP	15. März 2033	1.087.616
Zahlt Festzinssatz 3,16 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	5.173.000	USD	20. März 2025	33.259
Zahlt Festzinssatz 3,81 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	15.102.000	USD	15. März 2024	81.587
Zahlt Festzinssatz 3,16 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	40.650.000	USD	15. März 2028	1.097.389
Erhält Festzinssatz 3,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	1.409.000	CAD	19. März 2028	63.000
Erhält Festzinssatz 6,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.177.170.000	CLP	21. Dez. 2032	(24.031)
Erhält Festzinssatz 11,23 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	8.759.217	BRL	4. Jan. 2027	(21.946)
Erhält Festzinssatz 13,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	309.595.000	HUF	21. Dez. 2024	6.165
Erhält Festzinssatz 3,09 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	7.498.000	USD	15. März 2033	(172.161)
Erhält Festzinssatz 3,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	34.292.000	USD	15. März 2025	(250.098)
Erhält Festzinssatz 4,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	24.025.000	AUD	15. März 2033	(241.191)
Erhält Festzinssatz 3,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	43.242.000	NOK	15. März 2033	(10.453)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 7,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	293.636.000	HUF	15. Dez. 2032	(15.570)
Zahlt Festzinssatz 2,54 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	11.410.000	CNY	15. März 2028	9.877
Erhält Festzinssatz 3,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.082.000	CLP	18. März 2031	(64)
Erhält Festzinssatz 3,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	6.005.000	CLP	18. März 2031	(374)
Erhält Festzinssatz 7,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	11.240.000	MXN	16. Mai 2041	(96.637)
Erhält Festzinssatz 7,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	11.400.000	MXN	05. Juli 2041	(94.191)
Erhält Festzinssatz 2,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	1.303.000	CAD	17. März 2032	(30.501)
Erhält Festzinssatz 2,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	HSBC	12.007.000	CNY	20. März 2027	834
Zahlt Festzinssatz 4,54 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.849.984.000	HUF	15. März 2024	478.737
Zahlt Festzinssatz 4,35 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.018.668.000	HUF	15. März 2024	174.952
Zahlt Festzinssatz 4,48 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.471.536.000	HUF	15. März 2024	248.892
Zahlt Festzinssatz 1,96 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	4.238.234.000	KRW	21. Juni 2024	69.168
Erhält Festzinssatz 5,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	550.861.000	CLP	16. Juni 2032	(1.629)
Erhält Festzinssatz 5,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	550.866.000	CLP	17. März 2032	(985)
Zahlt Festzinssatz 1,36 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	13.095.000	ILS	19. Juni 2027	208.637
Erhält Festzinssatz 2,89 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	32.702.000	CZK	16. Juni 2032	(80.758)
Zahlt Festzinssatz 4,28 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	28.786.000	PLN	21. Juni 2024	168.038
Erhält Festzinssatz 3,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	28.555.000	CZK	16. Juni 2032	(64.471)
Zahlt Festzinssatz 3,60 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	2.898.000	MYR	19. Juni 2027	10.064
Erhält Festzinssatz 2,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	24.474.000	NZD	16. März 2032	(855.586)
Zahlt Festzinssatz 9,05 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16.655.000	ZAR	17. Juni 2032	44.883
Zahlt Festzinssatz 4,16 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.720.000	PLN	18. Sept. 2027	61.602
Erhält Festzinssatz 2,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	9.385.000	ILS	15. Sept. 2032	(143.379)
Erhält Festzinssatz 5,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.206.227.000	CLP	15. Sept. 2032	(15.825)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 2,75 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	8.221.000	AUD	18. Sept. 2027	76.474
Zahlt Festzinssatz 5,30 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	38.924.000	PLN	21. Juni 2024	158.320
Zahlt Festzinssatz 8,33 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	10.028.000	MXN	9. Juni 2032	8.698
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18.257.000	MXN	9. Juni 2032	16.137
Zahlt Festzinssatz 8,33 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27.621.000	MXN	9. Juni 2032	23.888
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27.469.000	MXN	9. Juni 2032	24.153
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18.353.000	MXN	9. Juni 2032	16.181
Zahlt Festzinssatz 8,28 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27.374.000	MXN	9. Juni 2032	25.308
Zahlt Festzinssatz 8,23 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	36.569.000	MXN	9. Juni 2032	36.131
Zahlt Festzinssatz 8,29 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27.417.000	MXN	9. Juni 2032	25.262
Zahlt Festzinssatz 8,28 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18.270.000	MXN	9. Juni 2032	16.886
Zahlt Festzinssatz 8,28 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27.475.000	MXN	9. Juni 2032	25.657
Zahlt Festzinssatz 8,25 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18.286.000	MXN	9. Juni 2032	17.644
Zahlt Festzinssatz 8,20 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18.286.000	MXN	9. Juni 2032	18.853
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19.666.000	MXN	8. Sept. 2032	17.381
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19.708.000	MXN	8. Sept. 2032	17.418
Zahlt Festzinssatz 8,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29.921.000	MXN	8. Sept. 2032	21.841
Zahlt Festzinssatz 8,47 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29.778.000	MXN	8. Sept. 2032	20.907
Zahlt Festzinssatz 8,11 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	60.639.000	MXN	8. Sept. 2032	68.728
Zahlt Festzinssatz 8,79 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	195.604.000	MXN	18. Sept. 2024	76.032
Erhält Festzinssatz 6,01 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	871.469.000	CLP	15. Sept. 2032	7.331
Erhält Festzinssatz 5,99 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.248.262.000	CLP	16. Juni 2032	11.727
Erhält Festzinssatz 6,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	885.334.000	CLP	16. Juni 2032	9.222
Zahlt Festzinssatz 9,53 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	46.838.000	ZAR	15. Sept. 2032	96.130

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 9,63 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32.804.000	ZAR	15. Sept. 2032	62.636
Zahlt Festzinssatz 9,61 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	3.555.000	ZAR	15. Sept. 2032	6.874
Erhält Festzinssatz 3,62 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	43.933.000	CZK	15. Sept. 2032	(59.387)
Zahlt Festzinssatz 9,76 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	17.495.000	ZAR	15. Sept. 2032	30.308
Zahlt Festzinssatz 8,65 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	104.871.000	MXN	9. Juni 2032	49.645
Zahlt Festzinssatz 8,52 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	35.149.500	MXN	8. Sept. 2032	22.489
Zahlt Festzinssatz 8,52 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	46.924.500	MXN	8. Sept. 2032	30.386
Zahlt Festzinssatz 9,97 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	41.861.000	ZAR	15. Sept. 2032	60.316
Zahlt Festzinssatz 8,58 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	45.850.500	MXN	8. Sept. 2032	26.330
Zahlt Festzinssatz 8,82 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29.081.000	MXN	8. Sept. 2032	7.969
Erhält Festzinssatz 3,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	9.821.000	ILS	15. Sept. 2032	(57.718)
Erhält Festzinssatz 9,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	9.351.169.000	COP	15. Sept. 2032	(18.044)
Erhält Festzinssatz 2,61 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Citi Bank	15.750.000	CNY	18. Sept. 2027	(13.131)
Erhält Festzinssatz 5,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.173.000	PLN	15. Sept. 2032	(10.304)
Erhält Festzinssatz 5,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.600.000	PLN	15. Sept. 2032	(29.186)
Erhält Festzinssatz 2,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Citi Bank	26.082.000	CNY	18. Sept. 2027	(33.238)
Erhält Festzinssatz 2,52 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Citi Bank	36.629.000	CNY	18. Sept. 2027	(43.281)
Zahlt Festzinssatz 2,13 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.313.000	EUR	21. Dez. 2032	189.684
Erhält Festzinssatz 2,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.497.000	EUR	18. Dez. 2027	(25.131)
Zahlt Festzinssatz 3,59 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	39.837.000	CAD	21. Dez. 2027	(364.428)
Zahlt Festzinssatz 3,72 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	49.798.000	CAD	21. Dez. 2024	43.885
Erhält Festzinssatz 9,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	21.865.000	MXN	4. Juni 2025	(13.401)
Erhält Festzinssatz 9,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	141.985.000	MXN	4. Juni 2025	(92.021)
Zahlt Festzinssatz 6,43 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	6.223.573.000	CLP	20. Dez. 2024	98.893

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 5,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.159.043.000	CLP	15. Dez. 2032	242
Erhält Festzinssatz 5,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.338.964.000	CLP	15. Dez. 2032	4.190
Erhält Festzinssatz 1,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.624.000	EUR	21. Dez. 2027	(88.439)
Erhält Festzinssatz 2,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.203.000	EUR	15. Dez. 2032	(312.569)
Zahlt Festzinssatz 5,40 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	53.539.000	CZK	21. Dez. 2027	(485)
Erhält Festzinssatz 5,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.469.000	CZK	21. Dez. 2032	5.578
Zahlt Festzinssatz 9,03 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	16.725.734.000	COP	21. Dez. 2027	162.685
Zahlt Festzinssatz 3,93 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	41.452.000	MYR	21. Dez. 2024	(11.392)
Erhält Festzinssatz 4,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	25.927.000	MYR	21. Dez. 2027	10.398
Zahlt Festzinssatz 6,76 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	31.529.000	PLN	21. Dez. 2032	44.753
Erhält Festzinssatz 9,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	157.644.000	MXN	20. Dez. 2023	(65.952)
Erhält Festzinssatz 9,52 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	242.814.000	MXN	18. Dez. 2024	(108.864)
Erhält Festzinssatz 3,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.673.000	ILS	21. Dez. 2032	(30.128)
Erhält Festzinssatz 3,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.470.000	ILS	21. Dez. 2032	(37.241)
Zahlt Festzinssatz 3,84 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	21.459.000	AUD	21. Dez. 2024	38.980
Zahlt Festzinssatz 4,22 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	23.576.000	AUD	15. Dez. 2032	29.662
Zahlt Festzinssatz 2,91 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	160.101.000	SEK	18. Dez. 2027	398.920
Erhält Festzinssatz 2,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	314.154.000	SEK	21. Dez. 2027	(339.736)
Zahlt Festzinssatz 2,88 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	76.079.000	SEK	15. Dez. 2032	(4.333)
Zahlt Festzinssatz 3,22 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	132.207.000	NOK	18. Dez. 2027	52.957
Erhält Festzinssatz 3,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	20.575.000	NOK	15. Dez. 2032	(20.027)
Erhält Festzinssatz 3,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	14.723.000	ILS	21. Dez. 2027	(112.476)
Erhält Festzinssatz 7,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.024.275.000	HUF	21. Dez. 2032	(277.272)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Wahrung	Falligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 9,66 %					
Erhalt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.527.416.000	HUF	21. Dez. 2023	213.061
Zahlt Festzinssatz 9,30 %					
Erhalt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.512.110.000	HUF	21. Dez. 2024	194.652
Zahlt Festzinssatz 9,27 %					
Erhalt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.867.726.000	HUF	21. Dez. 2024	372.405
Zahlt Festzinssatz 8,11 %					
Erhalt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.335.126.000	HUF	21. Dez. 2027	469.476
Zahlt Festzinssatz 7,14 %					
Erhalt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	146.974.000	ZAR	21. Dez. 2023	62.533
Erhalt Festzinssatz 9,10 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	50.278.000	ZAR	21. Dez. 2032	(119.071)
Erhalt Festzinssatz 7,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.638.000	PLN	21. Dez. 2027	24.931
Zahlt Festzinssatz 4,50 %					
Erhalt variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.225.000	AUD	20. Dez. 2024	(9.514)
Erhalt Festzinssatz 7,61 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.333.000	PLN	21. Dez. 2027	20.749
Zahlt Festzinssatz 0,30 %					
Erhalt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	633.920.000	JPY	17. Juni 2027	(15.094)
Zahlt Festzinssatz 0,55 %					
Erhalt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	159.370.000	JPY	17. Juni 2032	(6.383)
Zahlt Festzinssatz 10,42 %					
Erhalt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.199.216.000	HUF	21. Dez. 2023	83.105
Erhalt Festzinssatz 9,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	155.190.000	MXN	17. Sept. 2025	2.069
Zahlt Festzinssatz 10,27 %					
Erhalt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	42.554.000	ZAR	15. Sept. 2032	43.267
Erhalt Festzinssatz 6,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14.187.000	PLN	15. Sept. 2032	3.793
Erhalt Festzinssatz 6,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.100.000	PLN	15. Sept. 2032	1.614
Zahlt Festzinssatz 8,92 %					
Erhalt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	64.660.000	MXN	21. Juni 2027	46.571
Erhalt Festzinssatz 3,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	15.638.000	CAD	21. Dez. 2023	(74.436)
Erhalt Festzinssatz 9,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	111.050.000	MXN	25. Juni 2025	(49.946)
Zahlt Festzinssatz 9,10 %					
Erhalt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	96.450.000	MXN	24. Juni 2027	36.427
Erhalt Festzinssatz 6,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	17.792.000	PLN	15. Dez. 2032	(50.584)
Erhalt Festzinssatz 3,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	13.166.000	MYR	21. Dez. 2027	(44.095)
Erhalt Festzinssatz 9,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	27.774.000	ZAR	21. Dez. 2032	(38.144)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 9,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	62.629.000	ZAR	21. Dez. 2032	(88.907)
Zahlt Festzinssatz 8,62 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	103.042.000	ZAR	21. Dez. 2027	78.403
Zahlt Festzinssatz 8,63 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	45.219.000	ZAR	21. Dez. 2027	33.809
Zahlt Festzinssatz 9,29 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	8.380.053.000	COP	21. Dez. 2027	63.875
Zahlt Festzinssatz 9,19 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.868.341.000	COP	21. Dez. 2027	24.159
Erhält Festzinssatz 3,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	6.865.157.000	KRW	21. Dez. 2027	(172.656)
Zahlt Festzinssatz 3,09 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.822.064.000	KRW	21. Dez. 2032	77.132
Erhält Festzinssatz 3,62 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	7.790.000	MYR	21. Dez. 2027	(36.573)
Zahlt Festzinssatz 6,21 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.431.000	PLN	21. Dez. 2032	21.229
Erhält Festzinssatz 2,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	62.663.000	CNY	21. Dez. 2024	10.491
Zahlt Festzinssatz 8,76 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	155.183.000	MXN	08. Dez. 2032	58.423
Erhält Festzinssatz 2,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	10.074.000	CNY	21. Dez. 2024	2.216
Erhält Festzinssatz 6,30 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7.689.000	PLN	21. Dez. 2027	(42.439)
Erhält Festzinssatz 7,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	9.247.000	PLN	21. Dez. 2023	(4.457)
Zahlt Festzinssatz 9,02 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	50.730.000	MXN	14. Juli 2027	26.992
Erhält Festzinssatz 8,92 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	15.500.000	MXN	7. Juli 2032	(13.378)
Erhält Festzinssatz 8,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	15.505.000	MXN	6. Juli 2032	(12.659)
Erhält Festzinssatz 7,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	67.514.000	PLN	21. Dez. 2023	(71.499)
Erhält Festzinssatz 2,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	30.506.000	CNY	18. Dez. 2027	(26.751)
Zahlt Festzinssatz 8,55 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	95.045.000	MXN	21. Juli 2027	136.592
Erhält Festzinssatz 9,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	106.925.000	MXN	24. Juli 2024	(91.642)
Erhält Festzinssatz 8,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	28.805.000	MXN	14. Juli 2032	(67.386)
Erhält Festzinssatz 9,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	60.491.000	ZAR	21. Dez. 2032	(124.989)
Erhält Festzinssatz 8,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	30.245.000	ZAR	21. Dez. 2032	(88.822)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 9,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	60.106.000	ZAR	21. Dez. 2032	(135.939)
Zahlt Festzinssatz 8,16 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	48.934.000	ZAR	21. Dez. 2027	86.826
Zahlt Festzinssatz 8,17 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	48.934.000	ZAR	21. Dez. 2027	85.748
Zahlt Festzinssatz 7,85 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	234.144.000	ZAR	21. Dez. 2024	126.746
Zahlt Festzinssatz 7,87 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	234.145.000	ZAR	21. Dez. 2024	122.066
Erhält Festzinssatz 8,95 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	30.245.000	ZAR	21. Dez. 2032	(87.747)
Erhält Festzinssatz 6,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	16.561.000	PLN	21. Dez. 2024	(46.394)
Erhält Festzinssatz 9,29 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	228.408.000	MXN	20. Dez. 2023	(152.161)
Zahlt Festzinssatz 8,29 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	128.252.000	MXN	08. Dez. 2032	356.545
Erhält Festzinssatz 6,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	110.651.000	INR	21. Dez. 2027	(31.976)
Erhält Festzinssatz 8,52 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	13.167.000	MXN	18. Dez. 2024	(17.547)
Erhält Festzinssatz 8,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	73.766.000	MXN	18. Dez. 2024	(97.655)
Erhält Festzinssatz 8,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	69.435.000	MXN	18. Dez. 2024	(92.839)
Erhält Festzinssatz 8,52 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	69.434.000	MXN	18. Dez. 2024	(92.532)
Erhält Festzinssatz 8,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	55.531.000	MXN	28. Dez. 2024	(75.493)
Erhält Festzinssatz 8,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	78.199.000	MXN	18. Dez. 2024	(95.607)
Erhält Festzinssatz 2,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	51.815.000	CNY	21. Dez. 2024	(13.575)
Erhält Festzinssatz 6,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	15.317.000	PLN	21. Dez. 2024	(49.184)
Erhält Festzinssatz 8,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	60.255.000	MXN	18. Dez. 2024	(69.020)
Erhält Festzinssatz 8,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	60.255.000	MXN	18. Dez. 2024	(66.363)
Zahlt Festzinssatz 2,93 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.382.492.000	KRW	21. Dez. 2032	70.980
Erhält Festzinssatz 3,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	6.292.551.000	KRW	21. Dez. 2027	(214.650)
Erhält Festzinssatz 9,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10.205.000	ZAR	21. Dez. 2032	(27.703)
Erhält Festzinssatz 8,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10.205.000	ZAR	21. Dez. 2032	(30.513)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 5,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	43.883.000	CZK	21. Dez. 2024	(19.634)
Zahlt Festzinssatz 9,22 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	284.179.000	HUF	21. Dez. 2032	15.313
Zahlt Festzinssatz 7,98 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	169.995.000	HUF	21. Dez. 2032	39.054
Erhält Festzinssatz 8,18 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	21.103.000	ZAR	18. Dez. 2027	(32.019)
Erhält Festzinssatz 8,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.729.155.000	COP	21. Dez. 2032	(55.017)
Erhält Festzinssatz 8,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.388.388.000	COP	21. Dez. 2032	(47.317)
Erhält Festzinssatz 6,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	249.795.000	INR	21. Dez. 2027	(86.190)
Zahlt Festzinssatz 8,22 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	66.910.000	MXN	6. Aug. 2027	139.775
Zahlt Festzinssatz 8,16 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	66.910.000	MXN	6. Aug. 2027	147.529
Erhält Festzinssatz 8,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	103.955.000	MXN	8. Aug. 2025	(149.344)
Erhält Festzinssatz 2,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.963.000	ILS	21. Dez. 2027	(36.344)
Zahlt Festzinssatz 6,26 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	38.328.000	INR	21. Dez. 2024	5.733
Erhält Festzinssatz 5,83 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.113.000	PLN	21. Dez. 2027	(47.095)
Erhält Festzinssatz 5,83 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.562.000	PLN	21. Dez. 2027	(42.020)
Zahlt Festzinssatz 10,42 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	12.224.000	ZAR	15. Dez. 2032	10.781
Zahlt Festzinssatz 8,64 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	8.094.000	MXN	15. Dez. 2027	9.588
Zahlt Festzinssatz 3,18 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	52.779.000	ILS	20. Dez. 2024	68.973
Zahlt Festzinssatz 3,18 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	22.315.000	ILS	20. Dez. 2024	29.162
Erhält Festzinssatz 3,07 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	6.520.000	ILS	21. Dez. 2027	(46.431)
Zahlt Festzinssatz 8,15 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	106.910.000	ZAR	21. Dez. 2027	192.051
Erhält Festzinssatz 9,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	19.415.000	ZAR	21. Dez. 2032	(52.878)
Erhält Festzinssatz 7,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	119.340.000	ZAR	21. Dez. 2024	(75.933)
Zahlt Festzinssatz 3,50 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	12.325.000	CAD	15. Dez. 2032	28.628
Zahlt Festzinssatz 8,76 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	31.497.000	MXN	15. Dez. 2027	30.003

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 9,58 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.887.991.000	COP	21. Dez. 2027	9.872
Zahlt Festzinssatz 9,68 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.833.693.000	COP	21. Dez. 2027	7.999
Zahlt Festzinssatz 9,74 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.836.015.000	COP	21. Dez. 2027	7.062
Zahlt Festzinssatz 9,77 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.836.007.000	COP	21. Dez. 2027	6.608
Zahlt Festzinssatz 10,62 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.343.767.000	COP	21. Dez. 2024	2.670
Zahlt Festzinssatz 10,60 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	9.562.571.000	COP	21. Dez. 2024	11.297
Zahlt Festzinssatz 8,17 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	95.281.000	ZAR	20. Dez. 2024	27.611
Zahlt Festzinssatz 10,59 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6.831.305.000	COP	21. Dez. 2024	8.565
Zahlt Festzinssatz 3,93 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	11.112.000	MYR	18. Dez. 2027	21.498
Zahlt Festzinssatz 10,46 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	56.211.000	ZAR	15. Dez. 2032	46.154
Erhält Festzinssatz 9,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	9.148.050.000	CLP	21. Dez. 2024	(96.110)
Erhält Festzinssatz 9,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.993.835.000	CLP	21. Dez. 2024	(52.915)
Erhält Festzinssatz 9,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.977.240.000	CLP	21. Dez. 2024	(54.533)
Zahlt Festzinssatz 7,04 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	8.975.175.000	CLP	21. Dez. 2027	167.342
Zahlt Festzinssatz 7,04 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.124.130.000	CLP	21. Dez. 2027	76.894
Zahlt Festzinssatz 7,05 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.440.260.000	CLP	21. Dez. 2027	80.976
Erhält Festzinssatz 6,46 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.448.505.000	CLP	21. Dez. 2032	(52.779)
Erhält Festzinssatz 6,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.104.505.000	CLP	21. Dez. 2032	(41.761)
Erhält Festzinssatz 6,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.190.770.000	CLP	21. Dez. 2032	(24.819)
Zahlt Festzinssatz 2,36 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	29.845.000	CNY	21. Dez. 2027	52.128
Zahlt Festzinssatz 2,35 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	10.215.000	CNY	21. Dez. 2027	18.523
Erhält Festzinssatz 10,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	12.856.145.000	COP	21. Dez. 2027	(15.767)
Erhält Festzinssatz 10,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	30.552.425.000	COP	21. Dez. 2027	(42.513)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 10,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	24.417.815.000	COP	21. Dez. 2027	(31.962)
Zahlt Festzinssatz 9,82 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.290.840.000	COP	21. Dez. 2032	1.627
Zahlt Festzinssatz 9,82 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	17.971.060.000	COP	21. Dez. 2032	20.844
Zahlt Festzinssatz 9,81 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	7.353.745.000	COP	21. Dez. 2032	9.611
Erhält Festzinssatz 11,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	733.905.000	HUF	21. Dez. 2027	38.070
Zahlt Festzinssatz 9,44 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	25.375.000	HUF	21. Dez. 2032	586
Erhält Festzinssatz 7,10 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	66.760.000	PLN	21. Dez. 2024	(110.556)
Zahlt Festzinssatz 6,35 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	56.395.000	PLN	21. Dez. 2027	287.798
Erhält Festzinssatz 6,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.730.000	PLN	21. Dez. 2032	(95.188)
Zahlt Festzinssatz 8,44 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	186.805.000	ZAR	21. Dez. 2027	216.219
Zahlt Festzinssatz 13,53 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.737.392.000	HUF	15. März 2025	(82.116)
Zahlt Festzinssatz 10,70 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.181.413.000	HUF	15. März 2028	(49.769)
Erhält Festzinssatz 9,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.672.545.000	CLP	21. Dez. 2024	(41.512)
Erhält Festzinssatz 6,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.262.700.000	CLP	21. Dez. 2032	(24.516)
Zahlt Festzinssatz 7,11 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.210.365.000	CLP	21. Dez. 2027	66.470
Zahlt Festzinssatz 8,70 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	73.193.000	MXN	2. März 2033	98.278
Erhält Festzinssatz 9,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	216.664.000	MXN	13. März 2024	(81.019)
Erhält Festzinssatz 9,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	82.879.000	MXN	12. März 2025	(41.410)
Zahlt Festzinssatz 10,63 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	44.722.000	ZAR	15. Dez. 2032	26.621
Erhält Festzinssatz 4,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	42.373.000	CZK	15. März 2033	(34.785)
Zahlt Festzinssatz 4,36 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	50.575.000	CZK	19. März 2028	15.761
Zahlt Festzinssatz 5,10 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	15.170.000	CZK	15. März 2028	4.181
Zahlt Festzinssatz 3,65 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	10.122.000	MYR	15. März 2025	12.046

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 3,96 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Bank of America	10.050.000	MYR	19. März 2028	20.358
Erhält Festzinssatz 3,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	7.825.000	MYR	15. März 2028	(26.239)
Erhält Festzinssatz 3,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	6.743.000	ILS	15. März 2033	(53.775)
Zahlt Festzinssatz 3,53 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	106.993.000	ILS	15. März 2024	125.192
Zahlt Festzinssatz 3,38 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	55.134.000	ILS	15. März 2025	121.443
Erhält Festzinssatz 3,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	7.428.000	ILS	15. März 2028	(38.865)
Erhält Festzinssatz 3,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	17.861.000	ILS	15. März 2033	(57.173)
Zahlt Festzinssatz 6,31 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	846.211.000	INR	15. März 2025	114.758
Erhält Festzinssatz 6,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	219.225.000	INR	15. März 2028	(64.794)
Zahlt Festzinssatz 2,40 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	40.779.000	CNY	15. März 2028	73.041
Zahlt Festzinssatz 5,70 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.836.000	PLN	15. März 2033	147.437
Erhält Festzinssatz 5,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	33.326.000	PLN	15. März 2028	(300.118)
Erhält Festzinssatz 9,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	188.973.000	ZAR	15. März 2033	(396.805)
Zahlt Festzinssatz 7,99 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	261.013.000	ZAR	15. März 2024	46.088
Zahlt Festzinssatz 8,07 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	279.142.000	ZAR	15. März 2025	132.786
Erhält Festzinssatz 9,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	5.417.353.000	COP	15. März 2033	(2.868)
Erhält Festzinssatz 3,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.141.138.000	KRW	19. März 2028	(9.816)
Erhält Festzinssatz 3,55 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	6.388.952.000	KRW	15. März 2028	(109.434)
Erhält Festzinssatz 6,52 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.169.520.000	CLP	21. Dez. 2032	(20.538)
Erhält Festzinssatz 6,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	684.730.000	CZK	21. Dez. 2024	(95.364)
Erhält Festzinssatz 4,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	132.115.000	CZK	21. Dez. 2032	(171.513)
Zahlt Festzinssatz 5,10 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	589.125.000	CZK	21. Dez. 2027	301.942
Erhält Festzinssatz 9,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.698.565.000	CLP	21. Dez. 2024	(42.589)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 7,11 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.209.425.000	CLP	21. Dez. 2027	66.455
Erhält Festzinssatz 6,54 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.169.345.000	CLP	21. Dez. 2032	(18.742)
Erhält Festzinssatz 9,23 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.691.380.000	CLP	21. Dez. 2024	(50.387)
Zahlt Festzinssatz 7,04 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3.642.375.000	CLP	21. Dez. 2027	67.912
Erhält Festzinssatz 7,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	774.145.000	HUF	15. Dez. 2032	(23.406)
Zahlt Festzinssatz 3,26 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	9.714.277.000	KRW	15. März 2033	52.271
Erhält Festzinssatz 3,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	6.804.000	CAD	20. März 2025	106.705
Erhält Festzinssatz 2,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14.116.000	EUR	15. März 2025	(74.090)
Erhält Festzinssatz 9,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	206.353.000	HUF	21. Dez. 2032	(11.630)
Erhält Festzinssatz 9,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	256.163.000	HUF	21. Dez. 2032	(14.889)
Erhält Festzinssatz 13,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	623.390.000	HUF	21. Dez. 2024	12.415
Erhält Festzinssatz 13,44 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	832.456.000	HUF	21. Dez. 2024	22.859
Erhält Festzinssatz 4,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	6.611.000	NZD	15. März 2024	(21.649)
Erhält Festzinssatz 13,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	916.887.000	HUF	21. Dez. 2024	21.719
Erhält Festzinssatz 3,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.926.000	NZD	20. März 2025	(19.277)
Zahlt Festzinssatz 3,72 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.498.000	NZD	15. März 2025	8.325
Erhält Festzinssatz 4,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4.691.000	NZD	19. März 2028	(28.796)
Zahlt Festzinssatz 4,09 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	3.391.000	NZD	15. März 2028	39.499
Zahlt Festzinssatz 4,16 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5.086.000	NZD	15. März 2033	27.924
Erhält Festzinssatz 4,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.837.000	NZD	15. März 2033	(135.363)
Zahlt Festzinssatz 6,24 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3.114.239.000	CLP	15. März 2033	78.234
Zahlt Festzinssatz 10,09 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	13.463.226.000	CLP	15. März 2024	107.980
Zahlt Festzinssatz 7,22 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.316.550.000	CLP	20. März 2025	5.373
Zahlt Festzinssatz 8,57 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	14.883.349.000	CLP	15. März 2025	171.117

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 6,67 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.257.628.000	CLP	15. März 2028	86.408
Zahlt Festzinssatz 6,71 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.172.259.000	CLP	15. März 2028	41.030
Zahlt Festzinssatz 6,69 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.259.150.000	CLP	15. März 2028	44.033
Zahlt Festzinssatz 2,88 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	105.692.000	SEK	15. März 2033	119.813
Zahlt Festzinssatz 5,98 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.290.000	PLN	21. Dez. 2032	109.766
Erhält Festzinssatz 6,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	20.712.000	PLN	21. Dez. 2027	(137.093)
Erhält Festzinssatz 10,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	28.970.000	ZAR	15. Dez. 2032	(18.414)
Zahlt Festzinssatz 8,81 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19.115.000	MXN	15. Dez. 2027	16.105
Zahlt Festzinssatz 8,85 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	24.110.000	MXN	15. Dez. 2027	18.894
Zahlt Festzinssatz 8,82 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19.726.000	MXN	15. Dez. 2027	16.498
Erhält Festzinssatz 3,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	369.637.000	NOK	15. März 2028	132.382
Zahlt Festzinssatz 3,81 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	734.540.000	NOK	15. März 2025	(264.125)
Zahlt Festzinssatz 4,03 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	6.033.000	AUD	15. März 2028	(13.848)
Zahlt Festzinssatz 4,14 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Bank of America	5.982.000	MYR	18. Dez. 2027	4.325
Erhält Festzinssatz 6,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.147.000	PLN	21. Dez. 2027	(9.790)
Erhält Festzinssatz 8,23 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	92.250.000	ZAR	21. Dez. 2024	(15.359)
Erhält Festzinssatz 9,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	26.052.000	ZAR	21. Dez. 2032	(33.003)
Zahlt Festzinssatz 8,63 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	84.660.000	ZAR	21. Dez. 2027	62.552
Erhält Festzinssatz 10,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	109.138.000	MXN	20. Sept. 2024	(8.567)
Erhält Festzinssatz 9,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29.306.000	MXN	10. Sept. 2032	(16.765)
Zahlt Festzinssatz 9,17 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	96.402.000	MXN	17. Sept. 2027	21.646
Zahlt Festzinssatz 3,69 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	39.241.000	ILS	15. März 2025	22.157
Erhält Festzinssatz 5,96 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	161.044.000	CZK	15. März 2025	(12.955)
Zahlt Festzinssatz 2,51 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	18.586.000	CNY	15. März 2028	19.732

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 2,57 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	11.411.000	CNY	15. März 2028	7.231
Zahlt Festzinssatz 5,49 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	116.980.000	CZK	21. Dez. 2027	(18.348)
Erhält Festzinssatz 5,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	32.300.000	CZK	21. Dez. 2032	5.416
Erhält Festzinssatz 6,61 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	137.350.000	CZK	21. Dez. 2024	22.356
Zahlt Festzinssatz 2,59 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	21.609.000	CNY	15. März 2028	11.222
Erhält Festzinssatz 8,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.410.663.000	HUF	15. März 2033	(23.076)
Zahlt Festzinssatz 2,60 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	55.375.000	CNY	15. März 2028	25.140
Zahlt Festzinssatz 3,64 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2.137.405.000	KRW	15. März 2033	(9.305)
Zahlt Festzinssatz 3,95 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	402.290.000	KRW	15. März 2033	(3.004)
Zahlt Festzinssatz 3,98 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	366.659.040	KRW	15. März 2033	(3.508)
Erhält Festzinssatz 8,43 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	438.016.000	HUF	15. März 2033	2.285
Erhält Festzinssatz 6,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.108.000	PLN	15. März 2033	14.736
Zahlt Festzinssatz 3,92 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.762.167.000	KRW	15. März 2033	(11.090)
Zahlt Festzinssatz 3,50 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	5.630.000	SGD	15. März 2028	(14.126)
Zahlt Festzinssatz 9,42 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.663.784.000	CLP	15. März 2025	(5.846)
Zahlt Festzinssatz 9,44 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.231.021.000	CLP	15. März 2025	5.105
Zahlt Festzinssatz 3,83 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2.218.384.740	KRW	15. März 2033	(1.500)
Zahlt Festzinssatz 9,44 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.459.597.000	CLP	15. März 2025	(5.567)
Erhält Festzinssatz 13,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.454.735.000	HUF	21. Dez. 2024	17.445
Zahlt Festzinssatz 10,78 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	415.410.000	HUF	21. Dez. 2027	(9.066)
Zahlt Festzinssatz 4,34 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4.640.000	NZD	15. März 2033	3.229
				USD	(1.308.497)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

Zum 30. September 2022 bestand das folgende Risiko bei in Bezug auf Derivatkontrakte einzufordernden Sicherheiten je Kontrahent:

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA BlueTrend				
	J.P. Morgan	Barmittel	CHF	1.224.595
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	1.923.698
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	76.035.888
	J.P. Morgan	Barmittel	NZD	134.492
	J.P. Morgan	Barmittel	SEK	7.472.866
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	13.897.682
	J.P. Morgan	Barmittel	ZAR	11.596.821
	Merrill Lynch	Barmittel	EUR	816.004
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	325.139
	UBS	Barmittel	USD	7.660.000
			USD	27.761.577
Schroder GAIA Egerton Equity				
	HSBC	Barmittel	EUR	1.440.000
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	3
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	11.589.882
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	11.204
			EUR	13.037.844
Schroder GAIA Helix				
	Barclays Bank	Barmittel	USD	1.390.000
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	1.526.616
	Goldman Sachs	Barmittel	GBP	3.682.180
	Goldman Sachs	Barmittel	HKD	967.140
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	8.247.098
	J.P. Morgan	Barmittel	CAD	12.794
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	6.056.183
	J.P. Morgan	Barmittel	GBP	139.724
	J.P. Morgan	Barmittel	HKD	2.589.797
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	103.355.789
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	25.229.019
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	3.590.000
			USD	51.331.509
Schroder GAIA Sirios US Equity				
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	3.060.000
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	1.340.000
			USD	4.400.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified				
	Citi Bank	Barmittel	EUR	1.991.731
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	37.116.284
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	103.067.770
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	256.132
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	40.856.941
	Morgan Stanley	Barmittel	ZAR	1.028.385
	Société Générale	Barmittel	AUD	10.812.146
	Société Générale	Barmittel	CAD	587.622
	Société Générale	Barmittel	CHF	15
	Société Générale	Barmittel	EUR	46
	Société Générale	Barmittel	GBP	7.707.673
	Société Générale	Barmittel	JPY	68.897.501
	Société Générale	Barmittel	SEK	13.452.711
	Société Générale	Barmittel	USD	1.075.065
			USD	98.842.807

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
	HSBC	Barmittel	GBP	793.628
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	30.835
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	10
			GBP	824.472
Schroder GAIA Wellington Pagosa				
	Barclays Bank	Barmittel	USD	930.000
	BNP Paribas	Barmittel	USD	5.040.000
	Citi Bank	Barmittel	USD	740.000
	Deutsche Bank	Barmittel	USD	1.280.000
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	2.987.665
	HSBC	Barmittel	USD	1.490.000
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	4.311.000
	Merrill Lynch	Barmittel	USD	900.000
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	144.455
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	565.862
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	1.051.527
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	115.636
	Morgan Stanley	Barmittel	HKD	77.714
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	130
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	139
	Morgan Stanley	Barmittel	THB	95.588
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	4.742.077
	Morgan Stanley	Barmittel	ZAR	5.910
	Standard Chartered Bank	Barmittel	USD	520.000
	UBS	Barmittel	USD	480.000
			USD	25.095.308

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. Kosten für strukturierte Produkte sind im Marktwert enthalten.

Die Transaktionskosten für das Berichtsjahr fielen wie folgt aus:

Teilfonds	Währung	Provisionen
Schroder GAIA BlueTrend	USD	75.908
Schroder GAIA Cat Bond	USD	49.820
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	519.253
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	347.228
Schroder GAIA Helix	USD	1.610.841
Schroder GAIA Oaktree Credit	USD	160
Schroder GAIA Sirios US Equity	USD	560.248
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	226.176
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	GBP	59.978
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	1.303.784

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Dividenden

Während des Berichtsjahres haben die folgende Teilfonds Dividendenausschüttungen vorgenommen:

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus-schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
8. Okt. 2021	15. Okt. 2021	22. Okt. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	134,81	USD	0,834065
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	529,76	SGD	1,110581
12. Nov. 2021	19. Nov. 2021	26. Nov. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	585,44	USD	3,622100
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.304,03	SGD	4,830049
10. Dez. 2021	17. Dez. 2021	27. Dez. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	484,26	USD	2,996102
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.906,62	SGD	3,996693
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	191.961,17	USD	9,970574
14. Jan. 2022	21. Jan. 2022	28. Jan. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	616,43	USD	3,813834
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.406,79	SGD	5,044839
11. Feb. 2022	18. Feb. 2022	25. Feb. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	474,09	USD	2,933181
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.000,14	SGD	3,915513
11. März 2022	18. März 2022	25. März 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	503,52	USD	3,115263
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.070,03	SGD	4,188658
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	259.273,09	USD	13,155949
8. Apr. 2022	22. Apr. 2022	29. Apr. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	542,92	USD	3,359030
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.148,77	SGD	4,496345
13. Mai 2022	20. Mai 2022	27. Mai 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	761,69	USD	4,712553
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.628,67	SGD	6,373925
10. Juni 2022	17. Juni 2022	24. Juni 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	567,24	USD	3,509265
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.204,21	SGD	4,711851
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	299.943,50	USD	15,201275
29. Juni 2022	30. Juni 2022	8. Juli 2022	Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch.	8,68	USD	0,578667
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch. (in CHF abgesichert)	52,71	CHF	0,527052
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch. (in GBP abgesichert)	55,09	GBP	0,550939
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch.	9,66	USD	0,644000
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert)	59,24	CHF	0,592384
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	61,91	GBP	0,619105
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse E Aussch.	10,15	USD	0,676667
Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse E Aussch. (in CHF abgesichert)	61,22	CHF	0,612156			
8. Juli 2022	15. Juli 2022	22. Juli 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	689,07	USD	4,262977
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.463,18	SGD	5,724255
12. Aug. 2022	19. Aug. 2022	26. Aug. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	925,51	USD	5,725388
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.929,00	SGD	7,545489
9. Sept. 2022	16. Sept. 2022	23. Sept. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	801,79	USD	4,959744
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.753,38	SGD	6,856927
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	376.938,65	USD	19,227551
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse PI Aussch.	19,28	USD	12,853333
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse PI Aussch. (in GBP abgesichert)	133,91	GBP	1,339085
29. Sept. 2022	30. Sept. 2022	7. Okt. 2022	Schroder GAIA Helix Klasse S Aussch.	474.999,88	USD	3,944310
			Schroder GAIA Helix Klasse S Aussch. (in EUR abgesichert)	110.933,13	EUR	3,974666
			Schroder GAIA Helix Klasse S Aussch. (in GBP abgesichert)	5.595.083,18	GBP	4,193738
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch.	14,14	USD	0,936978
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch. (in CHF abgesichert)	91,72	CHF	0,912095
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch. (in EUR abgesichert)	88,91	EUR	0,889150
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch. (in GBP abgesichert)	96,23	GBP	0,956773
Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch.	16,05	USD	1,062993			
Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert)	104,15	CHF	1,035021			

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus-schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch. (in EUR abgesichert)	101,04	EUR	1,010356
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	109,26	GBP	1,085429
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse E Aussch.	17,49	USD	1,157709
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse E Aussch. (in CHF abgesichert)	107,91	CHF	1,072140
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse E Aussch. (in EUR abgesichert)	104,60	EUR	1,045962
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	113,16	GBP	1,123977

Wechselkurs

Der folgende Wechselkurs wurde für die Berechnung des im Abschluss zum 30. September 2022 in Euro ausgewiesenen Gesamtbetrags verwendet:

1 Euro = 0,98005 US-Dollar

1 Euro = 0,87775 Pfund Sterling

Ukraine/Russland-Sanktionen

Die Invasion der Ukraine durch Russland, die am 24. Februar begann, hat das Bewertungs-, Liquiditäts- und Marktrisiko für Wertpapiere erhöht, die von der Ukraine, Belarus und Russland sowie, in gewissem Umfang, von den meisten globalen Märkten begeben wurden. Zum Zeitpunkt dieses Berichts sind die Lösung dieses Konflikts und die potenziellen Auswirkungen auf die Fonds weiterhin ungewiss. Der Verwaltungsrat beobachtet die Situation in Bezug auf alle in unseren Fonds gehaltenen Wertpapiere sehr genau. Wertpapiere russischer Emittenten, die in unseren Fonds gehalten werden, erfahren weiterhin Beeinträchtigungen durch eine Reihe von Maßnahmen von Regierungen, Börsen und Kontrahenten, einschließlich Sanktionsmaßnahmen, was zu erheblichen Bewertungs- und Liquiditätsproblemen führt. Der Handel an den russischen Märkten wurde ausgesetzt und die Fonds werden auf absehbare Zeit nicht in Aktien aus Russland oder Belarus investieren. Der Verwaltungsrat wird weiterhin angemessene Bewertungsgrundsätze in Übereinstimmung mit unseren Preisbildungsprozessen anwenden. Aufgrund dieser Umstände und der Tatsache, dass wir nicht in der Lage sind, diese Vermögenswerte zu handeln oder zu übertragen, ist der Wert der russischen Wertpapiere in unseren Fonds auf ein Minimum gesunken, und dies wird sich voraussichtlich bis auf weiteres im NIW der betreffenden Fonds widerspiegeln.

Der folgende Teilfonds ist in russischen und ukrainischen Wertpapieren engagiert:

Schroder GAIA Helix

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Am 1. November 2022 hat sich die Anschrift der HSBC Continental Europe, Luxemburg, geändert in:

HSBC Continental Europe, Luxemburg

18 Boulevard de Kockelscheuer, L-1821 Luxembourg, Großherzogtum Luxemburg.

Der Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund änderte seinen Namen am 1. Oktober 2022 in Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return.

Der Anlageverwalter des Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund und Schroder GAIA Helix hat sich mit Wirkung zum 5. Dezember 2022 von BennBridge Ltd zu Tellworth Investments LLP geändert.

Am 21. Dezember 2022 wurde der folgende Teilfonds aufgelegt: Schroder GAIA Asian Equity Long Short.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NAV	Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NAV
Schroder GAIA BlueTrend			Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)		
Klasse A Thes.	202.626	2,76 %	Klasse PI Aussch.	0	0,00 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	1.232	1,86 %	Klasse PI Aussch. (in GBP abgesichert)	0	0,00 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	704.119	1,67 %	Klasse Y Thes.	entfällt#	entfällt#
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00 %	Klasse Y Thes. (in CHF abgesichert)	entfällt#	entfällt#
Klasse C Thes.	1.335.729	3,03 %	Klasse Y Thes. (in EUR abgesichert)	entfällt#	entfällt#
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	1.114.656	3,56 %	Klasse Y1 Thes.	entfällt#	entfällt#
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	17.219	2,15 %	Klasse Y1 Thes. (in CHF abgesichert)	entfällt#	entfällt#
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	655.397	2,25 %	Klasse Y1 Thes. (in EUR abgesichert)	entfällt#	entfällt#
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1.857.512	2,69 %			
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	9.546	2,58 %	Schroder GAIA Contour Tech Equity		
Klasse E Thes.	239.240	2,87 %	Klasse A Thes.	1.500	0,01 %
Klasse E Thes. CHF	0	0,00 %	Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	26	0,01 %
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %	Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	332	0,01 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	15.730	2,67 %	Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00 %
Klasse E Thes. GBP	0	0,00 %	Klasse A1 Thes.	275	0,01 %
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	0	0,00 %	Klasse C Thes.	7.947	0,01 %
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	495.783	2,81 %	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %
Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1.314	0,00 %
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	118.777	2,27 %	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	40	0,00 %
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	5.216	2,81 %	Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	58	0,00 %
Klasse N Thes. (in SEK abgesichert)	17.610	0,76 %	Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00 %
			Klasse E Thes.	98	0,00 %
			Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %
			Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %
			Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	0	0,00 %
			Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	0	0,00 %
			Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00 %
			Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#
			Schroder GAIA Egerton Equity		
			Klasse A Thes.	34.908	0,04 %
			Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	2	0,00 %
			Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	17.315	0,02 %
			Klasse A Aussch. GBP	0	0,00 %
			Klasse A1 Thes.	0	0,00 %
			Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	3.327	0,02 %
			Klasse C Thes.	606.239	0,20 %
			Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	9.205	0,01 %
			Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	173.958	0,10 %
			Klasse C Aussch.	4.133	0,29 %
			Klasse C Aussch. GBP	1.284	0,07 %
			Klasse E Thes.	992	0,72 %
			Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#
			Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	entfällt#	entfällt#
			Klasse X Thes.	2.970	0,00 %

Für die Anteilsklasse werden keine Performancegebühren erhoben.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022 (Forts.)

Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse (Forts.)

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NAV	Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NAV
Schroder GAIA Helix			Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
Klasse A Thes.	0	0,00 %	Klasse C Thes.	331	0,00 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	0	0,00 %	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	0	0,00 %
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00 %	Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#
Klasse C Thes.	0	0,00 %	Klasse K Thes.	0	0,00 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %	Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %	Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1	0,00 %			
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	0	0,00 %	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund		
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00 %	Klasse C Thes.	0	0,00 %
Klasse C1 Thes.	0	0,00 %	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %	Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	0	0,00 %
Klasse E Thes.	0	0,00 %	Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %	Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	116	0,00 %	Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	0	0,00 %
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	0	0,00 %	Klasse R Thes.	0	0,00 %
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00 %	Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %
Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#	Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	0	0,00 %
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	entfällt#	entfällt#			
Klasse IZ Thes. (in GBP abgesichert)	0	0,00 %	Schroder GAIA Wellington Pagosa		
Klasse S Aussch.	0	0,00 %	Klasse A Thes.	96.529	0,67 %
Klasse S Aussch. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %	Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	1.298	0,39 %
Klasse S Aussch. (in GBP abgesichert)	0	0,00 %	Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	67.880	0,42 %
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %	Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	12.202	0,62 %
Schroder GAIA Sirius US Equity			Klasse A1 Thes.	0	0,00 %
Klasse A Thes.	60.728	0,06 %	Klasse C Thes.	1.954.773	0,77 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	191	0,02 %	Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	156.938	0,70 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	27.617	0,15 %	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	22.216	0,53 %
Klasse C Thes.	216.287	0,29 %	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	540.387	0,51 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1.249	0,05 %	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	358.206	0,64 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	139.139	0,32 %	Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	9.198	0,09 %	Klasse C1 Thes.	0	0,00 %
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	1.113	0,26 %	Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	298	0,50 %
Klasse E Thes.	262	0,41 %	Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	11.498	0,58 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	3.000	0,11 %	Klasse E Thes.	42.150	0,69 %
Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#	Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	6.107	0,54 %
Klasse X Thes.	0	0,00 %	Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	90.126	0,54 %
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	21.983	1,89 %	Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	46.649	0,60 %
			Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00 %
			Klasse I Thes.	entfällt#	entfällt#

Für den Schroder GAIA Oaktree Credit wird Performancegebühr erhoben.

Für die Anteilsklasse werden keine Performancegebühren erhoben.

Gesamtkostenquote („TER“)

für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA BlueTrend	
Klasse A Thes.	2,00 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,03 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,03 %
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	1,98 %
Klasse C Thes.	1,40 %
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	1,43 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,43 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,43 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,43 %
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	1,43 %
Klasse E Thes.	1,40 %
Klasse E Thes. CHF	1,17 %
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,35 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,43 %
Klasse E Thes. GBP	1,24 %
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	1,36 %
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	1,43 %
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	1,43 %
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	1,43 %
Klasse N Thes. (in SEK abgesichert)	1,00 %

Schroder GAIA Cat Bond	
Klasse A Thes.	1,78 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	1,82 %
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	1,82 %
Klasse C Thes.	1,38 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,41 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,40 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,44 %
Klasse F Thes.	1,72 %
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	1,73 %
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	1,73 %
Klasse F Aussch.	1,72 %
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1,74 %
Klasse I Thes.	0,14 %
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	0,15 %
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	0,13 %
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	0,12 %
Klasse IF Thes.	1,32 %
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	1,33 %
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	1,33 %
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	1,33 %
Klasse IF Aussch.	1,32 %
Klasse PI Thes. (in CHF abgesichert)	0,69 %
Klasse PI Thes. (in EUR abgesichert)	0,69 %
Klasse PI Aussch.	0,68 %
Klasse PI Aussch. (in GBP abgesichert)	0,69 %
Klasse Y Thes.	1,07 %
Klasse Y Thes. (in CHF abgesichert)	1,14 %

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)	
Klasse Y Thes. (in EUR abgesichert)	1,14 %
Klasse Y1 Thes.	1,42 %
Klasse Y1 Thes. (in CHF abgesichert)	1,54 %
Klasse Y1 Thes. (in EUR abgesichert)	1,54 %
Schroder GAIA Contour Tech Equity	
Klasse A Thes.	2,42 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,45 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,45 %
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	2,45 %
Klasse A1 Thes.	2,92 %
Klasse C Thes.	1,67 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,70 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,70 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,70 %
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	1,70 %
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	1,65 %
Klasse E Thes.	1,42 %
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,46 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,45 %
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	1,45 %
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	1,45 %
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	1,40 %

Schroder GAIA Egerton Equity	
Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	2,46 %
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	2,46 %
Klasse A Aussch. GBP	2,43 %
Klasse A1 Thes.	2,93 %
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	2,96 %
Klasse C Thes.	1,67 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,71 %
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	1,70 %
Klasse C Aussch.	1,68 %
Klasse C Aussch. GBP	1,68 %
Klasse E Thes.	1,66 %
Klasse X Thes.	1,57 %

Schroder GAIA Helix	
Klasse A Thes.	2,42 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,46 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,46 %
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	2,46 %
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	2,44 %
Klasse C Thes.	1,36 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,41 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,40 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,40 %
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	1,37 %
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	1,39 %

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.

Gesamtkostenquote („TER“)

für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Helix (Forts.)		Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)	
Klasse C1 Thes.	1,29 %	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,70 %
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	1,34 %	Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	1,68 %
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	1,35 %	Klasse E Thes.	1,37 %
Klasse E Thes.	1,00 %	Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,40 %
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,00 %	Klasse X Thes.	1,51 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	0,99 %	Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	1,60 %
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	0,97 %		
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	0,96 %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	
Klasse I Thes.	0,14 %	Klasse C Thes.	1,82 %
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	0,17 %	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,86 %
Klasse IZ Thes. (in GBP abgesichert)	1,16 %	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,85 %
Klasse S Aussch.	0,62 %	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,86 %
Klasse S Aussch. (in EUR abgesichert)	0,66 %	Klasse K Thes.	2,33 %
Klasse S Aussch. (in GBP abgesichert)	0,67 %	Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	2,35 %
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	0,74 %	Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	2,36 %
Schroder GAIA Oaktree Credit		Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	
Klasse A2 Thes.	1,35 %	Klasse C Thes.	1,14 %
Klasse A2 Thes. (in CHF abgesichert)	1,57 %	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,16 %
Klasse A2 Thes. (in EUR abgesichert)	1,57 %	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,15 %
Klasse A2 Aussch.	1,43 %	Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	1,15 %
Klasse A2 Aussch. (in CHF abgesichert)	1,59 %	Klasse I Thes.	0,08 %
Klasse A2 Aussch. (in EUR abgesichert)	1,58 %	Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	1,65 %
Klasse A2 Aussch. (in GBP abgesichert)	1,59 %	Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	1,64 %
Klasse C Thes.	1,07 %	Klasse R Thes.	1,13 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,09 %	Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	1,16 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,07 %	Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	1,15 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,07 %		
Klasse C Aussch.	0,93 %	Schroder GAIA Wellington Pagosa	
Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert)	1,09 %	Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse C Aussch. (in EUR abgesichert)	1,08 %	Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,46 %
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	1,09 %	Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,46 %
Klasse E Thes.	0,91 %	Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	2,46 %
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	0,91 %	Klasse A1 Thes.	2,86 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	0,93 %	Klasse C Thes.	1,68 %
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	0,92 %	Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	1,71 %
Klasse E Aussch.	0,60 %	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,70 %
Klasse E Aussch. (in CHF abgesichert)	0,94 %	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,71 %
Klasse E Aussch. (in EUR abgesichert)	0,93 %	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,71 %
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	0,94 %	Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	1,60 %
Klasse I Thes.	0,14 %	Klasse C1 Thes.	1,56 %
		Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	1,75 %
		Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	1,71 %
		Klasse E Thes.	1,18 %
		Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,20 %
		Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,21 %
		Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	1,21 %
		Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	1,14 %
Schroder GAIA Sirios US Equity			
Klasse A Thes.	2,43 %		
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,46 %		
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,46 %		
Klasse C Thes.	1,68 %		
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,71 %		
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,70 %		

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.

Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)

Risikoprofil und Hebelung

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 % ihres Nettoinventarwerts beschränkt ist.

Fonds

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 BlueTrend
Schroder GAIA Contour Tech Equity
Schroder GAIA Egerton Equity
Schroder GAIA Helix
Schroder GAIA Two Sigma Diversified
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund
Schroder GAIA Wellington Pagosa

Teilfonds	Ausschöpfung des regulatorischen VaR-Limits			
	Niedrigstes	Höchstes	Durchschnitt	Durchschnittliche Hebelung
Schroder GAIA BlueTrend	21,60 %	64,15 %	37,95 %	1.505,29 %
Schroder GAIA Contour Tech Equity	22,71 %	47,45 %	38,12 %	139,78 %
Schroder GAIA Egerton Equity	36,44 %	53,57 %	44,64 %	158,31 %
Schroder GAIA Helix	7,52 %	12,23 %	10,09 %	602,33 %
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	23,00 %	34,06 %	28,43 %	520,03 %
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	10,42 %	16,70 %	13,36 %	99,90 %
Schroder GAIA Wellington Pagosa	6,08 %	16,97 %	10,16 %	957,56 %

Angaben zum VaR-Modell

Teilfonds	Modelltyp	Konfidenzintervall	Haltedauer	Beobachtungszeitraum
Schroder GAIA BlueTrend	Monte-Carlo-Simulation	99 %	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA Contour Tech Equity	Monte-Carlo-Simulation	99 %	20 Tage	3 Jahre
Schroder GAIA Egerton Equity	Monte-Carlo-Simulation	99 %	20 Tage	3 Jahre
Schroder GAIA Helix	Parameter-Simulation	99 %	20 Tage	1 Jahr
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Monte-Carlo-Simulation	99 %	20 Tage	3 Jahre
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	Monte-Carlo-Simulation	99 %	20 Tage	3 Jahre
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Monte-Carlo-Simulation	99 %	20 Tage	3 Jahre

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

OGAW-Vergütungsangaben für die Schroder Investment Management Europe S.A. («SIM Europe») für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021

Diese Angaben sind Bestandteil des ungeprüften Teils dieses Jahresberichts und Abschlusses und sollten in Verbindung mit dem Vergütungsbericht der Schroders plc auf den Seiten 77 bis 99 des Jahresberichts und Abschlusses für 2021 (verfügbar auf der Website der Gruppe – <https://www.schroders.com/en/investor-relations/results-and-reports/annual-report-and-accounts-2021/>) 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 Funktionen 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 2021 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 anhand eines Gesamtvergütungsverhältnisses bestimmt, 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 2021 gezahlten leistungsabhängigen Vergütungen wider.

- Der Gesamtbetrag der von der SIM Europe an ihre 316 Mitarbeitenden gezahlten Vergütung belief sich auf 63,45 Mio. EUR, wovon 34,49 Mio. EUR auf Festvergütungen (z. B. Gehälter, Sachleistungen) und 28,96 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 Funktion 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 222 OGAW-MRTs der SIM Europe in Bezug auf das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 gezahlte und der SIM Europe oder den von ihr verwalteten OGAW-Fonds zugerechnete Gesamtvergütung beträgt 229,21 Mio. EUR, wovon 63,68 Mio. EUR an Mitglieder der oberen Führungsebene, 157,34 Mio. EUR an MRTs, die Risiken für die SIM Europe oder die von ihr verwalteten OGAW-Fonds übernehmen, und 8,19 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.

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 2022 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
15.746.932	2,67 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
40.772.883	6,93 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt EUR	% des verwalteten Vermögens
56.519.815	9,60 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2022 wurden keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen EUR
Goldman Sachs	20.750.502
Morgan Stanley	16.354.048
J.P. Morgan	14.262.694
Merrill Lynch	5.152.571
	56.519.815

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	11.589.882
	11.589.882

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert EUR
Weniger als 1 Tag	11.589.882
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	11.589.882

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert EUR
EUR	11.589.882
	11.589.882

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	-	-	-
1 bis 3 Monate	2.809.381	6.126.358	8.935.739
3 bis 12 Monate	4.259.028	22.833.940	27.092.968
Mehr als 1 Jahr	8.678.523	11.812.585	20.491.108
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	15.746.932	40.772.883	56.519.815

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	11.589.882
	11.589.882

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	23.901.473
Gepoolt	-
Sonstige	-
	23.901.473

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu Sicherungszwecken 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

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite EUR*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettogewinn	94,82 %	73.150.460
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	5,18 %	3.992.207
	100,00 %	77.142.667

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in „Nettoerträge aus Swapkontrakten“ und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swapkontrakten“ sowie unter „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swapkontrakten“ enthalten.

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
–	–
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
35.677.533	7,28 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
35.677.533	7,28 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2022 wurden keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
J.P. Morgan	18.218.230
Goldman Sachs	11.768.121
Morgan Stanley	5.090.054
Barclays Bank	601.128
	35.677.533

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	4.890.000
	4.890.000

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	4.890.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	4.890.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	4.890.000
	4.890.000

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	-	35.677.533	35.677.533
Mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	-	35.677.533	35.677.533

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	4.890.000
	4.890.000

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Helix (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	5.700.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	5.700.000

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu Sicherungszwecken 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

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps**	0,11 %	248.979
Realisierter Nettogewinn	96,74 %	230.036.864
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	3,15 %	7.492.066
	100,00 %	237.777.909

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehenden Angaben zu den Zinsen auf Swaps beziehen sich auf alle Swap-Geschäfte und nicht nur auf Total Return Swaps.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in „Nettoerträge aus Swapkontrakten“ und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swapkontrakten“ sowie unter „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swapkontrakten“ enthalten.

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
4.931.519	2,61 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
12.658.803	6,72 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
17.590.322	9,33 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2022 wurden keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Goldman Sachs	6.988.739
Merrill Lynch	6.735.575
Morgan Stanley	3.759.674
Barclays Bank	106.334
	17.590.322

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

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	1.340.000
	1.340.000

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	1.340.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	1.340.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	1.340.000
	1.340.000

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	-	106.334	106.334
1 bis 3 Monate	-	940.604	940.604
3 bis 12 Monate	4.799.838	10.575.163	15.375.001
Mehr als 1 Jahr	131.681	1.036.702	1.168.383
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	4.931.519	12.658.803	17.590.322

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Goldman Sachs	USA
Merrill Lynch	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.

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	1.340.000
	1.340.000

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	1.510.000
Gepoolt	–
Sonstige	–
	1.510.000

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu Sicherungszwecken 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

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettogewinn	95,44 %	21.906.494
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	4,56 %	1.046.632
	100,00 %	22.953.126

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in „Nettoerträge aus Swapkontrakten“ und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swapkontrakten“ sowie unter „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swapkontrakten“ enthalten.

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
18.017.797	2,59 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
–	–
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
18.017.797	2,59 %

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2022 wurden keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	18.017.797
	18.017.797

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	4.600.000
	4.600.000

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	4.600.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	4.600.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	4.600.000
	4.600.000

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	18.017.797	-	18.017.797
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	-	-	-
Mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	18.017.797	-	18.017.797

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

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	4.600.000
	4.600.000

Gestellte Sicherheiten

Zum 30. September 2022 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 Sicherungszwecken 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

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettogewinn	69,41 %	63.109.633
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	30,59 %	27.808.191
	100,00 %	90.917.824

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in „Nettoerträge aus Swapkontrakten“ und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swapkontrakten“ sowie unter „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swapkontrakten“ enthalten.

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
7.606.031	1,24 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
19.340.957	3,14 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
26.946.988	4,38 %

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2022 wurden keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	12.312.140
Goldman Sachs	8.474.723
J.P. Morgan	6.160.125
	26.946.988

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	9.653.665
	9.653.665

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	9.653.665
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	9.653.665

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	9.653.665
	9.653.665

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	61.340	77.511	138.851
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	7.544.691	19.246.772	26.791.463
Mehr als 1 Jahr	-	16.674	16.674
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	7.606.031	19.340.957	26.946.988

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

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
Morgan Stanley	4.298.000
J.P. Morgan	3.306.000
Goldman Sachs	2.049.665
	9.653.665

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	1.240.143
Gepoolt	-
Sonstige	-
	1.240.143

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu Sicherungszwecken 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

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	-	-
Realisierter Nettogewinn	26,40 %	4.666.562
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	73,60 %	13.011.461
	100,00 %	17.678.023

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in „Nettoerträge aus Swapkontrakten“ und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swapkontrakten“ sowie unter „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swapkontrakten“ enthalten.

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

Produktname: **Schroder GAIA Cat Bond**

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

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Hatte dieses Finanzprodukt ein nachhaltiges Anlageziel?

Ja

Nein

Es hat **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel** getätigt: ___%

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

Es hat **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel** getätigt: ___%

Es wurden **ökologische/soziale Merkmale beworben** und obwohl es keine nachhaltigen Investitionen angestrebt hat, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie 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 hat ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Eine **nachhaltige Anlage** ist ein Investment in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines ökologischen oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt dass diese Anlage keine wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf ökologische oder soziale Ziele hat und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

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



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 investiert:

- 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;

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

– mindestens 5 % seines Vermögens in Anlagen, die dazu bestimmt sind, das Fehlen eines wirtschaftlichen Versicherungsschutzes gegen Naturkatastrophen zu beheben.

Außerdem weist der Fonds 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. Es liefert eine Schätzung der tatsächlichen „Auswirkungen“, die ein Sponsor einer Transaktion in Bezug auf soziale und ökologische „Kosten“ oder „Vorteile“ verursachen könnte. Dazu werden bestimmte Indikatoren in Bezug auf diesen Sponsor verwendet und diese positiv und negativ quantifiziert, um eine aggregierte fiktive Kennzahl für die Auswirkungen zu erstellen, die der jeweils zugrunde liegende Sponsor 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 Sponsor ausgedrückt, und zwar als fiktiver Prozentsatz (positiv oder negativ) des Umsatzes des jeweiligen zugrunde liegenden Sponsors. Ein Score 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 firmeneigenen Tool von Schroders gemessen werden.

Der Referenzzeitraum für diesen Fonds ist der 1. Oktober 2021 bis 30. September 2022.

● **Wie haben sich die Nachhaltigkeitsindikatoren entwickelt?**

Der Anlageverwalter überwachte die Einhaltung des Merkmals, um mindestens wie folgt zu investieren: 80 % seines Vermögens in Anlagen, die mit Naturkatastrophen und/oder Lebensrisiken verbunden sind, 50 % seines Vermögens in Anlagen, die mit meteorologischen Risiken verbunden sind, und 5 % seines Vermögens in Anlagen, die dazu bestimmt sind, das Fehlen eines wirtschaftlichen Versicherungsschutzes gegen Naturkatastrophen zu beheben, indem das Betriebssystem eines Drittanbieters für Anlageexperten mit Beaufsichtigung durch ein internes Portfolio-Compliance-Team verwendet wird.

Der positive absolute Nachhaltigkeitswert des Fonds für den Referenzzeitraum betrug 0,8 %.

Der Nachhaltigkeitswert wird wie vorstehend beschrieben als fiktiver Prozentsatz berechnet.

Wie am Ende des Referenzzeitraums mit dem von Schroders entwickelten Tool gemessen, waren die fünf wichtigsten Indikatoren, die positiv zum Nachhaltigkeitswert des Fonds beigetragen haben:

– finanzielle Inklusion – der geschätzte gesellschaftliche Nutzen aus der Erbringung von Finanzdienstleistungen für die lokale Bevölkerung. Zuweisung im Verhältnis zum Marktanteil der Gesellschaft am weltweiten Umsatz;

– Medizin: der geschätzte gesellschaftliche Nutzen, der sich aus dem zusätzlichen sozialen Wert ergibt, den der Verkauf solcher Produkte und Dienstleistungen für die Gesamtwirtschaft darstellt. Zuweisung im Verhältnis zur Beteiligung der Gesellschaft an der Wertschöpfungskette im Gesundheitswesen und zum Marktanteil der Gesellschaft am globalen Umsatz untergeordneter Sektoren;

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

- sozialpolitische Stabilität: der geschätzte gesellschaftliche Nutzen, den ein politisch und sozial stabiles Land bieten kann, wenn es ein günstiges Geschäftsumfeld unterstützt und Investitionen fördert, und somit zum langfristigen Wirtschaftswachstum beiträgt;
- Infrastruktur: der geschätzte Nutzen für die Gesellschaft im Zusammenhang mit Investitionen in die Infrastruktur. Zuweisung im Verhältnis zu den Infrastrukturausgaben eines Landes anhand der Daten zur Bruttokapitalbildung (BKB); und
- hohe Löhne: der geschätzte gesellschaftliche Nutzen der Entlohnung von Mitarbeitenden über dem lokalen existenzsichernden Lohn (für die Regionen, in denen sie tätig sind). Zuweisung im Verhältnis zu dem Überschuss, den Unternehmen ihren Mitarbeitenden im Vergleich zum durchschnittlichen Existenzminimum bezahlen.

Der Anlageverwalter hat die Einhaltung des Merkmals zur Aufrechterhaltung eines positiven absoluten Nachhaltigkeitswerts anhand des gewichteten durchschnittlichen Nachhaltigkeitswerts des Fonds gemäß dem von Schroders entwickelten Tool über einen gleitenden Sechsmonatszeitraum bis zum Ende des Referenzzeitraums auf der Grundlage von Monatsenddaten überwacht. Der gesamte Nachhaltigkeitsscore aggregiert die Auswirkungen von Nachhaltigkeitsindikatoren, einschließlich unter anderem Treibhausgasemissionen, Wasserverbrauch und Gehälter im Vergleich zum Existenzminimum.

Der Fonds hat auch bestimmte Ausschlüsse angewandt, deren Einhaltung der Anlageverwalter über seinen Portfolio-Compliance-Rahmen laufend überwacht hat.

● ... und im Vergleich zu früheren Zeiträumen?

Da dies unser erster Berichtszeitraum ist, kann diese Frage nicht beantwortet werden.

● **Welches waren die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie hat die nachhaltige Investition zu diesen Zielen beigetragen?**

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet hat, gilt diese Frage nicht für diesen Fonds.

● **Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, keinem der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele 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.

Sind nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform? Angaben:

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal adverse impacts, PAI) bezeichnen die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

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

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 EU-Kriterien 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 Unionskriterien 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 der vorvertraglichen Offenlegung für den 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.

Aufgrund der Art der Vermögenswerte des Fonds, bei denen es sich um Insurance Linked Securities und derivative Finanzinstrumente handelt, die ein Engagement gegenüber Katastrophenrisiken bieten, könnte der Anlageverwalter nur nachteiligen Auswirkungen auf diese Anlageklasse berücksichtigen. Der Anlageverwalter hat bestimmte Sponsoren von Transaktionen und bestimmte Risikoklassen von der Aufnahme in seine Portfolios ausgeschlossen, da er glaubt, dass sie das Potenzial haben, erhebliche nachteilige Auswirkungen auf die Gesellschaft zu verursachen.

Der Fonds hat auch 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 individueller Basis.

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



Welches waren die wichtigsten Investitionen dieses Finanzprodukts?

Während des Referenzzeitraums waren die 15 wichtigsten Investitionen:

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
VOUSSOIR_RE_JULY_2021	Finanzen	1,92	Bermuda
LION III RE DAC 21-A FRN 144A 3.83% 15 JUL 2025	Finanzen	0,72	Irland
VOUSSOIRRE_JULY_2022_SIDEAR	Finanzen	0,70	Bermuda
LAFI 2018-1A A 5.956% 25 JUL 2048	Finanzen	0,67	Vereinigte Staaten
MYSTIC RE IV LIMITED FRN 08/01/2024 A	Finanzen	0,65	Bermuda
NAKAMA RE 2018-1 CLASS 1 FRN 2% 13 APR 2023	Finanzen	0,65	Bermuda
EDEN RE II LTD B 144A 0% 20 MAR 2026	Finanzen	0,62	Bermuda
KILIMANJARO III RE LTD A FRN 144A 5.25% 25 JUN 2025	Finanzen	0,59	Bermuda
FLOODSMART RE LTD 11.25% 25 FEB 2025	Finanzen	0,55	Bermuda
URSA RE LTD 5.7562% 10 DEC 2022	Finanzen	0,55	Bermuda
CAPELOOKOUT RE_2021-1_CLASS A FRN 22/03/2024	Finanzen	0,53	Bermuda
LONGPOINT RE LTD III (144A) 3.2576% 01 JUN 2022	Finanzen	0,52	Kaimaninseln
URSA RE II LIMITED FRN 144A 6.9949% 07 DEC 2023	Finanzen	0,52	Bermuda
MERNA REINSURANCE II LIMITED FRN 05/04/2024 A 144A	Finanzen	0,50	Bermuda
PHOENICIAN RE LIMITED FRN 14/12/2023 A 144A	Finanzen	0,50	Bermuda

Die Liste enthält die Investitionen, die den größten Anteil der Anlagen des Finanzprodukts im Referenzzeitraum ausmachen, d. h. vom **1. Oktober 2021 bis 30. September 2022**

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.

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

Die größten Investitionen und % der oben genannten Vermögenswerte stammen aus der Datenquelle des Schroders Investment Book of Record (IBoR). Die größten Investitionen und die Prozentsätze für die Vermögenswerte, die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht aufgeführt sind, werden aus dem vom Administrator geführten Accounting Book of Record (ABoR) abgeleitet. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen und der unterschiedlichen Berechnungsmethoden dieser alternativen Datenquellen kann es zu geringfügigen Unterschieden zwischen den größten Investitionen und dem prozentualen Anteil der Vermögenswerte kommen.



Wie hoch war der Anteil nachhaltigkeitsbezogener Anlagen?

- *Wie gestaltete sich die Vermögensallokation?*

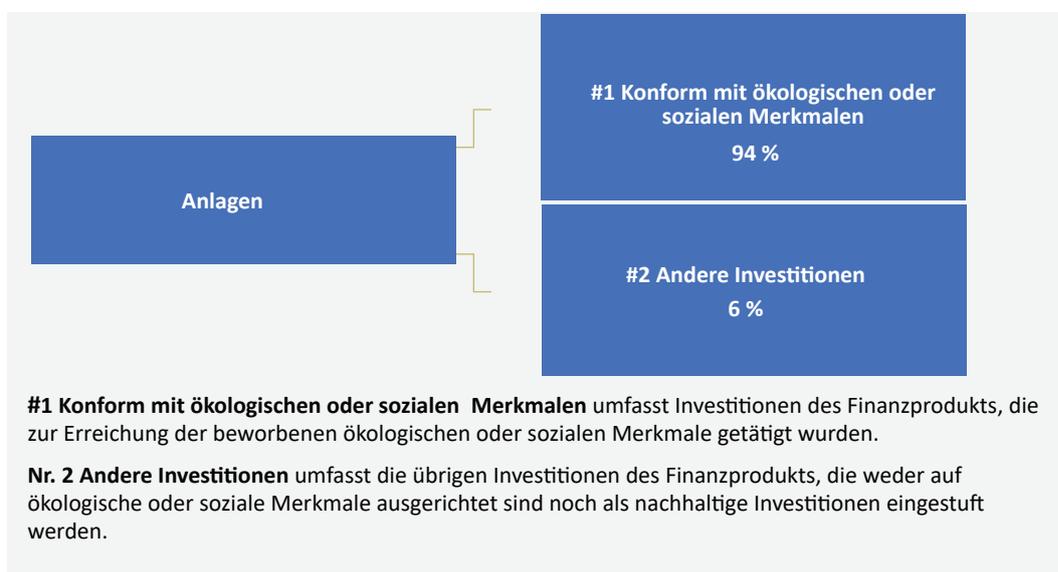
Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

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

Die Investitionen des Fonds, die zur Erfüllung seiner ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden, sind nachstehend zusammengefasst.

#1 „Konform mit ökologischen oder sozialen Merkmalen“ umfasst Vermögenswerte des Fonds, die zur Erreichung ökologischer oder sozialer Merkmale verwendet wurden, was 94 % entspricht. Dieser Prozentsatz entspricht dem Anteil der Vermögenswerte in Investitionen, die mit Naturkatastrophen und/oder Lebensrisiken verbunden sind, Investitionen, die mit meteorologischen Risiken verbunden sind, und Investitionen, die dazu bestimmt sind, das Fehlen eines wirtschaftlichen Versicherungsschutzes gegen Naturkatastrophen zu beheben. Er basiert auf dem Durchschnitt der Bestände an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums.

#2 „Andere Investitionen“ umfasst Investitionen, die zu Nachhaltigkeitszwecken als neutral behandelt wurden und bei denen es sich um Zahlungsmittel, Geldmarktinstrumente und Derivate handelte, die mit dem Ziel eingesetzt wurden, das Risiko zu reduzieren (Hedging) oder den Fonds effizienter zu verwalten.



Taxonomie-konforme Aktivitäten sind ausgedrückt als Anteil an:

- Der Umsatz spiegelt die „Grünheit“ der Unternehmen wider, in die aktuell investiert wird.
- Die Investitionsausgaben (CapEx) zeigen die grünen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, die für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevant sind.
- Die Betriebsausgaben (OpEx) spiegeln die grünen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, wider.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Im Referenzzeitraum wurden in den folgenden Wirtschaftszweigen Investitionen getätigt:

Sektor	In % der Vermögenswerte
Finanzen	93,61
Barmittel	4,03
Supranational	2,30
Derivate	0,05

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

Der prozentuale Anteil der Vermögenswerte, die mit den oben erwähnten Wirtschaftszweigen konform sind, wird aus der Datenquelle des Schroders Investment Book of Record (IBoR) abgeleitet. Der Prozentsatz der Vermögenswerte, die mit

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

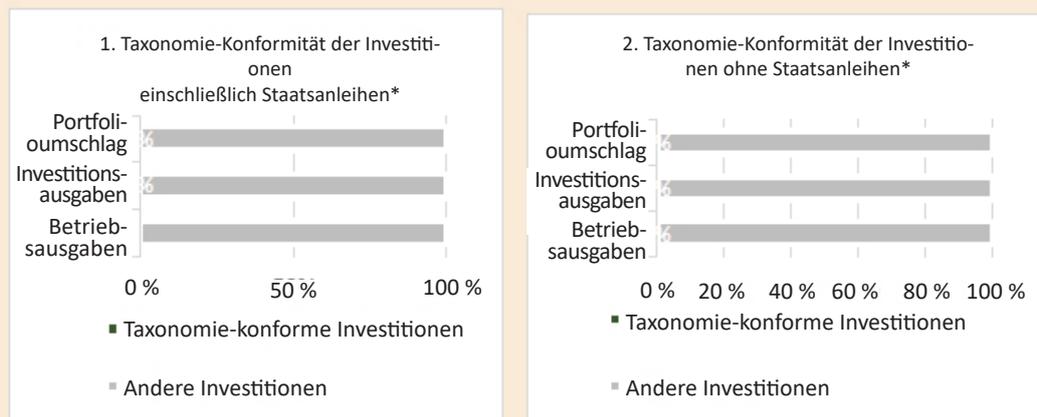
Wirtschaftszweigen konform sind, die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht aufgeführt sind, werden aus dem vom Administrator geführten Book of Record (ABoR) abgeleitet. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen und der unterschiedlichen Berechnungsmethoden dieser alternativen Datenquellen kann es zu geringfügigen Unterschieden in Bezug auf den Prozentsatz der mit den Wirtschaftssektoren konformen Vermögenswerte kommen.



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

Es war nicht ersichtlich, inwieweit die Investitionen des Fonds (einschließlich Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten) mit einem Umweltziel taxonomiekonform waren. Die Taxonomie-Konformität der Investitionen dieses Fonds wurde daher nicht berechnet und infolgedessen mit 0 % des Fondsportfolios eingestuft.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie konform waren. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt das erste Diagramm die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts, einschließlich Staatsanleihen, während das zweite Diagramm die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf andere Investitionen des Finanzprodukts als Staatsanleihen zeigt.*



*Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Engagements bei staatlichen Emittenten.

- **Wie hoch war der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten?**

Wie oben erwähnt, wird der Anteil der Investitionen des Fonds in die Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten mit 0 % des Fondsportfolios eingestuft.

- **Wie hoch war der prozentuale Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren, im Vergleich zu früheren Referenzzeiträumen?**

Da dies unser erster Berichtszeitraum ist, kann diese Frage nicht beantwortet werden.



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

Ermöglichende Tätigkeiten sind direkte Wegbereiter für andere Tätigkeiten, einen wesentlichen Beitrag zu einem ökologischen Ziel leisten.

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

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

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet hat, gilt diese Frage nicht für diesen Fonds.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet hat, gilt diese Frage nicht für diesen Fonds.



Welche Investitionen fallen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

#2 „Andere Investitionen“ umfasst Investitionen, die zu Nachhaltigkeitszwecken als neutral behandelt wurden und bei denen es sich um Zahlungsmittel, Geldmarktinstrumente und Derivate handelte, die mit dem Ziel eingesetzt wurden, das Risiko zu reduzieren (Hedging) oder den Fonds effizienter zu verwalten.

Gegebenenfalls wurden Mindestschutzmaßnahmen für Geldmarktinstrumente und Derivate angewandt, die zur Risikominderung (Hedging) oder für andere Investitionen eingesetzt werden, indem (gegebenenfalls) Investitionen in Kontrahenten eingeschränkt wurden, die mit Ländern mit höherem Risiko verbunden oder dort engagiert sind (im Hinblick auf Geldwäsche, Terrorismusfinanzierung, Bestechung, Korruption, Steuerhinterziehung und Sanktionsrisiken). Bei einer unternehmensweiten Risikobewertung wird die Risikoeinstufung der einzelnen Rechtsordnungen berücksichtigt, wobei auf eine Reihe öffentlicher Erklärungen, Indizes und Indikatoren für die Weltordnungspolitik verwiesen wird, die von den Vereinten Nationen, der Europäischen Union, der Regierung des Vereinigten Königreichs, der Financial Action Task Force und mehreren Nichtregierungsorganisationen (NGOs) wie Transparency International und dem Basler Ausschuss herausgegeben wurden.

Darüber hinaus wurden neue Kontrahenten durch Schroders eigenes Kreditrisikoteam überprüft, und die Genehmigung eines neuen Kontrahenten basierte auf einer ganzheitlichen Überprüfung der verschiedenen verfügbaren Informationsquellen, einschließlich unter anderem der Qualität des Managements, der Eigentümerstruktur, des Standorts, des regulatorischen und sozialen Umfelds, dem jeder Kontrahent unterliegt, und des Entwicklungsgrads des lokalen Bankensystems und seines regulatorischen Rahmens. Die laufende Überwachung erfolgte mithilfe eines von Schroders entwickelten Tools, das die Analyse der Fähigkeit eines Kontrahenten, Trends und Herausforderungen in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung zu steuern, unterstützt.

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



Welche Maßnahmen wurden ergriffen, um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erfüllen?

Im Referenzzeitraum wurden folgende Maßnahmen ergriffen, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen:

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

- der Anlageverwalter hat bei der Auswahl der Anlagen für den Fonds Nachhaltigkeitskriterien angewandt;
- der Anlageverwalter hat bei der Auswahl der vom Fonds gehaltenen Vermögenswerte die Nachhaltigkeitsbewertungen des Fonds und der einzelnen Anlagen berücksichtigt; und
- der Anlageverwalter hat die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Anlagen des Fonds bewertet.



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

Es wurde kein Index als Benchmark festgelegt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

- **Wie unterscheidet 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, um die Übereinstimmung der Benchmark mit den beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen zu bestimmen?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

- **Wie hat sich dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Benchmark entwickelt?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

- **Wie hat sich dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex entwickelt?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

Benchmarks sind Indizes, an denen gemessen wird, ob ein Finanzprodukt die von ihm beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

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

Produktname: **Schroder GAIA Helix**

Unternehmenskennung (LEI-Code): **549300HTRQHGX6XKWC51**

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Hatte dieses Finanzprodukt ein nachhaltiges Anlageziel?

Ja

Nein

Es hat **nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt:** ___%

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

Es hat **nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt:** ___%

Es wurden damit **ökologische/soziale Merkmale beworben**, und obwohl es keine nachhaltigen Investitionen angestrebt hat, enthielt es einen Anteil von 52 % an nachhaltigen Investitionen

mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie 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 hat ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

Der prozentuale Anteil der dargestellten nachhaltigen Investitionen (bei denen es sich allesamt um Long-Positionen handelt, da Short-Positionen nicht als nachhaltige Investitionen gelten) entspricht dem Anteil der nachhaltigen Anlagen am Long-Engagement des Fonds am Ende des Referenzzeitraums. Dies steht im Einklang mit der vorvertraglichen Offenlegung für den Fonds, wo sich der Fonds verpflichtet hat, mindestens 35 % seines langfristigen Engagements in nachhaltige Anlagen zu investieren. Im Verhältnis zum Bruttoengagement des Fonds betrug der Anteil nachhaltiger Investitionen am Ende des Referenzzeitraums 26 %. Das Bruttoengagement umfasst sowohl Long- als auch Short-Positionen. Diese Zahl dient der Konsistenz mit den anderen Berechnungen im folgenden Abschnitt „Vermögensallokation“.

Eine **nachhaltige Anlage** ist ein Investment in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines ökologischen oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt dass diese Anlage keine wesentlichen nachteiligen Auswirkungen auf ökologische oder soziale Ziele hat und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

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

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 weist 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. Es liefert eine Schätzung der tatsächlichen „Auswirkungen“, die ein Emittent in Bezug auf soziale und ökologische „Kosten“ oder „Vorteile“ verursachen könnte. Dazu werden bestimmte Indikatoren in Bezug auf diesen Emittenten verwendet und positiv und negativ quantifiziert, um eine aggregierte fiktive Kennzahl für die Auswirkungen zu erstellen, die der jeweils zugrunde liegende Emittent 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, und zwar als fiktiver Prozentsatz (positiv oder negativ) des Umsatzes oder BIP des jeweiligen zugrunde liegenden Emittenten. Ein Score von +2 % würde beispielsweise bedeuten, dass ein Emittent pro 100 USD Umsatz oder BIP 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 Emittenten (einschließlich gegebenenfalls auf transparenter Basis für Indizes und Wertpapierkörbe) im Portfolio des Fonds, die mit dem firmeneigenen Tool von Schroders gemessen werden. Die Long- und Short-Positionen des Fonds tragen unterschiedlich zum Gesamtwert bei. Long-Positionen mit positiven Bewertungen und Short-Positionen mit negativen Bewertungen tragen positiv zum Gesamtwert bei, während Long-Positionen mit negativen Bewertungen und Short-Positionen mit positiven Bewertungen den Gesamtwert schmälern.

Der Referenzzeitraum für diesen Fonds ist der 1. Oktober 2021 bis 30. September 2022.

Der Fonds hat in großem Umfang Derivate eingesetzt, um seine Anlagestrategie umzusetzen und die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erfüllen. Long- und Short-Derivatpositionen trugen, wie beschrieben, unterschiedlich zum Gesamtnachhaltigkeitswert des Fonds bei. Aktien- und Indexderivate (ohne Optionen) werden genauso bewertet wie physische Bestände, und zwar auf der Grundlage eines „Look-through“-Verfahrens, und trugen auch zum Gesamt-Nachhaltigkeitswert des Fonds bei.

Der Fonds investierte seit Inkrafttreten dieser Verpflichtung im August 2022 bis zum Ende des Referenzzeitraums außerdem mindestens 35 % seines langfristigen Engagements in nachhaltige Investitionen.

● **Wie haben sich die Nachhaltigkeitsindikatoren entwickelt?**

Der positive absolute Nachhaltigkeitswert für den Referenzzeitraum betrug 8,8 %

Der Nachhaltigkeitswert wird wie vorstehend beschrieben als fiktiver Prozentsatz berechnet.

Wie am Ende des Referenzzeitraums mit dem von Schroders entwickelten Tool gemessen, waren die fünf wichtigsten Indikatoren, die positiv zum Nachhaltigkeitswert des Fonds beigetragen haben:

– Vermiedene Emissionen: der geschätzte ökologische Nutzen von Unternehmen, die eine system- oder wirtschaftsweite Verringerung der CO₂-Emissionen ermöglichen;

– CO₂-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;

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

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

– CO₂-Emissionen Scope 3: die geschätzten Umweltkosten von Scope-3-Treibhausgasemissionen (THG) im Zusammenhang mit dem Klimawandel. Scope-3-Emissionen stellen die indirekten Emissionen eines Unternehmens dar, z. B. Geschäftsreisen, Lieferungen, Pendeln oder Abfälle aus einer Lieferkette eines Unternehmens;

– Verhütung: der geschätzte gesellschaftliche Nutzen aus der Produktion und dem Angebot von Verhütungsmitteln. Zuweisung im Verhältnis zum Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz; und

– Tabak: die geschätzten gesellschaftlichen Kosten des Rauchens (wird Tabakherstellern zugeordnet). Zuweisung im Verhältnis zum Marktanteil des Unternehmens am Gesamtumsatz.

Tabak, Scope 1-CO₂-Emissionen bzw. Scope 3-CO₂-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 Gesamt-Nachhaltigkeitswert des Fonds bei.

Der Anlageverwalter hat die Einhaltung des Merkmals zur Aufrechterhaltung eines positiven absoluten Nachhaltigkeitswerts anhand des gewichteten durchschnittlichen Nachhaltigkeitswerts des Fonds gemäß dem von Schroders entwickelten Tool über einen gleitenden Sechsmonatszeitraum bis zum Ende des Referenzzeitraums auf der Grundlage von Monatsenddaten überwacht. Der gesamte Nachhaltigkeitsscore aggregiert die Auswirkungen von Nachhaltigkeitsindikatoren, einschließlich unter anderem Treibhausgasemissionen, Wasserverbrauch und Gehälter im Vergleich zum Existenzminimum.

Wie zum Ende des Referenzzeitraums gemessen, investierte der Anlageverwalter 26 % des Fonds-Bruttoengagements in nachhaltige Investitionen. Dies entspricht dem prozentualen Anteil nachhaltiger Investitionen (bei denen es sich um Long-Positionen handelt, da Short-Positionen nicht als nachhaltige Investitionen gelten) am Bruttoengagement des Fonds. Das Bruttoengagement umfasst sowohl Long- als auch Short-Positionen, und diese Zahl dient der Einheitlichkeit auf Basis der Berechnungen im folgenden Abschnitt „Vermögensallokation“. Der Fonds verpflichtete sich jedoch, mindestens 35 % seines Long-Engagements in nachhaltige Anlagen zu investieren, wobei der Nachhaltigkeitswert jedes Vermögenswerts in dem vom Schroders entwickelten Tool zugrunde gelegt wird. Im Einklang mit dieser Verpflichtung legte der Fonds 52 % seines Long-Engagements in nachhaltigen Investitionen an (gemessen am Ende des Referenzzeitraums).

Der Fonds hat auch bestimmte Ausschlüsse angewandt, deren Einhaltung der Anlageverwalter über seinen Portfolio-Compliance-Rahmen laufend überwacht hat.

● **... und im Vergleich zu früheren Zeiträumen?**

Da dies unser erster Berichtszeitraum ist, kann diese Frage nicht beantwortet werden.

● **Welches waren die Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, und wie hat die nachhaltige Investition zu diesen Zielen beigetragen?**

In Bezug auf den Anteil des Long-Portfolios des Fonds, der in nachhaltigen Investitionen angelegt wurde, zeigte jede nachhaltige Investition einen positiven Nettoeffekt auf ein oder mehrere ökologische oder soziale Ziele, wie sie von Schroders eigenem Tool bewertet wurden. Die ökologischen und sozialen Ziele der nachhaltigen Investitionen, die mit dem Fonds getätigt wurden, umfassten unter anderem:

– Erhöhung der Sozialleistungen durch:

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

- Konnektivität: der geschätzte gesellschaftliche Nutzen von Unternehmen, die die Verbindung von Gemeinschaften durch Telekommunikationsdienste ermöglichen und/oder unterstützen. Zuweisung im Verhältnis zum geschätzten globalen Nutzen des Zugangs zu globalen Kommunikationstechnologien und Zuweisung dieses Nutzens an einzelne Unternehmen auf der Grundlage ihres Anteils an den weltweiten Einnahmen aus Telekommunikations- und Internetkonnektivitätsmärkten, einschließlich Social-Media-Unternehmen;
- Verhütung: der geschätzte gesellschaftliche Nutzen aus der Produktion und dem Angebot von Verhütungsmitteln. Zuweisung im Verhältnis zum Marktanteil der Gesellschaft am weltweiten Umsatz;
- Spenden: der geschätzte gesellschaftliche Nutzen der philanthropischen Spenden von Unternehmen. Gemessen auf der Grundlage des Geldwerts der gespendeten Summe;
- Höhere Löhne: der geschätzte gesellschaftliche Nutzen der Bezahlung von Mitarbeitenden über den lokalen existenzsichernden Löhnen (für die Regionen, in denen sie tätig sind). Zuweisung im Verhältnis zu dem Überschuss, den Unternehmen ihren Mitarbeitenden im Vergleich zum durchschnittlichen Existenzminimum bezahlen. und
- Steigerung des Umweltnutzens durch:
 - vermiedene Emissionen: der geschätzte ökologische Nutzen von Unternehmen, die eine systemische oder gesamtwirtschaftliche Verringerung der CO₂-Emissionen ermöglichen.

Die oben genannten Beispiele für ökologische und soziale Ziele der nachhaltigen Investitionen, die der Fonds getätigt hat, basieren auf Daten zum Ende des Referenzzeitraums. Andere Ziele könnten während des Referenzzeitraums angewandt worden sein.

Inwiefern haben die nachhaltigen Investitionen, die mit dem Finanzprodukt teilweise getätigt wurden, keinem der ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlageziele erheblich geschadet?

Der Ansatz des Anlageverwalters zur Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen ökologischer oder sozialer nachhaltiger Anlageziele beinhaltet Folgendes:

- unternehmensweite Ausschlüsse 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 UN Global Compact (UNGC) unterzeichnet. Der Fonds hat Unternehmen, die gegen die Grundsätze der Global Compact-Initiative der Vereinten Nationen (UNGC-Grundsätze) verstoßen, aus dem Anteil des Portfolios an nachhaltigen Investitionen ausgeschlossen, da Schroders der Ansicht ist, dass Verstöße ein oder mehrere ökologisch oder sozial nachhaltige Investitionsziele erheblich beeinträchtigen. Zu den Bereichen, die darüber entscheiden, ob ein Emittent gegen den UNGC verstößt, gehören Themen, die von den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte abgedeckt werden, wie Menschenrechte, Bestechung und Korruption, Arbeitsrechte, Kinderarbeit, Diskriminierung, Gesundheit und Sicherheit sowie Tarifverhandlungen. Die Liste der Verletzer der UNGC-Grundsätze wird von einem Dritten bereitgestellt und die Einhaltung der Liste wurde durch unsere automatisierten Compliance-Kontrollen überwacht.

Weitere Informationen zu allen Ausschlüssen des Fonds finden Sie unter „Informationen zur Nachhaltigkeit“ auf der Website des Fonds unter www.schroders.com/en/lu/private-investor/gfc.

Die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen bezeichnen die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

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

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

In den Fällen, in denen der Anlageverwalter Schwellenwerte in Bezug auf die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren festgelegt hat, wurde die Einhaltung dieser Schwellenwerte laufend über seinen Portfolio-Compliance-Rahmen überwacht. Für Investitionen verfügbare Unternehmen, die diese Werte nicht eingehalten haben, wurden nicht als nachhaltige Investition zugelassen.

Beispielsweise schloss der Fonds Unternehmen, die gegen die UNGC-Grundsätze (PAI 10) verstoßen, aus dem Anteil des Portfolios an nachhaltigen Investitionen aus. Die Liste der Verletzer der UNGC-Grundsätze wird von einem Dritten bereitgestellt und die Einhaltung der Liste wurde durch unsere automatisierten Compliance-Kontrollen überwacht.

In anderen Bereichen hat der Anlageverwalter (auch indirekt über die Verwalter der zugrunde liegenden Strategien) Grundsätze für das Engagements festgelegt. Wir haben jeden der PAI-Indikatoren auf eines der sechs Kernthemen des Engagements von Schroders ausgerichtet. Wir fassen nachstehend die geltenden Schwellenwerte und die Engagement-Maßnahmen, die wir für jeden PAI haben, zusammen:

Klimawandel:

Die PAIs 1, 2, 3, 4, 5, 6 und 19 beziehen sich auf die Blaupause für das Engagement zum Thema „Klimawandel“. Nähere Informationen zu unserer Blaupause für Engagements finden Sie hier: (Link <https://prod.schroders.com/en/sysglobalassets/about-us/schroders-engagement-blueprint-2022.pdf>). Wir engagieren uns, um zu verstehen, wie Unternehmen auf die Herausforderungen reagieren, die der Klimawandel für ihre langfristige Finanzlage darstellen kann. Durch aktives Engagement versuchen wir, verschiedene Bereiche zu verstehen, wie zum Beispiel die Geschwindigkeit und das Ausmaß der Emissionsreduktionsziele und die Schritte, die unternommen werden, um die Klimaziele zu erreichen.

Biodiversität und natürliche Ressourcen:

Die PAIs 7, 8 und 9 entsprechen der Blaupause für das Engagement zum Thema „Biodiversität und natürliche Ressourcen“. Wir erkennen an, wie wichtig es ist, dass alle Unternehmen ihre Risiken in Bezug auf natürliche Ressourcen und Biodiversität bewerten und darüber berichten. Wir konzentrieren unser Engagement auf eine verbesserte Transparenz bei verschiedenen Themen wie Abholzung, nachhaltige Ernährung und Wasser.

Menschenrechte:

Die PAIs 10 und 14 beziehen sich auf die Blaupause für das Engagement zum Thema „Menschenrechte“. Der Druck auf die Rolle, die Unternehmen bei der Achtung der Menschenrechte spielen können und sollten, nimmt zu. Wir verstehen die höheren operationellen und finanziellen Risiken und das Reputationsrisiko, das Streitigkeiten in Menschenrechtsfragen verursachen. Unser Engagement konzentriert sich auf drei zentrale Interessengruppen: Arbeitnehmer, Gemeinden und Kunden.

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

Umgang mit Humankapital:

Die PAIs 11, 12 und 13 orientieren sich an der Blaupause für das Engagement zum Thema „Umgang mit Humankapital“. Wir betrachten den Umgang mit Humankapital als ein vorrangiges Thema für das Engagement, da die Menschen in einem Unternehmen eine wichtige Quelle für Wettbewerbsvorteile sind und ein effektives Personalwesen von wesentlicher Bedeutung ist, um Innovationen und langfristige Wertschöpfung zu fördern. Wir erkennen zudem eine Reihe von Zusammenhängen zwischen hohen Standards beim Umgang mit Humankapital und der Erreichung der SDGs. Unsere Engagement-Aktivitäten befassen sich mit Themen wie Gesundheit und Sicherheit, Unternehmenskultur und Investitionen in die Belegschaft.

Diversität und Inklusion:

Die PAIs 12 und 13 beziehen sich auf die Blaupause für das Engagement zum Thema „Diversität und Inklusion“. Eine verbesserte Transparenz der Angaben zur Diversität im Vorstand und zum geschlechtsspezifischen Lohngefälle sind zwei der vorrangigen Ziele, die in unserem Engagement-Blaupause beschrieben sind. Wir fordern die Unternehmen auf, eine Richtlinie einzuführen, der zufolge bei jeder freien Stelle im Vorstand mindestens ein oder mehrere diverse Kandidaten berücksichtigt werden müssen. Unser Engagement-Ansatz berücksichtigt auch die Diversität in der Geschäftsführung, Belegschaft und Wertschöpfungskette.

Unternehmensführung (Corporate Governance):

Die PAIs 20, 12 und 13 entsprechen der Blaupause für das Engagement zum Thema „Corporate Governance“. Wir arbeiten mit Unternehmen zusammen, um sicherzustellen, dass die Geschäfte im besten Interesse der Aktionäre und anderer wichtiger Stakeholder geführt werden. Wir sind uns auch darüber im Klaren, dass in den meisten Fällen erst starke Governance-Strukturen vorhanden sein müssen, um Fortschritte und Leistungen bei anderen wichtigen ESG-Themen zu erzielen. Wir befassen uns daher mit verschiedenen Aspekten der Unternehmensführung, wie z. B. der Vergütung von Führungskräften, dem Vorstand und dem Management sowie der Strategie.

Sind nachhaltige Investitionen mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte konform? Angaben:

Wir haben eine Liste von Unternehmen, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen verwendet, die uns ein externer Anbieter zur Verfügung gestellt hat. Emittenten auf dieser Liste wurden nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft. Zu den Bereichen, die bestimmen, ob ein Emittent gegen die UNGC-Grundsätze verstößt, gehörten die Themen, die von den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte abgedeckt werden, wie Menschenrechte, Bestechung und Korruption, Arbeitnehmerrechte, Kinderarbeit, Diskriminierung, Gesundheitsschutz und Sicherheit sowie Tarifverhandlungen.

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

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 EU-Kriterien 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 Unionskriterien 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 Ansatz des Anlageverwalters zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren umfasste die Klassifizierung der Indikatoren in drei Kategorien:

1. Schwellenwerte festlegen: Für bestimmte PAI (z. B. PAI 10 zu Verstößen gegen die UNGC-Grundsätze) legen wir Schwellenwerte für die Einstufung einer Investition als nachhaltige Investition fest. Investitionen, die gegen diese Schwellenwerte verstoßen, können nicht als nachhaltige Investitionen gehalten werden. Die Einhaltung dieser Schwellenwerte wurde laufend über den Portfolio-Compliance-Rahmen des Anlageverwalters überwacht.
2. Aktive Eigentümerschaft: Während des Referenzzeitraums engagierte sich der Anlageverwalter (auch indirekt über die Verwalter der zugrunde liegenden Strategien) in den zugrunde liegenden Beteiligungen im Einklang mit unserem Ansatz und unseren Erwartungen, die in unserer Engagement-Blaupause (Link <https://prod.schroders.com/en/sysglobalassets/about-us/schroders-engagement-blueprint-2022.pdf>) und wie weiter oben beschrieben. Eine Zusammenfassung der unternehmensweiten Engagement-Aktivitäten von Schroders während des Referenzzeitraums, einschließlich des entsprechenden Engagement-Themas, ist nachstehend aufgeführt:

Engagement-Thema	# Emittenten
Klimawandel	545
Diversität und Inklusion	152
Governance und Aufsicht	3.130
Umgang mit Humankapital	61
Menschenrechte	105
Natürliche Ressourcen und Biodiversität	81

3. Verbesserte Berichterstattung: Einige der in der vorstehenden Tabelle genannten Engagements brachten Diskussionen mit sich, die sich vor allem auf die Verbesserung der Berichterstattung über Nachhaltigkeitsdaten konzentrierten. Der Zweck besteht darin, die Abdeckung der PAI-Indikatoren zu verbessern, z. B. PAI 9 zur Quote gefährlicher Abfälle.

Unser Ansatz wird laufend überprüft, insbesondere da sich die Verfügbarkeit und Qualität von PAI-Daten weiterentwickelt.

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



Welches waren die wichtigsten Investitionen dieses Finanzprodukts?

Die 15 wichtigsten Investitionen im Referenzzeitraum, basierend auf dem Nettoengagement (in % des NIW), waren:

Größte Investitionen	Sektor	% Vermögenswerte (netto)	Land
HDFC BANK LTD	Finanzen	1,56	Indien
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	Informationstechnologie	1,29	Taiwan, Republic of China
AIA GROUP LTD	Finanzen	1,25	Hong Kong, SAR China
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	Informationstechnologie	1,16	Südkorea
MIDEA GROUP CO LTD	Zyklische Konsumgüter	1,08	China
BANK MANDIRI (PERSERO) TBK PT	Finanzen	0,88	Indonesien
LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD	Informationstechnologie	0,83	China
UDR INC	Immobilien	0,80	USA
RELX PLC	Industriewerte	0,77	Vereinigtes Königreich
KASIKORNBANK PCL	Finanzen	0,74	Thailand
TEXAS INSTRUMENTS INC	Informationstechnologie	0,72	USA
MEDIATEK INC	Informationstechnologie	0,67	Taiwan, Republic of China
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	Finanzen	0,67	China
STANDARD CHARTERED PLC	Finanzen	0,67	Vereinigtes Königreich
BOOKING HOLDINGS INC	Zyklische Konsumgüter	0,66	USA

Die obige Liste stellt das durchschnittliche Nettoengagement des Fonds in % des Nettoinventarwerts an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums dar.

Es wurden auf Look-Through-Basis Engagements für Index-Futures, Index-Optionen, TRS-Positionen und CFD-Körbe bereitgestellt und auf Emittentenebene verrechnet. Es kann Fälle geben, in denen ein Schätzwert verwendet wurde.

Die oben erwähnten größten Investitionen und Prozentsätze des Nettoinventarwerts stammen aus der Datenquelle des Schroders Investment Book of Record (IBoR). Die größten Investitionen und Prozentsätze des Nettoinventarwerts, die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht aufgeführt sind, werden aus dem vom Administrator geführten Accounting Book of Record (ABoR) abgeleitet. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen und der unterschiedlichen Berechnungsmethoden dieser alternativen Datenquellen kann es zu Unterschieden zwischen den größten Investitionen und dem Prozentsatz des Nettoinventarwerts kommen.

Die Liste enthält die Investitionen, die den größten Anteil der Anlagen des Finanzprodukts im Referenzzeitraum ausmachen, d. h. vom 1. Oktober 2021 bis 30. September 2022

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



Wie hoch war der Anteil nachhaltigkeitsbezogener Anlagen?

● *Wie gestaltete sich die Vermögensallokation?*

Die Investitionen des Fonds, die zur Erfüllung seiner ökologischen oder sozialen Merkmale verwendet wurden, sind nachstehend zusammengefasst.

#1 „Konform mit ökologischen oder sozialen Merkmalen“ umfasst die Vermögenswerte des Fonds, die zur Erreichung ökologischer oder sozialer Merkmale verwendet wurden, die am Ende des Referenzzeitraums 96 % des Bruttoengagements entsprachen. Der Fonds weist einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert auf. Daher werden die Investitionen des Fonds (sowohl Long- als auch Short-Positionen), die mit dem von Schroders entwickelten Nachhaltigkeitstool bewertet wurden, auf der Grundlage, dass sie zum Nachhaltigkeitswert des Fonds beigetragen haben (unabhängig davon, ob eine solche Einzelanlage einen positiven oder einen negativen Wert hatte), in #1 aufgenommen. 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. Innerhalb von #1 ist auch der Anteil des Bruttoengagements enthalten, der in nachhaltigen Investitionen angelegt wurde, wie in #1A angegeben.

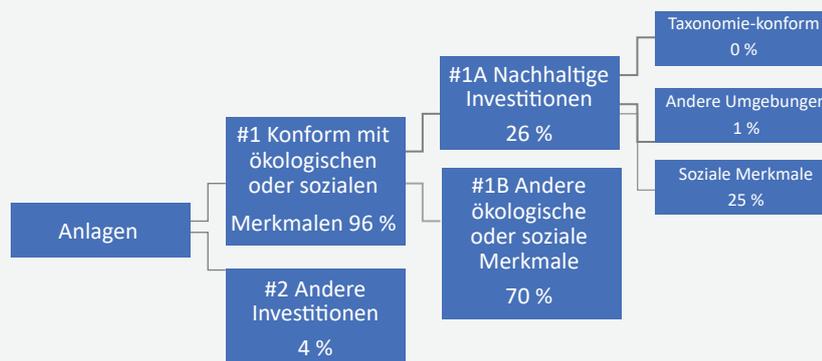
Der Nachhaltigkeitswert wird von einem von Schroders entwickelten Tool gemessen. Es liefert eine Schätzung der tatsächlichen „Auswirkungen“, die ein Emittent in Bezug auf soziale und ökologische „Kosten“ oder „Vorteile“ verursachen könnte. Dazu werden bestimmte Indikatoren in Bezug auf diesen Emittenten verwendet und positiv und negativ quantifiziert, um eine aggregierte fiktive Kennzahl für die Auswirkungen zu erstellen, die der jeweils zugrunde liegende Emittent auf die Gesellschaft und die Umwelt haben kann. Beispiele für solche Indikatoren sind Treibhausgasemissionen, Wasserverbrauch und Löhne im Vergleich zum existenzsichernden Lohn.

Wie zum Ende des Referenzzeitraums gemessen, investierte der Fonds 26 % seines Bruttoengagements in nachhaltige Investitionen. Das Bruttoengagement umfasst sowohl Long- als auch Short-Positionen, aber der Prozentsatz umfasst nur Long-Positionen, da Short-Positionen nicht als nachhaltige Anlagen gelten. Davon wurden 1 % in nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel und 25 % in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel investiert. Der Fonds verpflichtete sich jedoch, mindestens 35 % seiner Long-Positionen in nachhaltigen Investitionen anzulegen. Am Ende des Referenzzeitraums investierte der Fonds 52 % seines langfristigen Engagements in nachhaltige Investitionen. Davon wurden 2 % in nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel und 51 % in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel investiert. (Bitte beachten Sie, dass diese Prozentsätze aufgrund von Rundungen nicht 52 % betragen).

#2 „Andere Investitionen“ umfasst Investitionen, die zu Nachhaltigkeitszwecken als neutral behandelt wurden und bei denen es sich um Zahlungsmittel, Geldmarktinstrumente und Optionen handelte. Zu #2 gehören auch Investitionen, die nicht mit den eigenen Nachhaltigkeitstools des Anlageverwalters bewertet wurden und somit nicht zum Nachhaltigkeitsscore des Fonds beigetragen haben.

Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

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.

Die Kategorie #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst folgende Unterkategorien:

- Die Unterkategorie #1A Nachhaltige Investitionen umfasst ökologisch und sozial nachhaltige Investitionen.
- Die Unterkategorie #1B Andere ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen, die auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind, aber nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden.

Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

– Der **Umsatz** spiegelt die „Grünheit“ der Unternehmen wider, in die investiert wird.

– Die **Investitionsausgaben** (CapEX) zeigen die grünen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, die für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft relevant sind.

– Die **Betriebsausgaben** (OpEx) spiegeln die umweltfreundlichen Betriebsausgaben der Unternehmen, in die investiert wird, wider.

Die oben angegebenen Prozentsätze werden aus Gründen der Einheitlichkeit als Anteil des Bruttoengagements berechnet. Der Fonds verpflichtete sich jedoch, mindestens 35 % seines langfristigen Engagements in nachhaltige Investitionen zu investieren. Am Ende des Referenzzeitraums investierte der Fonds 52 % seiner Long-Positionen in nachhaltige Investitionen.

Es wurden auf Look-Through-Basis Engagements für Index-Futures, Index-Optionen, TRS-Positionen und CFD-Körbe bereitgestellt und auf Emittentenebene verrechnet. Es kann Fälle geben, in denen ein Schätzwert verwendet wurde. Diese Verrechnung erfolgte, bevor festgestellt wurde, ob es sich bei einem Engagement um eine Long- oder Short-Position handelte, und bevor das Bruttoengagement berechnet wurde.

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Im Referenzzeitraum wurden in den folgenden Wirtschaftszweigen Investitionen auf Basis des Brutto- und Netto-Engagements (in % des NIW) getätigt:

Sektor	% der Vermögenswerte (brutto)	% Vermögenswerte (netto)
Kommunikationsdienste	15,53	1,59
Zyklische Konsumgüter	35,76	1,88
Basiskonsumgüter	16,79	-2,65
Energie	9,19	0,86
Finanzen	43,60	-0,21
Gesundheitswesen	18,41	1,11
Inhaltsverzeichnis	1,89	-1,89
Industriewerte	41,74	2,78
Informationstechnologie	35,66	4,85

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

Zinssätze/Staatsanleihen	0,65	0,56
Grundstoffe	17,67	-3,24
Immobilien	28,60	-2,47
Verbriefungen	1,14	1,14
Versorger	5,81	-3,03

Ermöglichende Tätigkeiten sind direkte Wegbereiter für andere Tätigkeiten, einen wesentlichen Beitrag zu einem ökologischen Ziel leisten.

Übergangstätigkeiten sind Aktivitäten, für die noch keine kohlenstoffarmen Alternativen verfügbar sind und die unter anderem Treibhausgasemissionswerte haben, die der besten Leistung entsprechen.

Die obige Liste basiert auf dem Durchschnitt des Brutto- und Nettoengagement des Fonds in % des Nettoinventarwerts 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. Es kann Fälle geben, in denen ein Schätzwert verwendet wurde.

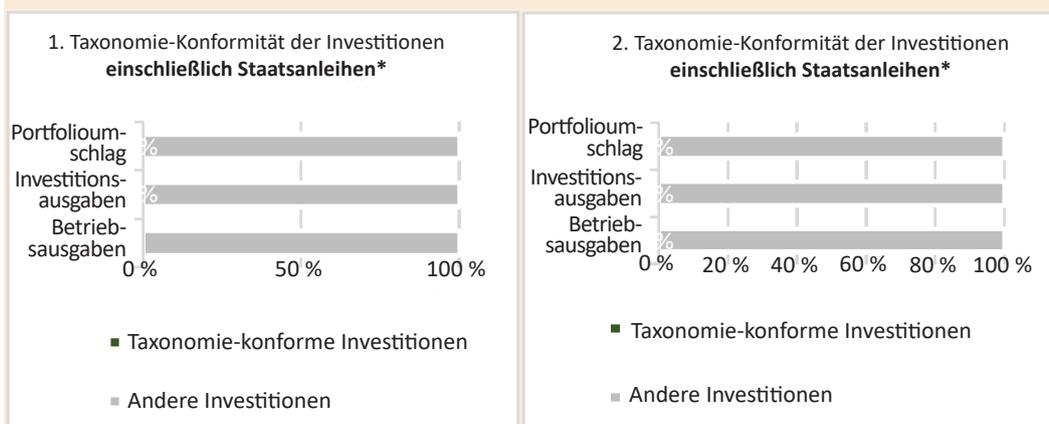
Der Prozentsatz des NIW, der mit den oben erwähnten Wirtschaftszweigen konform ist, wird aus der Datenquelle des Schroders Investment Book of Record (IBoR) abgeleitet. Der Prozentsatz des Nettoinventarwerts, der mit den Wirtschaftszweigen konform ist, die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht aufgeführt sind, wird aus dem vom Administrator geführten Accounting Book of Record (ABoR) abgeleitet. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen und der unterschiedlichen Berechnungsmethoden dieser alternativen Datenquellen kann es zu Unterschieden in Bezug auf den Prozentsatz des mit den Wirtschaftssektoren konformen Nettoinventarwerts kommen.



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

Es war nicht ersichtlich, inwieweit die Investitionen des Fonds (einschließlich Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten) mit einem Umweltziel taxonomiekonform waren. Die Taxonomie-Konformität der Investitionen dieses Fonds wurde daher nicht berechnet und infolgedessen mit 0 % des Fondsportfolios eingestuft.

In den nachstehenden Diagrammen ist in Grün der Prozentsatz der Investitionen zu sehen, die mit der EU-Taxonomie in Einklang gebracht wurden. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomie-Konformität von Staatsanleihen gibt, zeigt das erste Diagramm die Taxonomie-Konformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts, einschließlich Staatsanleihen, während das zweite Diagramm die Taxonomie-Konformität nur in Bezug auf andere Investitionen des Finanzprodukts als Staatsanleihen zeigt.*



*Für die Zwecke dieser Diagramme umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Engagements bei staatlichen Emittenten.

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

- **Wie hoch war der Anteil der Investitionen in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden Tätigkeiten?**

Wie oben erwähnt, wird der Anteil der Investitionen des Fonds in die Übergangs- und ermöglichenden Tätigkeiten mit 0 % des Fondsportfolios eingestuft.

- **Wie hoch war der prozentuale Anteil der Investitionen, die mit der EU-Taxonomie konform waren, im Vergleich zu früheren Referenzzeiträumen?**

Da dies unser erster Berichtszeitraum ist, kann diese Frage nicht beantwortet werden.



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

Zum Ende des Referenzzeitraums investierte der Fonds 1 % seines Bruttoengagements in nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht taxonomiekonform sind. Dieser Prozentsatz wird aus Gründen der Einheitlichkeit auf der Grundlage der Berechnungen im obigen Abschnitt „Vermögensallokation“ angegeben. Der Fonds investierte 2 % seines langfristigen Engagements in nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel, die nicht mit der Taxonomie konform sind.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Zum Ende des Referenzzeitraums investierte der Fonds 25 % seines Bruttoengagements in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel. Dieser Prozentsatz wird aus Gründen der Einheitlichkeit auf der Grundlage der Berechnungen im obigen Abschnitt „Vermögensallokation“ angegeben. Der Fonds investierte 51 % seines langfristigen Engagements in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



Welche Investitionen fallen unter „Andere Investitionen“, welcher Anlagezweck wurde mit ihnen verfolgt und gab es einen ökologischen oder sozialen Mindestschutz?

„#2 Andere Investitionen“ umfasst Anlagen, die zu Nachhaltigkeitszwecken als neutral behandelt wurden und bei denen es sich um Zahlungsmittel, Geldmarktinstrumente und Optionen handelte, die mit dem Ziel eingesetzt wurden, das Risiko zu reduzieren (Hedging) oder den Fonds effizienter zu verwalten. Zu #2 gehören auch Investitionen, die nicht mit den eigenen Nachhaltigkeitstools des Anlageverwalters bewertet wurden und somit nicht zum Nachhaltigkeitsscore des Fonds beigetragen haben.

Gegebenenfalls wurden Mindestschutzmaßnahmen für Geldmarktinstrumente und Optionen angewandt, die zur Risikominderung (Hedging) oder für andere Investitionen eingesetzt werden, indem (gegebenenfalls) Investitionen in Kontrahenten eingeschränkt wurden, die mit Ländern mit höherem Risiko verbunden oder dort engagiert sind (im Hinblick auf Geldwäsche, Terrorismusfinanzierung, Bestechung, Korruption, Steuerhinterziehung und Sanktionsrisiken). Bei einer unternehmensweiten Risikobewertung wird die Risikoeinstufung der einzelnen Rechtsordnungen berücksichtigt, wobei auf eine Reihe öffentlicher Erklärungen, Indizes und Indikatoren für die Weltordnungspolitik verwiesen wird, die von den Vereinten Nationen, der Europäischen Union, der Regierung des Vereinigten Königreichs, der Financial Action Task Force und mehreren Nichtregierungsorganisationen (NGOs) wie Transparency International und dem Basler Ausschuss herausgegeben wurden.

Darüber hinaus wurden neue Kontrahenten durch Schroders eigenes Kreditrisikoteam überprüft, und die Genehmigung eines neuen Kontrahenten basierte auf einer ganzheitlichen Überprüfung der verschiedenen verfügbaren Informationsquellen,



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

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

einschließlich unter anderem der Qualität des Managements, der Eigentümerstruktur, des Standorts, regulatorischen und sozialen Umfelds, dem jeder Kontrahent unterliegt, und des Entwicklungsgrads des lokalen Bankensystems und seines Regulierungsrahmens. Die laufende Überwachung erfolgte mithilfe eines von Schroders entwickelten Tools, das die Analyse der Fähigkeit eines Kontrahenten, Trends und Herausforderungen in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung zu steuern, unterstützt.

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



Welche Maßnahmen wurden ergriffen, um die ökologischen und/oder sozialen Merkmale während des Referenzzeitraums zu erfüllen?

Im Referenzzeitraum wurden folgende Maßnahmen ergriffen, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erfüllen:

- der Anlageverwalter hat bei der Auswahl der Anlagen für den Fonds Nachhaltigkeitskriterien angewandt;
- Der Anlageverwalter hat bei der Auswahl der vom Fonds gehaltenen Vermögenswerte die Nachhaltigkeitsbewertungen des Fonds berücksichtigt;
- Der Anlageverwalter überwacht die Anwendung einer guten Unternehmensführung durch die zugrunde liegenden Strategien des Fonds; und
- Der Anlageverwalter (auch indirekt über die Verwalter der zugrunde liegenden Strategien) ging Engagements ein, die eines oder mehreren der sechs vorrangigen Themen abdecken und die in unserer Engagement-Blaupause (Link <https://prod.schroders.com/en/sysglobalassets/about-us/schroders-engagement-blueprint-2022.pdf>) aufgeführt sind. Eine Zusammenfassung der Engagement-Aktivitäten von Schroders, einschließlich der Anzahl der Emittenten und des damit verbundenen Themas, finden Sie oben in der Antwort auf die Frage „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“. Durch unsere Engagement-Aktivitäten bauen wir Beziehungen auf und führen einen wechselseitigen Dialog mit den Unternehmen, in die wir investiert haben. Wir sind bestrebt, Veränderungen voranzutreiben, die den Wert unserer Anlagen schützen und verbessern.

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



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

Es wurde kein Index als Benchmark festgelegt, um die vom Fonds beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale zu erreichen.

● **Wie unterscheidet sich die Benchmark von einem breiten Marktindex?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

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

- *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, um die Übereinstimmung der Benchmark mit den beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmalen zu bestimmen?*

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

- *Wie hat sich dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Benchmark entwickelt?*

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

- *Wie hat sich dieses Finanzprodukt im Vergleich zum breiten Marktindex entwickelt?*

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.



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 2022 DEDE