



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Halbjahresbericht

31. März 2023

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	10
Nettovermögensaufstellung	12
Gewinn- und Verlustrechnung	22
Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens	24
Aufteilung der Investitionen nach Branchen	26
Investitionsportfolio	30
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *	30
Schroder GAIA BlueTrend	31
Schroder GAIA Cat Bond	32
Schroder GAIA Contour Tech Equity	37
Schroder GAIA Egerton Equity	38
Schroder GAIA Helix	39
Schroder GAIA Oaktree Credit	43
Schroder GAIA Sirios US Equity	50
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *	51
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	52
Schroder GAIA Wellington Pagosa	53
Anmerkungen zum Finanzbericht	62
Gesamtkostenquote („TER“)	139
Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte	141

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

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 bezieht sich auf den Berichtszeitraum vom 1. Oktober 2022 bis zum 31. März 2023. Der Finanzbericht wurde im Einklang mit den Luxemburger Verordnungen in Bezug auf Organismen für gemeinsame Investitionen erstellt. Der letzte Termin, an dem die Anteilkurse berechnet wurden, war der 31. März 2023, der letzte Arbeitstag im Berichtszeitraum. Zum Zeitpunkt dieses Berichts stehen elf Teilfonds innerhalb der Gesellschaft für Investitionen zur Verfügung (die „Teilfonds“).

Die Investitionsziele der Teilfonds sowie Einzelheiten zu Investitionsbeschränkungen finden Sie im aktuellen Verkaufsprospekt. Den Bericht des Anlageverwalters für den jeweiligen Teilfonds finden Sie in den vierteljährlichen Investitionsberichten, 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

Das Board of Directors 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.

Das Board of Directors 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 Board of Directors 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 Finanzberichte müssen von unabhängigen Abschlussprüfern geprüft werden, die dem Board of Directors ihre Feststellungen melden.

Das Board of Directors 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.

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 Luxemburg

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.

Weiterhin stehen die im Unterabschnitt „Unterlagen der Gesellschaft“ beschriebenen und am Geschäftssitz der Gesellschaft zur Einsichtnahme verfügbaren Unterlagen auch auf www.eifs.lu/schroders kostenlos zur Einsichtnahme zur Verfügung.

Verwaltungsrat

Vorsitzender des Board of Directors

– **Eric Bertrand**

Non-Executive Director

Vaults 13-16
Valletta Waterfront
1914 FRN
Malta

Weitere Mitglieder

– **Carla Bergareche Garcia-Minaur**

Head of Iberian Business

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

– **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

Independent Director

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

– **Bernard Herman**

Independent Director

BH Consulting S.à.r.l.
26 rue Glesener
L-1630 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

– **Hugh Mullan**

Independent Director

5, rue Höhenhof
L-1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

– **Alexander Prawitz**

Country Head Germany, Austria & CEEMED

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

– **Neil Walton**

Head of OCIO and Client Specialist Solutions

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

Verwaltung

Eingetragener Sitz

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft, Registerführer und Domizilierungsstelle

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptbuchstelle, Registerführer und Transferstelle

HSBC Continental Europe, Luxembourg¹

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

Verwahrstelle und Verwaltungsstelle

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

80, route d'Esch, 1470 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Leitender Rechtsberater

Arendt & Medernach S.A.

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

Unabhängiger Wirtschaftsprüfer

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative

2, rue Gerhard Mercator, 2182 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter

Contour Asset Management, LLC

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

Egerton Capital (UK) LLP

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

Egerton Capital (UK) LLP hat den folgenden Sub-Anlageverwalter für 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 Sub-Anlageverwalter für 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 Sub-Anlageverwalter für Schroder GAIA Helix bestellt:

- Tellworth Investments LLP
- Schroder Investment Management North America Inc.
- Schroder Investment Management (Singapore) Ltd.

Schroder Investment Management (Singapore) Ltd

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

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

Central 2, 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 Sub-Anlageverwalter für Schroder GAIA BlueTrend bestellt:

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

Tellworth Investments LLP²

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

Two Sigma Advisers LP

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

Wellington Management International Limited

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

Wellington Management International Limited hat den folgenden Sub-Anlageverwalter für Schroder GAIA Wellington Pagosa bestellt:

- Wellington Management Company LLP.

*Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

¹ Am 1. November 2022 hat sich die Adresse von HSBC Continental Europe, Luxembourg, zu „18 Boulevard de Kockelscheuer, L-1821 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg“ geändert.

² Der Anlageverwalter für Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * und ein Sub-Anlageverwalter für Schroder GAIA Helix wurden mit Wirkung zum 5. Dezember 2022 von „BennBridge Ltd“ an „Tellworth Investments LLP“ übergeben.

Bericht des Verwaltungsrats

Einleitung

Die Direktoren der Gesellschaft legen hiermit ihren Bericht und den Finanzbericht für den Zeitraum bis 31. März 2023 vor.

Aktivitäten während des Berichtszeitraums

Zum 31. März 2023 belief sich das Nettovermögen der Gesellschaft insgesamt auf 4.945.980.935 EUR, was im Vergleich zu 5.333.186.258 EUR zum 30. September 2022 einem Rückgang um 7,26 % entspricht.

1. Neue Teilfonds

Während des Berichtszeitraums wurde ein neuer Teilfonds für Kapitalinvestitionen innerhalb der Gesellschaft zur Verfügung gestellt:

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	USD	21. Dezember 2022

2. Neue Anteilsklassen

Während des Berichtszeitraums wurden die folgenden Anteilsklassen nutzbar gestellt:

Teilfonds und Anteilsklassen	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Asian Equity Long Short			
Klasse A Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Klasse C Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Klasse I Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Klasse IZ Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Schroder GAIA Cat Bond			
Klasse Y2 Thes.	USD	USD	11. November 2022
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	11. November 2022
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	11. November 2022
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	11. November 2022

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

Das Board of Directors

Schroder GAIA
31. März 2023

Bericht des Anlageverwalters

Die Teilfonds der Schroder GAIA-Fondsreihe 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 abweicht, in welche diese Fonds investieren.

Wirtschaftlicher Rückblick

Da die Inflation über dem Ziel blieb, stiegen während des sechsmonatigen Berichtszeitraums die Zinssätze in den entwickelten Märkten. Gegen Ende des Berichtszeitraums kamen jedoch Hoffnungen auf, dass die Zinssätze im Zuge des Abflauens des Inflationsdrucks bereits auf oder nahe an ihrem Höchststand liegen könnten. In den USA ging die Inflationsrate von 7,7 % im Oktober 2022 auf 5,0 % im März 2023 zurück. Die Kerninflation, in die Preise für Lebensmittel und Energie nicht mit eingehen, fiel jedoch langsamer. Der Kern-PCE(Personal consumption expenditures)-Preisindex in den USA, das von der US-Notenbank bevorzugte Maß zum Messen der Inflation, fiel von 5,1 % im Oktober 2022 auf 4,6 % im März 2023.

Zudem verstärkten Bedenken über den Zustand des Bankensystems die Hoffnung, dass die Zinssätze ihren Höchststand nahezu erreicht haben könnten. Der Zusammenbruch der US-Regionalbank „Silicon Valley Bank“ im März sowie zwei weiterer kleiner US-Banken sorgten an den globalen Märkten für Volatilität. Fallende Einlagen zwangen die Silicon Valley Bank, die Verluste in ihrem Anleiheportfolio zu realisieren. Befürchtungen bezüglich der Liquidität der Bank breiteten sich rapide aus, was dazu führte, dass mehr und mehr Einleger ihre Geldmittel abzogen. Die Nervosität bezüglich der Banken weitete sich auch auf Europa aus. Die Schweizer Behörden vermittelten eilig eine Übereinkunft mit der UBS zur Rettung der in Schieflage geratenen Konkurrentin Credit Suisse, die ebenfalls mit Abflüssen von Einlagen zu kämpfen hatte.

Während des Berichtszeitraums hoben die Zentralbanken der Industrieländer die Zinssätze an. Die sich daraus für den Bankensektor ergebenden Belastungen führten zu keinem Ende dieser Erhöhungen. Die Federal Funds Rate in den USA lag zu Beginn des Berichtszeitraums bei 3,00–3,25 % und wurde im März 2023 auf 4,75–5,00 % angehoben. Der Hauptrefinanzierungssatz der Europäischen Zentralbank stieg von 1,25 % im März 2023 auf 3,50 % im September 2022. Die Official Bank Rate der Bank of England lag im März 2023 bei 4,25 %, im Gegensatz zu 2,25 % im September 2022. Unter den großen Industrieländern blieb Japan die große Ausnahme und nahm keine Erhöhungen der Zinssätze vor. Im Dezember änderte die Bank of Japan (BoJ) jedoch ihre Politik zur Steuerung der Zinsstruktur und weitete die Spanne aus, in der sie die Renditen 10-jähriger Anleihen gehalten hat. Der Berichtszeitraum markierte auch das Ende der Amtszeit von BoJ-Präsident Haruhiko Kuroda, und im April 2023 übernahm Kazuo Ueda das Ruder.

Da in Europa und im Vereinigten Königreich die Inflation trotz rückläufiger Energiepreise anhaltend stark blieb, kam es in diesen Regionen zu Zinsanstiegen. Insbesondere die Erdgaspreise fielen, da die Kombination aus außergewöhnlich mildem Winterwetter und Maßnahmen zur Senkung des Verbrauchs die Ängste vor Erdgasengpässen linderte. Sinkende Erdgaspreise führten zudem zu einer über den Befürchtungen liegenden Wirtschaftsaktivität, und in beiden Regionen konnte eine Rezession über die Wintermonate abgewendet werden.

In China war das wichtigste politische Ereignis im Berichtszeitraum die Aufhebung der Null-Covid-Politik Mitte Dezember. Dies stellte einen raschen Politikwechsel dar, der die Wiedereröffnung der Binnenwirtschaft sowie die Aufhebung der Reisebeschränkungen befeuerte. Nach der Aufhebung der Beschränkungen erholte sich die Wirtschaft Chinas mit einem BIP-Wachstum von 2,2 % im 1. Quartal 2023 gegenüber dem vorhergehenden 4. Quartal 2022 mit einem Wachstum von 0,6 %.

Überblick zur Entwicklung am Aktienmarkt

Aktien legten im Verlauf des sechsmonatigen Berichtszeitraums stark zu. Der MSCI World Index kam auf 18,3 %, da die Anleger der Ansicht waren, dass die großen Industrieländer eine tiefe Rezession vermeiden und die Zinssätze bald ihren Höhepunkt erreichen könnten. In den Equity Styles dominierte das Wachstum den Substanzwert, wobei der Bankensektor gegen Ende des Berichtszeitraums unter Druck geriet. Unter den globalen Aktiensektoren schnitten IT-Aktien am besten ab, Immobilien hingegen hinkten hinterher.

Der US-amerikanische S&P 500 erzielte eine Rendite von 15,3 % (in US-Dollar), wobei der Sektor der Informationstechnologie die höchsten Gewinne verzeichnete. Aktien der Eurozone verzeichneten einen sehr starken Anstieg, und der MSCI EMU-Index stieg um 26,5 % (in Euro). Die Gewinne wurden erzielt, als die Anleger nach einer vorsichtigen Zeit nach der Invasion Russlands in die Ukraine im Februar 2022 in die Region zurückkehrten. Zudem wurden die Aktien von sich mildernden Sorgen über mögliche Stromengpässe beflügelt. An der Spitze der Gewinne stand der Sektor der Nicht-Basiskonsumgüter, und Nachrichten aus China über eine Aufhebung der Null-Covid-Politik waren den Luxusgüteraktien und dem IT-Sektor zuträglich. Im Vereinigten Königreich zeichnete sich ein ähnliches Bild, da auch hier Aktien der Nicht-Basiskonsumgüter die Gewinne für den FTSE All-Share Index anführten.

Die Gewinne der Schwellenmärkte waren verhaltener als die der Industrieländer. Der MSCI EM(Emerging Markets)-Index verbuchte eine Steigerung von 14,0 % (in US-Dollar). Wie in den Industrieländern auch, verzeichnete der Sektor der Informationstechnologien robuste Renditen, neben den Kommunikationsdiensten. Nach Ländern betrachtet verzeichneten einige der osteuropäischen Märkte die stärksten Gewinne, darunter Polen, die Tschechische Republik und Ungarn. Zu Beginn des Jahres 2022 wurden diese Märkte durch ihre geografische Nähe zum Russland/Ukraine-Krieg sowie aufgrund höherer Erdgaspreise hart getroffen. Das Nachgeben der Erdgaspreise im Verlauf des Winters in Europa wirkte sich daher positiv auf die Stimmung in diesen Volkswirtschaften aus.

Schwächere Rohstoffpreise während des Berichtszeitraums belasteten die Renditen rohstoffexportierender Länder. Zu den Ländern, die negative Renditen verzeichneten, gehörten Brasilien, ebenso Katar, Saudi-Arabien und die Vereinigten Arabischen Emirate. Auch indische Aktien zeigten sich während des Berichtszeitraums schwächer.

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 (Forts.)

Gegen Ende des Sechsmonatszeitraums fielen weltweit die Renditen von Staatsanleihen. Der Zusammenbruch der Silicon Valley Bank im März löste eine starke Kurserholung an den Märkten für Staatsanleihen und Bedenken über eine erneute Beschleunigung der Inflation aus.

Innerhalb weniger Tage nach der Marktreaktion auf die Bankenkrise schwenkten die Märkte für Staatsanleihen in einigen Märkten von der Einpreisung von Zinserhöhungen zu einer Einpreisung von beträchtlichen Zinssenkungen um. Unterdessen intervenierte die US-Regierung und führte eine „Ausnahmeregelung aufgrund systemischer Risiken“ ein, die den Einlegern den Zugriff auf ihr Geld garantieren und in Panik geratene Kunden beruhigen sollte.

Angesichts der sich verändernden Marktdynamik setzten die Zentralbanken ihre Zinserhöhungen fort, wenngleich einige ihren Standpunkt korrigierten. In den vergangenen sechs Monaten kündigte die US-Notenbank (Fed) vier Zinsanhebungen an, wobei es sich bei der jüngsten Ankündigung um eine relativ moderate Anhebung von 25 Basispunkten in Folge der die Turbulenzen im Bankensektors handelte. Die Bank of England (BoE) stimmte ebenfalls vier Zinserhöhungen zu und folgte damit der Fed; die letzte Erhöhung betrug 25 Basispunkte. Die Europäische Zentralbank (EZB) behielt ihre Haltung bei und nahm ebenfalls vier Zinserhöhungen vor; allerdings betrug die letzte Erhöhung 50 Basispunkte.

Vor diesem Hintergrund zeigten sich die Märkte volatil, wobei erstklassige Anleihen aus den USA und Europa positive Renditen verbuchten, Hochzinsanleihen zeigten sich jedoch negativ, wobei der Bankensektor mit schlechter Performance dominierte. Die Inflation in der Eurozone und in den USA setzte ihren Abwärtstrend fort und ging von ihren Allzeithochs aus dem vergangenen Jahr zurück, blieb jedoch weiterhin hoch.

In den USA fielen die Renditen der 10-jährigen Anleihen von 3,83 % auf 3,47 %, die der zweijährigen Anleihen von 4,28 % auf 4,03 %. Die Rendite auf 10-jährige Staatsanleihen Deutschlands stieg von 2,11 % auf 2,29 %. Die Rendite der 10-jährigen Staatsanleihen des Vereinigten Königreichs gaben von 4,15 % auf 3,49 % nach, die der zweijährigen Anleihen von 4,92 % auf 3,44 %.

Aufgrund von veränderten Erwartungen zu Zinserhöhungen wurde der US-Dollar gegenüber dem Euro und dem britischen Pfund schwächer.

Ausblick

Für China hat sich der Ausblick seit der Aufgabe der Null-Covid-Politik deutlich verbessert. Die Aktivitäten normalisieren sich. Die Schroders Economics Group geht davon aus, dass eine Erholung, angetrieben durch den Dienstleistungssektor, eine Steigerung des BIP von 6,2 % im Jahr 2023 und von 4,5 % im kommenden Jahr hervorbringen könnte.

Die schiere Größe Chinas wird dazu führen, dass stärkere Aktivitäten automatisch BIP-Steigerungen weltweit ankurbeln werden. Dabei ist jedoch nicht selbstverständlich, dass eine auf Dienstleistungen beruhende Erholung Chinas der übrigen Welt wesentlich zugutekommen wird. Die kleineren Volkswirtschaften Asiens werden von der Wiederbelebung des Tourismus profitieren. Angesichts der zuvor hohen Investitionen und der schwachen Auslandsnachfrage dürfte diese Erholung jedoch kaum einen erneuten Investitionszyklus im verarbeitenden Gewerbe, mit Nachfrage nach Importen aus Europa und der übrigen Welt, zur Folge haben.

Rohstoffexporteure erhalten möglicherweise etwas Rückenwind, sollten die Preise steigen, jedoch kann das Drehbuch diesmal auch etwas anderes vorsehen. Die vom Baugewerbe vorangetriebenen Erholungen früherer Zeiten stützten die Preise für Industriemetalle; eine auf dem Dienstleistungssektor basierende Erholung hingegen könnte den Energiesektor stärken, und das wiederum könnte die Inflation weltweit wieder in die Höhe treiben. Einige Schwellenmärkte würden in diesem Umfeld gedeihen. Die meisten dieser Märkte sehen sich jedoch einer Phase eines schleppenden Wachstums gegenüber, da höhere Zinssätze und eine gedämpfte Auslandsnachfrage zu Buche schlagen.

Bei den Aussichten für die Industrieländer ist die Schroders Economics Group weniger pessimistisch, jedoch eher aufgrund der Binnenmärkte. Zwar leuchten viele rote Warnsignale, jedoch trotz der US-Wirtschaft weiterhin allen Widrigkeiten. Wir sind nach wie vor der Ansicht, dass höhere Zinssätze, die mit 5,25 % im zweiten Quartal wohl ihren Höchststand erreichen dürften, zu einer Rezession führen werden. Aber es würde sich wahrscheinlich um eine relativ kurze und flache Rezession handeln. Eine Phase eines Wachstums unter dem Trend sollte zu einem Sinken der Inflation führen, sodass die US-Notenbank Ende 2023 wieder auf Zinssenkungen umschwenken kann.

Die Eurozone wird nach einer gewissen Erholung von der Energiekrise eine Rezession vermeiden können. Die Inflation sollte schneller zurückgehen und damit den Druck auf die Realeinkommen etwas reduzieren. Die Wirtschaft wird wahrscheinlich weitgehend stagnieren, was bedeutet, dass die Europäische Zentralbank die Zinsen zwar kurzfristig etwas weiter anheben könnte, sie im nächsten Jahr jedoch wahrscheinlich ebenfalls senken wird.

Im Gegensatz dazu sieht sich das Vereinigte Königreich nach wie vor einer Rezession gegenüber, da höhere Inflations- und Zinssätze in Kombination mit einer strikten Fiskalpolitik den Ausblick dämpfen. Möglicherweise haben die Zinssätze bereits ihren Höhepunkt erreicht und werden im Jahr 2024 wahrscheinlich sinken.

Die Anlageverwalter

Schroder GAIA

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

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
VERMÖGENSWERTE						
Investitionen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	9.127.068	380.145.809	2.325.167.267	118.409.475	328.960.140	259.396.176
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	460.641	(22.845.815)	(132.480.976)	12.038.774	24.347.675	(3.875.562)
Wertpapiere zum Marktwert	9.587.709	357.299.994	2.192.686.291	130.448.249	353.307.815	255.520.614
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	(70.691)	915.421	12.147.339	829.830	2.591.295	2.941.314
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	(863.875)	-	-	-	(2.992.828)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	867.395	-	-	-	-
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	(9.054.781)	-	-	-	-
aus Total-Return-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	5.795.999	(10.260.677)
aus Differenzkontrakten	(156.159)	(2.988.010)	-	(6.438.410)	-	14.770.375
	(226.850)	(11.123.850)	12.147.339	(5.608.580)	8.387.294	4.458.184
Forderungen aus Verkauf von Wertpapieren	-	278.439	1.117.093	8.805.707	22.679.149	13.293.277
Bankguthaben	909.797	109.421.911	212.002.687	29.183.960	62.920.993	19.104.860
Termineinlagen	-	-	-	-	-	-
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	19.596.693	-	-	-	9.606.906
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	69.379	15.986.749	3.470.000	11.791.780	27.886.506	10.055.788
Forderungen aus Zeichnungen	-	1.148.584	-	167.012	-	336.953
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	-	-	53.599
Dividenden und Zinsforderungen	68.276	688.499	33.087.340	469.689	1.383.222	8.876.815
Erstattungsforderung des Fonds	-	283.309	12.868	-	-	8.894
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	1.910.000	-
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	2.980.000	13.160.000	830.000	-	2.400.000
Sonstige Forderungen	-	1.142.428	-	353.970	-	883.085
SUMME VERMÖGENSWERTE	10.408.311	497.702.756	2.467.683.618	176.441.787	478.474.979	324.598.975
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus Ankauf von Wertpapieren	4.713	50.036.824	18.887.000	1.075.138	19.863.223	20.822.432
Verbindlichkeiten aus Rückgabe von Anteilen	-	1.479.619	-	1.141.194	9.056.283	918.937
Fällige Verwaltungsgebühren	6	408.030	1.747.773	192.919	570.393	207.275
Fällige Performancegebühren	30	465	123.986	-	-	-
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	16.188	309.847	-	1.125.019	293.187	1.325.555
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	-	-	-
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	-	-	-	-
Optionen zum Marktwert	-	-	-	665.412	-	-
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	2.980.000	10.580.000	830.000	-	2.400.000
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	2.580.000	-	1.910.000	-
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	3.951	274.650	5.769.606	105.966	1.026.328	120.377
SUMME VERBINDLICHKEITEN	24.888	55.489.435	39.688.365	5.135.648	32.719.414	25.794.576
SUMME NETTOVERMÖGEN	10.383.423	442.213.321	2.427.995.253	171.306.139	445.755.565	298.804.399

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe ** EUR
VERMÖGENSWERTE						
Investitionen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	64.226.749	174.059.813	32.347.143	54.430.120	526.979.837	3.972.893.551
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	(3.169.079)	10.881.777	(1.154.514)	26.099	9.231.237	(96.590.189)
Wertpapiere zum Marktwert	61.057.670	184.941.590	31.192.629	54.456.219	536.211.074	3.876.303.362
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	202.440	53.124	4.865	1.605.153	24.924	19.792.637
aus Kassageschäften	-	-	-	8.932	-	8.236
aus Terminkontrakten	(3.922)	-	-	(1.916.681)	(2.058.377)	(7.225.157)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	(416.664)	(384.199)
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	104.968	(424.856)	504.847
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	346.908	319.878
aus Inflations-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	77.743	71.686
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(1.931.885)	(10.130.628)
aus Total-Return-Swap-Kontrakten	-	3.706.122	-	2.191.713	(4.192.718)	(2.092.945)
aus Differenzkontrakten	-	-	(121.710)	-	-	4.645.140
	198.518	3.759.246	(116.845)	1.994.085	(8.574.925)	5.509.495
Forderungen aus Verkauf von Wertpapieren	8.884	2.724.590	4.631.804	150.085.844	68.548.040	253.730.942
Bankguthaben	2.286.213	8.340.466	1.276.594	89.629.098	53.822.151	548.191.582
Termineinlagen	-	-	-	304.885.000	-	281.129.555
Forderung aus Broker-Einschusskonto	83.591	-	-	25.239.442	31.259.544	79.102.053
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	-	-	1.882.936	17.645.234	60.801.079	140.512.416
Forderungen aus Zeichnungen	55.322	-	-	617.951	2.904.529	4.822.823
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	-	875.524	856.729
Dividenden und Zinsforderungen	885.291	207.796	298.212	101.648	2.592.917	45.040.341
Erstattungsforderung des Fonds	-	-	-	-	-	281.301
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	-	1.910.000
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	140.000	460.000	29.729	2.360.000	3.200.000	23.574.619
Sonstige Forderungen	68.095	192.291	-	1.452.751	1.676.009	5.319.160
SUMME VERMÖGENSWERTE	64.783.584	200.625.979	39.195.059	648.467.272	753.315.942	5.266.284.378
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus Ankauf von Wertpapieren	667.855	3.596.670	7.783	75.004.278	57.661.092	229.882.223
Verbindlichkeiten aus Rückgabe von Anteilen	-	1.865.234	7.655.501	2.715.635	16.013.462	40.017.931
Fällige Verwaltungsgebühren	22.628	262.435	24.892	754.131	710.958	4.569.343
Fällige Performancegebühren	-	45.422	-	944.756	19.773	1.046.041
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	-	132.483	102.802	1.049.589	2.610.992	6.467.912
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	-	-	56.590	-	-	64.370
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	110.000	4.460.000	-	-	-	4.213.924
Optionen zum Marktwert	-	-	-	-	-	613.566
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	140.000	460.000	19.729	2.360.000	3.200.000	21.184.267
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	-	-	10.000	-	-	4.300.351
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	38.314	117.160	106.283	582.191	358.363	7.943.515
SUMME VERBINDLICHKEITEN	978.797	10.939.404	7.983.580	83.410.580	80.574.640	320.303.443
SUMME NETTOVERMÖGEN	63.804.787	189.686.575	31.211.479	565.056.692	672.741.302	4.945.980.935

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

** Für die in Euro angegebene Summe der Nettovermögensaufstellung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 31. März 2023 umgerechnet: 1 Euro = 0,92208 US-Dollar und 1 Euro = 1,13748 Pfund Sterling.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert						
zum 31. März 2023	10.383.423	442.213.321	2.427.995.253	171.306.139	445.755.565	298.804.399
Ausstehende Anteile **						
zum 31. März 2023						
Klasse A Thes.	15	125.257	2.475	153.269	260.140	5.058
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	1.052	-	2.838	-	100
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	461.946	10.966	33.014	-	144.140
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	8.194	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	100	-	-	64
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	5.342	-	140
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	312.450	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	813	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	10.506	20.824	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	90.618	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	15	489.546	6.882	469.914	733.419	11.461
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	304.427	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	20.937	2.539	15.148	-	669
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	369.233	18.142	410.585	-	38.602
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	1.222.946	10.856	183.690	88.938	38.931
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	56.264	-	11
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	140
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	501.147	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	5.419	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	3.210	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	33.215	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	1
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	-	38.787	-	5.210	6	372.369
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	2.509	-	8.803
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	5.000	-	33.663	-	951.405
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	86.455
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	34.498	-	-
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.	-	-	12.698	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.262	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	7.434	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	162	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	256	-	-	-
Klasse I Thes.	100.015	-	185.901	-	-	158.667
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	27.760	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	9	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	120	-	-	103
Klasse IF Thes.	-	-	180.377	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	94.258	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	455.109	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	7.537.346	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	12.095	-	-	-
Klasse IZ Thes.	15	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	92
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

** Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt „Anteilklassen“ der Anmerkungen zum Finanzbericht.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Ausstehende Anteile ** (Forts.)						
zum 31. März 2023						
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	273.000	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	100	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	168.972	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	23.103	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	33.739	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	44.813	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	65.583	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-	3.053
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	246
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	25.857
Klasse X Thes.	-	-	-	-	122.230	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	646.429
Klasse Y Thes.	-	-	7.185	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	413	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	10	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	31	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	10	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	10	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	16.904	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	49.230	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	29.765	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	100	-	-	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.
** Informationen zu der für die Anteilsklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt „Anteilsklassen“ der Anmerkungen zum Finanzbericht.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert					
zum 31. März 2023	63.804.787	189.686.575	31.211.479	565.056.692	672.741.302
Ausstehende Anteile **					
zum 31. März 2023					
Klasse A Thes.	-	576.820	-	-	152.439
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	1.902	-	-	8.138
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	79.282	-	-	218.557
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	16.758
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	15	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	100	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	100	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	15	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	103	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	102	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	103	-	-	-	-
Klasse C Thes.	10.578	323.225	124.284	2.049.636	2.537.978
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	158.010
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	620	14.521	5.611	31.787	88.869
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	107	169.089	24.977	1.052.213	1.317.764
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	100	29.805	-	663.945	1.030.549
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	5.071	-	-
Klasse C Aussch.	15	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	103	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	102	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	103	68	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	39
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	328
Klasse E Thes.	300.579	170	-	-	44.895
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	100	-	-	-	8.332
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	114.909	5.632	-	-	111.748
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	100	-	-	-	58.965
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	16	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	103	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	102	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	17.676	-	-	-	-
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.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	439.980	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

** Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt „Anteilklassen“ der Anmerkungen zum Finanzbericht.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Ausstehende Anteile ** (Forts.)					
zum 31. März 2023					
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	790	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	87	69.937	-
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.	-	-	93.212	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	19.087	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	3.819	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	15	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	68	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.
 ** Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt „Anteilklassen“ der Anmerkungen zum Finanzbericht.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil **						
zum 31. März 2023						
Klasse A Thes.	102,54	111,84	1.481,61	120,17	199,87	110,56
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	96,11	-	106,41	-	100,82
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	99,39	982,04	109,30	-	102,23
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	190,49	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	905,23	-	-	848,35
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	163,71	-	109,27
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	205,30	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	195,30	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	119,11	186,02	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	196,36	-
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.	102,71	115,72	1.499,74	125,52	217,70	115,27
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	137,44	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	99,80	1.133,68	112,57	-	105,67
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	102,36	1.206,27	113,87	-	106,76
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	110,85	106,15	95,65	205,87	111,57
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	950,40	-	864,60
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	113,63
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	223,85	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	216,55	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	212,91	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	109,93	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	5.695,00
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	-	118,85	-	127,29	216,18	118,09
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	113,42	-	107,74
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	104,81	-	115,33	-	109,58
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	114,30
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	954,30	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	112,89	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	1.481,89	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.123,66	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.192,04	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	1.102,05	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	1.467,21	-	-	-
Klasse I Thes.	103,77	-	1.720,53	-	-	124,80
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.401,33	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.493,23	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	10.600,51	-	-	12.350,94
Klasse IF Thes.	-	-	1.539,15	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.253,25	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.335,11	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	920,56	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	1.312,41	-	-	-
Klasse IZ Thes.	102,77	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	112,01
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

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

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil ** (Forts.)						
zum 31. März 2023						
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	101,56	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	113,79	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	787,66	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	992,63	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.002,30	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	1.006,38	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	100,28	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-	114,43
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	105,59
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	110,21
Klasse X Thes.	-	-	-	-	216,71	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	109,25
Klasse Y Thes.	-	-	1.019,04	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	989,31	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	998,85	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	1.016,40	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	986,34	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	995,79	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	1.063,98	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.046,84	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.052,82	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	105,97	-	-	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

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

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil **					
zum 31. März 2023					
Klasse A Thes.	-	155,04	-	-	114,27
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	177,15	-	-	101,73
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	134,29	-	-	103,51
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	156,69
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	96,22	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	91,73	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	92,54	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	96,78	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	93,87	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	100,42	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	95,87	-	-	-	-
Klasse C Thes.	96,77	163,48	113,05	129,15	117,80
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	147,30
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	92,56	185,43	138,04	112,39	105,18
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	93,41	141,94	124,59	115,70	106,75
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	95,65	150,63	-	122,75	89,91
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	151,85	-	-
Klasse C Aussch.	96,79	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	93,87	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	100,45	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	95,89	150,56	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5.247,34
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5.355,68
Klasse E Thes.	96,90	175,67	-	-	121,34
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	92,83	-	-	-	108,01
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	93,71	152,93	-	-	109,82
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	95,92	-	-	-	92,49
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	96,79	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	93,87	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	100,45	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	95,92	-	-	-	-
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.	98,31	-	122,51	-	-
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.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	125,67	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	108,96	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	120,87	112,02	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

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

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil ** (Forts.)					
zum 31. März 2023					
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	147,77	-	-
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.	-	-	112,99	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	124,71	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	151,81	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	108,42	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	150,38	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

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

Gewinn- und Verlustrechnung für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
ERTRÄGE						
Nettodividenden ^	61.675	-	-	-	1.000.021	6.386.800
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	-	638.982	106.370.332	-	-	350.306
Nettoertrag aus Swaps	18.248	2.005.514	-	1.603.070	1.053.543	456.215
Bankzinsen	182	1.143.879	2.725.015	531.224	335.393	714.716
Sonstige Erträge	-	-	-	-	269	16.366
Erträge insgesamt	80.105	3.788.375	109.095.347	2.134.294	2.389.226	7.924.403
AUFWENDUNGEN						
Performancegebühren	30	465	123.986	-	-	-
Verwaltungsgebühren	18	2.380.733	9.753.929	1.140.423	3.840.510	1.221.759
Nettodividendenaufwand ^	-	-	26.747	616.741	-	-
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	-	-	-	-
Verwahrstellengebühren	1.697	130.601	286.455	22.368	69.824	50.842
Verwaltungsgebühren	2.397	680.829	1.669.177	267.089	818.046	223.066
Taxe d'abonnement	507	111.600	142.517	41.994	114.725	57.986
Vertriebsgebühren	-	-	-	4.307	51.710	-
Bank- und Zinskosten	-	27.622	30.880	604	2.315	3.471
Sonstige Aufwendungen	668	133.843	368.903	44.976	423.461	104.743
Aufwendungen insgesamt	5.317	3.465.693	12.402.594	2.138.502	5.320.591	1.661.867
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	(109.706)	(12.868)	-	-	(2.329)
NETTOINVESTITIONSERTRAG/(-VERLUST)	74.788	432.388	96.705.621	(4.208)	(2.931.365)	6.264.865

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.
^ Einschließlich erhaltene/gezahlte Dividenden im Zusammenhang mit Derivaten mit zugrunde liegenden Anteilswerten.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Gewinn- und Verlustrechnung für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe ** EUR
ERTRÄGE						
Nettodividenden ^	17.014	254.011	160.770	84.434	-	7.456.692
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	1.933.002	218.668	58.077	5.957.858	1.314.389	107.750.283
Nettoertrag aus Swaps	-	507.028	-	-	-	5.285.977
Bankzinsen	32.738	138.384	30.361	4.124.437	1.224.162	10.176.048
Sonstige Erträge	629	271	-	-	-	16.190
Erträge insgesamt	1.983.383	1.118.362	249.208	10.166.729	2.538.551	130.685.190
AUFWENDUNGEN						
Performancegebühren	-	45.422	-	944.756	19.773	1.046.041
Verwaltungsgebühren	138.318	1.586.359	151.328	4.399.271	4.019.153	26.732.757
Nettodividendenaufwand ^	-	-	-	-	201.719	779.352
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	35.019	12.296.561	1.178.946	12.465.382
Verwahrstellengebühren	16.665	27.487	9.667	77.092	137.414	772.956
Verwaltungsgebühren	46.021	301.941	53.417	919.257	990.306	5.581.511
Taxe d'abonnement	11.563	48.060	9.129	144.068	159.788	787.242
Vertriebsgebühren	-	-	-	-	-	55.681
Bank- und Zinskosten	40.315	102	-	-	36.972	131.375
Sonstige Aufwendungen	11.570	44.291	9.882	148.822	166.696	1.379.388
Aufwendungen insgesamt	264.452	2.053.662	268.442	18.929.827	6.910.767	49.731.685
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	-	-	-	-	(115.171)
NETTOINVESTITIONSERTRAG/(-VERLUST)	1.718.931	(935.300)	(19.234)	(8.763.098)	(4.372.216)	81.068.676

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.
 ** Für die in Euro angegebene Summe der Ertrags- und Aufwandsrechnung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 31. März 2023 umgerechnet: 1 Euro = 0,92208 US-Dollar und 1 Euro = 1,13748 Pfund Sterling.
 ^ Einschließlich erhaltene/gezahlte Dividenden im Zusammenhang mit Derivaten mit zugrunde liegenden Anteilswerten.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
NETTOINVESTITIONSERTRAG/(-VERLUST) **	74.788	432.388	96.705.621	(4.208)	(2.931.365)	6.264.865
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	66.001	(306.742)	(9.554.803)	(18.825.442)	13.232.388	(8.996.649)
aus Devisenterminkontrakten	58.451	35.546.772	90.661.698	6.636.195	15.435.877	29.019.578
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	(38.752.149)	430	-	476.064	(5.245.758)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	(4.937.278)	-	-	-	-
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	7.247.699	-	-	-	-
aus Total-Return-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	20.267.606	(42.031.176)
aus Differenzkontrakten	(61.614)	-	-	14.161.568	-	32.034.016
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	1.042.425	-	199.879	-	(1.261.033)
aus Devisengeschäften	5.930	39.892	2.059.264	(31.407)	15.458.747	(7.198.025)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	68.768	(119.381)	83.166.589	2.140.793	64.870.682	(3.679.047)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)						
aus Investitionen	460.641	(13.148.471)	138.025.029	46.701.905	(11.379.251)	63.209.861
aus Devisenterminkontrakten	(70.691)	(10.096.684)	4.411.067	638.199	6.771.280	9.944.252
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	(8.176.900)	-	-	(2.219.883)	(16.853.921)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	(622.518)	-	-	-	-
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	(16.755.302)	-	-	-	-
aus Total-Return-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(29.754.218)	(45.768.004)
aus Differenzkontrakten	(156.159)	(3.566.721)	-	(22.867.981)	-	44.687.307
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	3.883	-	450.359	-	(922.033)
aus Devisengeschäften	76	138.166	15.294	(4.240)	211.482	60.120
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	233.867	(52.224.547)	142.451.390	24.918.242	(36.370.590)	54.357.582
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS GESCHÄFTSBETRIEB	377.423	(51.911.540)	322.323.600	27.054.827	25.568.727	56.943.400
Nettoerlöse aus Ausgabe von Anteilen	10.006.000	207.196.236	390.605.982	12.160.461	23.452.684	56.900.820
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	-	(84.522.541)	(261.221.451)	(87.444.181)	(191.863.618)	(305.403.536)
Ausschüttungen aus Nettoinvestitionserträgen	-	-	(566.589)	-	-	-
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Berichtszeitraums	10.383.423	70.762.155	451.141.542	(48.228.893)	(142.842.207)	(191.559.316)
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	-	371.451.166	1.976.853.711	219.535.032	588.597.772	490.363.715
Nennwährungsanpassung ***	-	-	-	-	-	-
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS	10.383.423	442.213.321	2.427.995.253	171.306.139	445.755.565	298.804.399

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

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

**** Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2022 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 31. März 2023.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe ** EUR
NETTOINVESTITIONSERTRAG/(-VERLUST) ***	1.718.931	(935.300)	(19.234)	(8.763.098)	(4.372.216)	81.068.676
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	(162.353)	1.114.233	(1.041.837)	43.736	9.646.482	(12.826.392)
aus Devisenterminkontrakten	309.262	2.341.037	(127.461)	18.763.939	27.888.680	210.058.632
aus Kassageschäften	-	-	-	49.078	-	45.254
aus Terminkontrakten	47.390	-	(131.974)	(1.342.213)	(2.891.031)	(44.103.129)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	(1.353.739)	(1.248.261)
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	(356.333)	(1.051.327)	(5.850.565)
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(91.775)	(84.624)
aus Inflations-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	315.445	290.867
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(4.995.112)	2.077.074
aus Total-Return-Swap-Kontrakten	-	621.675	-	46.433.094	9.460.866	33.623.493
aus Differenzkontrakten	-	-	132.499	-	-	42.690.107
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	(353)	-	-	-	(10.037.788)	(9.273.278)
aus Devisengeschäften	(164.716)	1.621	1.557	65.041	(3.751.075)	7.186.221
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	29.230	4.078.566	(1.167.216)	63.656.342	23.139.626	222.585.399
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwaches/(Wertverlustes)						
aus Investitionen	4.208.656	20.151.028	1.688.757	76.618	30.920.222	258.504.329
aus Devisenterminkontrakten	(864.704)	(641.601)	(85.514)	(397.065)	(5.098.113)	4.668.163
aus Kassageschäften	-	-	-	(3.500)	-	(3.227)
aus Terminkontrakten	(47.095)	-	(138.600)	(5.653.663)	(1.456.637)	(32.057.774)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	(1.839.310)	(1.695.998)
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	(431.139)	(673.551)	(1.592.631)
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	352.876	325.381
aus Inflations-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	67.966	62.670
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(623.388)	(16.024.610)
aus Total-Return-Swap-Kontrakten	-	(3.989.459)	-	(15.826.084)	(16.718.880)	(105.643.962)
aus Differenzkontrakten	-	-	(384.963)	-	-	16.248.553
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	(422)	-	-	-	(593.627)	(979.106)
aus Devisengeschäften	37.809	10.031	(2.869)	143.068	3.896.820	4.170.546
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	3.334.244	15.529.999	1.076.811	(22.091.765)	8.234.378	125.982.334
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	5.082.405	18.673.265	(109.639)	32.801.479	27.001.788	429.636.409
Nettoerlöse aus Ausgabe von Anteilen	19.146.603	20.784.681	1.023.372	78.087.392	156.425.938	901.808.195
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(7.909.236)	(38.240.437)	(10.327.523)	(240.678.194)	(126.224.997)	(1.265.523.937)
Ausschüttungen aus Nettoinvestitionserträgen	(31.398)	-	-	-	-	(551.394)
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Berichtszeitraums	16.288.374	1.217.509	(9.413.790)	(129.789.323)	57.202.729	65.369.273
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	47.516.413	188.469.066	40.625.269	694.846.015	615.538.573	5.333.186.258
Nennwährungsanpassung ****	-	-	-	-	-	(452.574.596)
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS	63.804.787	189.686.575	31.211.479	565.056.692	672.741.302	4.945.980.935

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

** Für die in Euro angegebene Summe der Veränderung des Nettovermögens wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 31. März 2023 umgerechnet: 1 Euro = 0,92208 US-Dollar und 1 Euro = 1,13748 Pfund Sterling.

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

**** Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2022 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 31. März 2023.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Aufteilung der Investitionen nach Branchen

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * %	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	43,16	80,80	87,57	-	-	29,78
Sonstige Wertpapiere						
Werbung	-	-	-	-	-	-
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	-	-	2,03	-
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	-	-
Fluggesellschaften	-	-	-	-	-	0,13
Bekleidung	1,57	-	-	-	-	0,33
Automobilhersteller	-	-	-	-	-	0,17
Autoteile und -zubehör	1,99	-	-	-	-	0,86
Banken	2,62	-	-	-	8,10	5,70
Getränke	-	-	-	-	-	0,89
Biotechnologie	-	-	-	-	-	0,11
Baustoffe	-	-	-	-	-	0,11
Chemie	-	-	-	-	0,32	1,99
Gewerbliche Dienstleistungen	3,41	-	-	-	-	0,86
Computer	1,88	-	-	-	-	0,61
Kosmetik und Körperpflege	-	-	-	-	-	-
Vertrieb und Großhandel	-	-	-	-	-	0,14
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	-	-	11,36	1,49
Elektrik	-	-	-	-	-	0,39
Elektrische Bauteile und Geräte	2,04	-	-	-	-	0,99
Elektronik	2,33	-	-	2,67	-	1,82
Energie – Alternative Energieträger	-	-	-	-	-	1,24
Bau- und Ingenieurwesen	-	-	-	-	-	-
Unterhaltung	-	-	-	2,06	-	-
Umweltschutz	-	-	-	-	-	-
Lebensmittel	-	-	-	-	-	1,87
Gas	-	-	-	-	-	-
Hand- und Maschinenwerkzeuge	-	-	-	-	-	-
Gesundheitswesen – Produkte	-	-	-	-	0,46	0,59
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	-	-	-	0,32	-
Holdinggesellschaften – Diversifiziert	-	-	-	-	-	-
Wohngebäude-Bausträger	-	-	-	-	-	-
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	-	1,02
Haushaltswaren	1,45	-	-	-	-	0,30
Versicherungen	1,82	-	2,74	-	6,86	1,35
Internet	-	-	-	29,12	6,58	0,49
Investmentgesellschaften	-	-	-	-	1,45	5,54
Eisen und Stahl	-	-	-	-	-	-
Freizeit	1,23	-	-	-	-	0,24
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	-	0,11
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	-	0,44
Maschinen – Diversifiziert	-	-	-	-	-	0,45
Medien	-	-	-	12,99	-	-
Metallprodukte und Eisenwaren	1,66	-	-	-	0,75	-
Bergbau	-	-	-	-	2,68	2,03
Diverse Fertigungsbetriebe	-	-	-	-	-	-
Öl und Gas	-	-	-	-	3,23	0,83

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Aufteilung der Investitionen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * %	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)						
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	3,70	-
Verpackung und Container	-	-	-	-	-	-
Pharmazeutika	-	-	-	-	1,15	0,69
Pipelines	-	-	-	-	-	-
Immobilien	-	-	-	-	-	1,51
Einzelhandel	1,68	-	-	-	2,07	2,61
Halbleiter	23,13	-	-	9,86	5,43	16,49
Software	-	-	-	19,45	5,86	0,30
Telekommunikation	2,37	-	-	-	-	0,65
Transport	-	-	-	-	16,91	0,39
Investitionsportfolio in Prozent des Nettovermögens	92,34	80,80	90,31	76,15	79,26	85,51
Termineinlagen	-	-	-	-	-	-
Sonstiges Nettovermögen	7,66	19,20	9,69	23,85	20,74	14,49
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Aufteilung der Investitionen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	95,69	22,86	91,01	8,75	39,54
Sonstige Wertpapiere					
Werbung	-	-	-	-	0,06
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	0,97	-	-	0,15
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	0,37
Fluggesellschaften	-	2,39	-	-	-
Bekleidung	-	-	-	-	-
Automobilhersteller	-	2,02	-	-	-
Autoteile und -zubehör	-	-	-	-	0,14
Banken	-	4,84	-	-	6,85
Getränke	-	1,55	-	-	-
Biotechnologie	-	-	-	-	2,39
Baustoffe	-	0,19	-	-	0,51
Chemie	-	2,17	-	-	0,17
Gewerbliche Dienstleistungen	-	5,77	1,25	-	0,78
Computer	-	1,01	-	-	0,07
Kosmetik und Körperpflege	-	-	-	-	0,21
Vertrieb und Großhandel	-	-	-	-	-
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	3,64	-	-	2,02
Elektrik	-	0,20	-	-	2,65
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	0,24
Elektronik	-	1,59	1,61	-	0,39
Energie – Alternative Energieträger	-	-	-	-	0,47
Bau- und Ingenieurwesen	-	-	-	-	0,08
Unterhaltung	-	-	1,17	-	0,01
Umweltschutz	-	1,18	-	-	-
Lebensmittel	-	-	-	-	0,46
Gas	-	-	-	-	0,48
Hand- und Maschinenwerkzeuge	-	-	-	-	0,09
Gesundheitswesen – Produkte	-	12,44	-	-	1,43
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	0,75	-	-	0,98
Holdinggesellschaften – Diversifiziert	-	-	-	-	0,03
Wohngebäude-Bauträger	-	-	-	-	0,40
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	0,10
Haushaltswaren	-	-	-	-	-
Versicherungen	-	-	-	-	1,14
Internet	-	0,45	-	-	1,18
Investmentgesellschaften	-	-	-	0,88	1,42
Eisen und Stahl	-	-	-	-	0,03
Freizeit	-	1,53	-	-	-
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	0,07
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	0,23
Maschinen – Diversifiziert	-	-	-	-	0,66
Medien	-	-	-	-	0,04
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	0,05
Bergbau	-	-	-	-	1,04
Diverse Fertigungsbetriebe	-	2,01	-	-	0,39

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Aufteilung der Investitionen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)					
Öl und Gas	-	2,86	-	-	5,85
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	1,43	-	-	0,54
Verpackung und Container	-	0,61	-	-	-
Pharmazeutika	-	2,89	-	-	2,28
Pipelines	-	-	-	-	0,50
Immobilien	-	-	2,59	-	0,17
Einzelhandel	-	1,11	0,24	-	0,51
Halbleiter	-	5,04	-	-	1,19
Software	-	14,16	2,07	-	0,91
Telekommunikation	-	-	-	-	0,28
Transport	-	1,84	-	-	0,16
Investitionsportfolio in Prozent des Nettovermögens	95,69	97,50	99,94	9,63	79,71
Termineinlagen	-	-	-	53,96	-
Sonstiges Nettovermögen	4,31	2,50	0,06	36,41	20,29
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023

Schroder GAIA Asian Equity Long Short *

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Aktien				
China				
3.500	CNH	Contemporary Amperex Technology	206.775	1,99
45.900	CNH	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	171.965	1,66
Indonesien				
234.000	IDR	Bank Mandiri Persero	161.129	1,55
Philippinen				
56.300	PHP	International Container Terminal Services	220.996	2,13
316.800	PHP	Wilcon Depot	174.818	1,68
Südkorea				
878	KRW	L&F	211.432	2,04
18.106	KRW	Samsung Electronics	890.106	8,56
1.191	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	188.460	1,82
436	KRW	Samsung SDI	246.157	2,37
Taiwan				
16.000	TWD	Advantech	194.959	1,88
67.000	TWD	ASE Technology Holding	247.556	2,38
22.000	TWD	Chroma ATE	128.254	1,24
10.000	TWD	Eclat Textile	162.575	1,57
9.000	TWD	MediaTek	232.630	2,24
23.000	TWD	Merida Industry	127.285	1,23
14.000	TWD	Nien Made Enterprise	150.357	1,45
15.000	TWD	Sporton International	133.016	1,28
59.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	1.032.826	9,95
2.000	TWD	Voltronic Power Technology	113.638	1,09
Thailand				
28.700	THB	Kasikornbank	111.208	1,07
Summe Aktien			5.106.142	49,18
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			5.106.142	49,18

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
USA				
500.000	USD	United States Treasury Bill 06/04/23, ZCP	499.689	4,82
500.000	USD	United States Treasury Bill 13/04/23, ZCP	499.255	4,81
500.000	USD	United States Treasury Bill 20/04/23, ZCP	498.783	4,80
500.000	USD	United States Treasury Bill 27/04/23, ZCP	498.353	4,80
500.000	USD	United States Treasury Bill 04/05/23, ZCP	497.885	4,79
500.000	USD	United States Treasury Bill 11/05/23, ZCP	497.399	4,79
500.000	USD	United States Treasury Bill 18/05/23, ZCP	497.013	4,79
500.000	USD	United States Treasury Bill 25/05/23, ZCP	496.753	4,78
500.000	USD	United States Treasury Bill 01/06/23, ZCP	496.437	4,78
Summe Anleihen			4.481.567	43,16
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			4.481.567	43,16
Summe Kapitalinvestitionen			9.587.709	92,34
Sonstiges Nettovermögen			795.714	7,66
Nettoinventarwert			10.383.423	100,00

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA BlueTrend

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
USA				
39.500.000	USD	United States Treasury Note 15/04/23, 0.25%	39.443.267	8,92
41.000.000	USD	United States Treasury Note 15/05/23, 0.13%	40.781.396	9,22
42.000.000	USD	United States Treasury Note 15/06/23, 0.25%	41.625.681	9,41
30.500.000	USD	United States Treasury Note 15/07/23, 0.13%	30.096.536	6,81
30.500.000	USD	United States Treasury Note 15/08/23, 0.13%	29.977.518	6,78
32.000.000	USD	United States Treasury Note 15/09/23, 0.13%	31.349.438	7,09
33.000.000	USD	United States Treasury Note 15/10/23, 0.13%	32.195.174	7,28
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/11/23, 0.25%	9.726.074	2,20
14.500.000	USD	United States Treasury Note 15/12/23, 0.13%	14.045.090	3,18
15.000.000	USD	United States Treasury Note 15/01/24, 0.13%	14.472.039	3,27
10.500.000	USD	United States Treasury Note 15/02/24, 0.13%	10.090.272	2,28
14.500.000	USD	United States Treasury Note 15/03/24, 0.25%	13.910.449	3,15
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/04/24, 0.38%	9.572.358	2,16
12.500.000	USD	United States Treasury Note 15/05/24, 0.25%	11.924.072	2,70
Summe Anleihen			329.209.364	74,45
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			329.209.364	74,45

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
Irland				
608.022.303	USD	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	28.090.630	6,35
Summe Anleihen			28.090.630	6,35
Summe sonstige Wertpapiere			28.090.630	6,35
Summe Kapitalinvestitionen			357.299.994	80,80
Sonstiges Nettovermögen			84.913.327	19,20
Nettoinventarwert			442.213.321	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond

Anzahl der Anteile oder Nennwert		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		Markt- wert USD	% Netto- vermögen	Anzahl der Anteile oder Nennwert		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Währung						Währung					
Aktien											
Bermuda				7.032.033	0,29						
697	USD	Voussoir Re		7.032.033	0,29	4.380.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variabel		11.500.478	0,47
Supranational				59.500.143	2,45						
550	USD	Voussoir Re SideCar		3.388.000	0,14	4.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B1 21/04/25, variabel		3.902.580	0,16
697	USD	Voussoir Re SideCar-Preference		243.253	0,01	4.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C1 21/04/25, variabel		4.276.069	0,18
530	USD	Voussoir Re SideCar-Preference		55.868.890	2,30	10.464.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A2 20/04/26, variabel		8.268.914	0,34
Summe Aktien				66.532.176	2,74						
Anleihen											
Bermuda				594.251.488	24,48						
19.450.000	USD	Acorn Re 07/11/24, variabel		18.610.733	0,77	4.100.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C2 20/04/26, variabel		7.303.838	0,30
10.263.000	USD	Baldwin Re 07/07/25, variabel		9.670.825	0,40	6.000.000	USD	Kilimanjaro Re Series A2 05/05/23, variabel		6.034.500	0,25
2.667.000	USD	Blue Halo Re Series A 24/02/25, variabel		2.020.253	0,08	17.600.000	USD	Kilimanjaro Re Series B2 05/05/23, variabel		17.614.520	0,73
3.500.000	USD	Blue Halo Re Series B 24/02/25, variabel		2.693.688	0,11	921.740	USD	Manatee Re III 08/06/26, variabel		184.348	0,01
500.000	USD	Bowline Re 23/05/25, variabel		469.300	0,02	25.602.000	USD	Merna Reinsurance II 08/07/24, variabel		21.761.699	0,90
6.750.000	USD	Citrus Re 07/06/25, variabel		6.438.150	0,27	15.000.000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/25, variabel		14.739.000	0,61
1.487.500	USD	Eden Re II 22/03/24, ZCP		235.769	0,01	11.500.000	USD	Montoya Re 07/04/25, variabel		10.853.125	0,45
220.000	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP		157.058	0,01	30.000.000	USD	Mystic Re IV 08/01/24, variabel		28.842.749	1,18
24.512.000	USD	Everglades Re II Series A1 14/05/24, variabel		22.647.249	0,93	5.000.000	USD	Nakama Re 14/01/25, variabel		4.899.625	0,20
28.750.000	USD	Everglades Re II Series A2 14/05/24, variabel		26.515.405	1,09	14.880.000	USD	Northshore Re II 07/07/23, variabel		14.788.116	0,61
19.250.000	USD	Everglades Re II Series B1 14/05/24, variabel		16.760.013	0,69	14.962.000	USD	Northshore Re II 08/01/24, variabel		14.407.284	0,59
9.917.000	USD	Four Lakes Re 07/01/25, variabel		9.203.224	0,38	8.491.000	USD	Phoenician Re 14/12/23, variabel		8.335.827	0,34
24.450.000	USD	Galileo Re Series C 08/01/24, variabel		23.265.397	0,96	16.000.000	USD	Phoenician Re Series A 14/12/23, variabel		15.708.800	0,65
9.650.000	USD	Galileo Re Series D 08/01/24, variabel		9.280.405	0,38	5.000.000	USD	Power Protective Re 15/12/23, variabel		4.815.625	0,20
6.400.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel		5.794.560	0,24	2.250.000	USD	Power Protective Re 09/10/24, variabel		2.196.056	0,09
5.000.000	USD	Integrity Re 12/06/28, variabel		4.612.500	0,19	23.000.000	USD	Riverfront Re Series A 07/01/25, variabel		21.450.950	0,88
12.000.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A1 19/12/23, variabel		9.150.000	0,38	5.750.000	USD	Riverfront Re Series B 07/01/25, variabel		4.947.013	0,20
20.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/23, variabel		19.605.038	0,81	9.270.000	USD	Sanders Re II 07/06/23, variabel		9.151.112	0,38
5.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variabel		4.003.125	0,16	9.625.000	USD	Sanders Re II 07/04/24, variabel		9.534.766	0,39
						9.917.000	USD	Sanders Re II Series A 07/04/25, variabel		9.522.799	0,39
						16.447.000	USD	Sanders Re II Series A1 07/04/25, variabel		15.806.389	0,65
						7.750.000	USD	Sanders Re III Series A 07/06/25, variabel		7.379.356	0,30

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen	Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen		
8.250.000	USD	Sanders Re III Series B 07/06/25, variabel	7.499.663	0,31	2.763.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 13/03/24, variabel	2.758.441	0,11		
3.254.964	USD	Sanders Re II 07/04/26, variabel	24.656	-	5.550.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 13/03/24, variabel	5.466.750	0,23		
11.050.000	USD	Sanders Re III Series A 07/04/26, variabel	10.457.720	0,43	6.700.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series C 13/03/24, variabel	6.391.465	0,26		
8.750.000	USD	Sanders Re III Series B 07/04/26, variabel	8.317.750	0,34	4.750.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series D 13/03/24, variabel	4.676.256	0,19		
11.250.000	USD	Sutter Re Series A 23/05/23, variabel	11.270.531	0,46	11.250.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 31/03/26, variabel	11.306.250	0,47		
13.100.000	USD	Sutter Re Series F 23/05/23, variabel	13.134.060	0,54	Vereinigtes Königreich					21.137.366	0,87
6.256.000	USD	Tailwind Re Series A 08/01/25, variabel	5.674.036	0,23	21.450.000	USD	Atlas Capital UK 2019 07/06/23, variabel	21.137.366	0,87		
13.958.000	USD	Tailwind Re Series B 08/01/25, variabel	12.791.111	0,53	Summe Anleihen					788.122.907	32,46
5.152.000	USD	Tailwind Re Series C 08/01/25, variabel	4.622.117	0,19	Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind					854.655.083	35,20
250.000	USD	Tailwind Re Series D 08/01/25, variabel	225.956	0,01	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						
14.500.000	USD	Titania Re 21/06/24, variabel	13.441.863	0,55	Anleihen						
17.107.000	USD	Titania Re 27/12/24, variabel	15.567.798	0,64	Bermuda					899.511.429	37,05
5.750.000	USD	Tomoni Re Series A 07/04/26, variabel	5.535.525	0,23	7.308.000	USD	2001 Cat Re 08/01/24, variabel	6.849.058	0,28		
9.475.000	USD	Tomoni Re Series B 07/04/26, variabel	9.138.401	0,38	37.059.000	USD	Alamo Re 07/06/24, variabel	36.080.641	1,50		
1.384.000	USD	Voussoir Re 01/03/24, variabel	159.298	0,01	2.450.000	USD	Artex 17/01/25, variabel	2.205.000	0,09		
1.460.000	USD	Voussoir Re perpetual, variabel	135.780	0,01	19.855.000	USD	Bonanza Re 20/02/24, variabel	17.188.970	0,71		
3.500.000	USD	Wrigley Re 08/07/24, variabel	3.353.875	0,14	18.996.000	USD	Bonanza Re 23/12/24, variabel	16.697.009	0,69		
Irland					22.555.119	0,93					
9.856.000	EUR	Azzurro Re II DAC 17/01/24, variabel	10.621.759	0,44	12.250.000	USD	Bonanza Re 16/03/25, variabel	10.313.888	0,42		
10.966.000	EUR	Hexagon II Reinsurance DAC 17/01/24, variabel	11.933.360	0,49	6.750.000	USD	Bonanza Re 08/01/26, variabel	6.755.400	0,28		
Singapur					101.500.184	4,18					
37.150.000	USD	Alamo Re II 08/06/23, variabel	37.456.488	1,54	3.333.000	USD	Bowline Re Series 2022- 1 23/05/25, variabel	3.238.259	0,13		
10.533.000	USD	Easton Re 08/01/24, variabel	10.295.481	0,42	24.917.000	USD	Cape Lookout Re 22/03/24, variabel	23.674.265	0,99		
7.750.000	USD	Integrity Re II 12/04/28, variabel	5.231.250	0,22	10.000.000	USD	Cape Lookout Re 28/03/25, variabel	9.464.250	0,39		
6.750.000	USD	Kizuna Re III 07/04/26, variabel	6.358.163	0,26	10.833.000	USD	Commonwealth Re 08/07/25, variabel	10.480.657	0,43		
40.075.000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	37.815.771	1,56	657.278	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP	337.841	0,01		
4.012.000	USD	Phoenix 3 Re 04/01/29, ZCP	4.343.031	0,18							
Supranational					48.678.750	2,00					
18.500.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 29/12/23, variabel	18.079.588	0,74							

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen	Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
1.348.049	USD	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP	688.853	0,03	24.844.000	USD	Kilimanjaro III Re 25/06/25, variabel	23.610.495	0,97
3.260.000	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	2.382.734	0,10	11.406.000	USD	Locke Tavern Re 09/04/26, variabel	11.447.632	0,47
1.500.000	USD	Eden Re II Series A 19/03/27, ZCP	1.526.475	0,06	7.500.000	USD	Matterhorn Re 08/01/24, variabel	6.419.250	0,26
10.000.000	USD	Eden Re II Series B 19/03/27, ZCP	10.176.500	0,42	4.257.000	USD	Matterhorn Re 07/06/24, variabel	4.252.211	0,18
11.000.000	USD	Everglades Re II 04/05/23, variabel	10.557.525	0,43	9.250.000	USD	Matterhorn Re 24/03/25, variabel	8.205.675	0,34
8.750.000	USD	Everglades Re II 19/05/25, variabel	8.275.969	0,34	11.500.000	USD	Matterhorn Re Series A 24/03/25, variabel	10.207.113	0,42
1.250.000	USD	Finca Re 06/06/25, variabel	1.221.750	0,05	14.250.000	USD	Matterhorn Re 08/12/25, variabel	11.970.713	0,49
31.404.000	USD	FloodSmart Re Series A 01/03/24, variabel	29.755.289	1,24	7.600.000	USD	Matterhorn Re 25/01/27, variabel	7.609.543	0,31
5.625.000	USD	FloodSmart Re Series B 01/03/24, variabel	4.964.063	0,20	20.144.000	USD	Merna Reinsurance II 05/04/24, variabel	20.128.388	0,83
21.020.000	USD	FloodSmart Re Series A 25/02/25, variabel	19.758.800	0,81	12.000.000	USD	Merna Reinsurance II Series 2 07/07/25, variabel	11.100.000	0,46
9.250.000	USD	FloodSmart Re Series B 25/02/25, variabel	8.787.500	0,36	19.000.000	USD	Merna Reinsurance II Series 3 07/07/25, variabel	18.556.825	0,76
2.250.000	USD	FloodSmart Re Series C 25/02/25, variabel	2.002.500	0,08	7.900.000	USD	MetroCat Re 08/05/23, variabel	7.854.773	0,32
975.000	USD	FloodSmart Re Series B 27/02/26, variabel	645.938	0,03	23.750.000	USD	Mona Lisa Re 08/07/25, variabel	21.329.281	0,88
17.708.000	USD	FloodSmart Re Series A 11/03/26, variabel	17.710.214	0,73	8.250.000	USD	Mona Lisa Re Series A 08/01/26, variabel	8.334.150	0,34
4.500.000	USD	FloodSmart Re Series B 11/03/26, variabel	4.500.225	0,19	8.171.000	USD	Mona Lisa Re Series B 08/01/26, variabel	8.148.121	0,34
7.917.000	USD	Four Lakes Re 07/01/26, variabel	7.979.346	0,33	8.462.000	USD	Montoya Re 07/04/26, variabel	8.417.575	0,35
4.242.460	USD	Frontline Re 06/07/26, variabel	3.012.146	0,12	13.250.000	USD	Mystic Re IV 08/01/25, variabel	12.164.494	0,50
7.000.000	USD	Herbie Re 08/07/24, variabel	6.409.375	0,26	14.250.000	USD	Mystic Re IV 08/01/26, variabel	14.478.356	0,60
3.833.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	3.577.243	0,15	34.150.000	USD	Nakama Re Series 1 13/04/23, variabel	34.150.853	1,42
1.866.569	USD	Herbie Re 08/01/26, variabel	1.143.273	0,05	12.200.000	USD	Nakama Re Series 2 13/04/23, variabel	12.203.965	0,50
6.000.000	USD	Herbie Re 08/01/27, variabel	6.056.400	0,25	10.918.000	USD	Northshore Re II 08/07/25, variabel	10.536.689	0,43
9.250.000	USD	Hestia Re 22/04/25, variabel	7.631.250	0,31	7.500.000	USD	Pelican IV Re Series A 07/05/24, variabel	39.938	-
6.864.000	USD	Hypatia Series A 07/06/23, variabel	6.910.504	0,28	4.750.000	USD	Pelican IV Re Series B 07/05/24, variabel	83.481	-
2.379.000	USD	Hypatia Series B 07/06/23, variabel	2.348.251	0,10	13.000.000	USD	Phoenician Re 14/12/24, variabel	12.332.450	0,51
5.758.000	USD	Hypatia 08/04/26, variabel	5.779.017	0,24	19.872.000	USD	Sakura Re Series A 07/04/25, variabel	18.856.541	0,78
6.750.000	USD	Integrity Re 06/06/25, variabel	6.412.500	0,26	19.792.000	USD	Sakura Re Series B 07/04/25, variabel	18.970.137	0,78
8.691.000	USD	Integrity Re Series A 06/06/25, variabel	8.711.858	0,36	11.500.000	USD	Sakura Re 05/01/26, variabel	11.505.750	0,47
6.000.000	USD	Isosceles Insurance 10/07/23, variabel	5.940.000	0,24	5.156.000	USD	Sanders Re III 07/04/27, variabel	5.174.819	0,21
3.000.000	USD	Kendall Re 02/05/24, variabel	2.789.850	0,11	10.000.000	USD	Sanders Re III Series A 07/04/27, variabel	10.261.750	0,42
7.857.000	USD	Kilimanjaro III Re 21/04/25, variabel	6.630.719	0,27					

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregeltten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen	Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregeltten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
14.500.000	USD	Sierra Series A 31/01/24, variabel	14.211.813	0,59	5.000.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variabel	4.784.250	0,20
3.500.000	USD	Sierra Series B 31/01/24, variabel	3.407.513	0,14	4.250.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 11 06/06/25, variabel	3.382.575	0,14
2.708.000	USD	Titania Re 27/02/26, variabel	2.715.176	0,11	5.535.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 12 06/06/25, variabel	4.642.481	0,19
3.750.000	USD	Topanga Re 08/01/26, variabel	3.254.250	0,13	4.642.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 13 06/06/25, variabel	4.097.842	0,17
20.000.000	USD	Torrey Pines Re Series A 07/06/24, variabel	19.527.000	0,80	6.500.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 14 06/06/25, variabel	5.965.213	0,25
19.250.000	USD	Torrey Pines Re Series B 07/06/24, variabel	18.608.494	0,77	14.416.667	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 2 06/12/25, variabel	13.006.717	0,54
9.500.000	USD	Torrey Pines Re Series A 06/06/25, variabel	9.302.875	0,38	4.310.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 3 06/12/25, variabel	3.864.669	0,16
5.000.000	USD	Torrey Pines Re Series B 06/06/25, variabel	4.709.750	0,19	6.300.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 13 06/06/26, variabel	5.595.975	0,23
41.725.000	USD	Ursa Re II Series AA 07/12/23, variabel	41.127.288	1,70	2.950.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 14 06/06/26, variabel	2.698.070	0,11
15.200.000	USD	Ursa Re II Series D 07/12/23, variabel	15.103.100	0,62	3.750.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 3 06/12/26, variabel	3.740.250	0,15
21.366.000	USD	Ursa Re II 06/12/24, variabel	19.585.678	0,81	8.500.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 5 06/12/26, variabel	8.485.550	0,35
10.500.000	USD	Ursa Re II Series A 16/06/25, variabel	10.101.000	0,42	9.117.000	USD	Vitality Re XI Series A 09/01/24, variabel	8.998.479	0,37
6.250.000	USD	Ursa Re II Series E 16/06/25, variabel	5.836.875	0,24	3.500.000	USD	Vitality Re XI Series B 09/01/24, variabel	3.437.700	0,14
17.500.000	USD	Ursa Re II Series AA 06/12/25, variabel	17.644.813	0,73	12.044.000	USD	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variabel	11.792.582	0,49
11.250.000	USD	Ursa Re II Series C 06/12/25, variabel	11.432.531	0,47	6.000.000	USD	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variabel	5.845.200	0,24
7.000.000	USD	Veraison Re 09/03/26, variabel	7.021.000	0,29	8.148.000	USD	Vitality Re XIII Series A 06/01/26, variabel	7.857.320	0,32
Kaimaninseln			165.929.613	6,83	4.000.000	USD	Vitality Re XIII Series B 06/01/26, variabel	3.834.600	0,16
1.092.500	USD	Caelus Re V Series B 05/06/24, variabel	942.281	0,04	14.000.000	USD	Vitality Re XIV Series A 05/01/27, variabel	14.004.550	0,58
3.747.995	USD	Caelus Re V Series C 05/06/24, variabel	552.829	0,02	5.550.000	USD	Vitality Re XIV Series B 05/01/27, variabel	5.551.804	0,23
6.850.000	USD	Caelus Re VI 07/06/23, variabel	6.759.066	0,28	China			3.233.750	0,13
13.050.000	USD	Caelus Re VI 07/06/24, variabel	12.631.421	0,52	3.250.000	USD	Great Wall Re 05/01/26, variabel	3.233.750	0,13
7.062.000	USD	Residential Reinsurance 2019 06/12/23, variabel	6.836.546	0,28	Hongkong			6.228.624	0,26
4.000.000	USD	Residential Reinsurance 2019 Series 12 06/06/23, variabel	3.520.000	0,14	6.558.000	USD	Black Kite Re 09/06/25, variabel	6.228.624	0,26
2.250.000	USD	Residential Reinsurance 2019 Series 13 06/06/23, variabel	2.235.431	0,09	Irland			72.269.895	2,97
6.154.000	USD	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variabel	5.657.372	0,23	19.925.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variabel	18.961.128	0,78
5.484.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variabel	5.208.840	0,21					

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
20.000.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity 06/06/25, variabel	18.554.500	0,76
20.000.000	EUR	Lion III Re DAC 16/07/25, variabel	21.420.502	0,88
4.250.000	EUR	Orange Capital Re DAC 17/01/25, variabel	4.590.228	0,19
8.269.000	EUR	Windmill II Re DAC 05/07/24, variabel	8.743.537	0,36
Singapur			77.335.472	3,19
4.000.000	USD	Astro Re 08/07/25, variabel	3.520.000	0,14
9.750.000	USD	Catahoula II Re Series A 16/06/25, variabel	8.919.544	0,37
5.250.000	USD	Catahoula II Re Series B 16/06/25, variabel	5.050.894	0,21
11.466.000	USD	First Coast Re III 07/04/25, variabel	10.294.461	0,42
7.973.000	USD	First Coast Re IV 07/04/26, variabel	7.992.933	0,33
6.957.000	EUR	Hexagon III Re 15/01/26, variabel	6.979.001	0,29
5.000.000	EUR	Hexagon III Re Series CAT 15/01/26, variabel	5.178.487	0,21
17.714.000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	16.919.970	0,71
3.000.000	USD	Phoenix 2 Re 04/01/28, ZCP	3.131.360	0,13
250.000	USD	Phoenix 2 Re Series 22-1 04/01/28, ZCP	309.078	0,01
5.000.000	USD	Umigame Re Series A1 07/04/25, variabel	4.679.375	0,19
2.750.000	USD	Umigame Re Series A2 07/04/25, variabel	2.579.775	0,11
1.875.000	USD	Umigame Re Series B1 07/04/25, variabel	1.780.594	0,07
Vereinigtes Königreich			27.340.994	1,13
29.750.000	USD	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variabel	27.340.994	1,13
USA			71.862.544	2,96
6.315.000	USD	Cosaint Re 03/04/24, variabel	4.823.081	0,20
5.500.000	USD	Gateway Re 12/05/25, variabel	5.134.800	0,21
21.666.000	USD	Gateway Re Series A 24/02/26, variabel	21.721.790	0,89
5.500.000	USD	Gateway Re Series B 24/02/26, variabel	5.513.338	0,23
531.621	USD	JGWPT XXV 15/02/67, 7.14%	544.336	0,02
9.000.000	USD	Lightning Re 31/03/26, variabel	9.029.250	0,37
6.250.000	USD	Logistics Re 20/12/24, variabel	6.021.719	0,25

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
51.919	USD	Putnam Re 07/06/24, 10.18% *	-	-
1.200.000	USD	Security First Managers 25/02/25, variabel	1.200.000	0,05
15.403.000	USD	Vista Re 21/05/24, variabel	14.345.199	0,59
3.750.000	USD	Vista Re 21/05/25, variabel	3.529.031	0,15
Summe Anleihen			1.323.712.321	54,52
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			1.323.712.321	54,52

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Sonstige Wertpapiere	Marktwert USD	% Nettovermögen
Anleihen				
USA				
USA			14.318.887	0,59
13.506.525	USD	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5.96%	12.868.301	0,53
2.400	USD	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP	-	-
1.836.184	USD	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP	1.450.586	0,06
Summe Anleihen			14.318.887	0,59
Summe sonstige Wertpapiere			14.318.887	0,59
Summe Kapitalinvestitionen			2.192.686.291	90,31
Sonstiges Nettovermögen			235.308.962	9,69
Nettoinventarwert			2.427.995.253	100,00

* Notleidendes Wertpapier.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Net- tover- mögen
Aktien				
Niederlande			6.469.468	3,78
9.504	USD	ASML Holding	6.469.468	3,78
USA			123.978.781	72,37
65.434	USD	Amazon.com	6.758.678	3,95
565.325	USD	CCC Intelligent Solutions Holdings	5.070.965	2,96
58.000	USD	Chewy	2.168.040	1,27
67.871	USD	Marvell Technology	2.938.814	1,72
63.789	USD	Meta Platforms	13.519.442	7,88
20.671	USD	Microsoft	5.959.449	3,48
18.278	USD	MongoDB	4.260.967	2,49
35.700	USD	Netflix	12.333.636	7,19
98.333	USD	New Relic	7.403.492	4,32
372.679	USD	News	6.436.166	3,76
114.417	USD	Oracle	10.631.628	6,21
6.600	USD	Roku	434.412	0,25
63.384	USD	Skyworks Solutions	7.478.044	4,37
54.102	USD	Spotify Technology	7.229.109	4,22
87.184	USD	Trimble	4.570.185	2,67
108.569	USD	Walt Disney	10.871.014	6,34
326.985	USD	Warner Bros Discovery	4.937.474	2,88
105.600	USD	Warner Music Group	3.523.872	2,06
167.605	USD	Zillow Group	7.453.394	4,35
Summe Aktien			130.448.249	76,15
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			130.448.249	76,15
Summe Kapitalinvestitionen			130.448.249	76,15
Sonstiges Nettovermögen			40.857.890	23,85
Nettoinventarwert			171.306.139	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% Netto- vermö- gen
Aktien				
Bermuda				
22.567	USD	RenaissanceRe Holdings	4.168.808	0,94
Kanada				
323.356	CAD	Canadian National Railway	35.181.496	7,89
566.027	CAD	Canadian Pacific Railway	40.189.916	9,01
894.062	CAD	Cenovus Energy	14.383.541	3,23
354.987	USD	Teck Resources	11.947.465	2,68
Dänemark				
35.051	DKK	Novo Nordisk	5.108.637	1,15
Frankreich				
66.274	EUR	Safran	9.049.052	2,03
Deutschland				
66.971	EUR	Münchener Rückversicherungs- Gesellschaft in München	21.598.148	4,85
Indien				
86.125	USD	HDFC Bank	5.294.563	1,19
272.595	USD	ICICI Bank	5.424.251	1,21
Norwegen				
485.378	NOK	Norsk Hydro	3.325.766	0,75
Vereinigtes Königreich				
970.600	HKD	HSBC Holdings	6.065.383	1,36
USA				
109.916	USD	Alphabet	10.540.585	2,36
70.217	USD	Analog Devices	12.769.199	2,86
100.956	USD	Applied Materials	11.434.233	2,57
2.564	USD	Booking Holdings	6.270.889	1,41
14.620	USD	Everest Re Group	4.826.420	1,08
21.539	USD	First Citizens BancShares	19.326.511	4,34
128.009	USD	Fiserv	13.341.500	2,99
133.789	USD	KKR	6.479.113	1,45
4.294	USD	Linde	1.407.339	0,32
49.987	USD	Lowe's	9.217.059	2,07
36.824	USD	LPL Financial Holdings	6.872.455	1,54
37.048	USD	Mastercard	12.414.582	2,79

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% Netto- vermö- gen
64.119	USD	Meta Platforms	12.530.549	2,81
47.997	USD	Microsoft	12.759.368	2,86
364.639	USD	Schlumberger	16.508.783	3,70
3.878	USD	Thermo Fisher Scientific	2.061.008	0,46
3.322	USD	UnitedHealth Group	1.447.620	0,32
150.864	USD	Visa	31.363.576	7,04
Summe Aktien			353.307.815	79,26
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			353.307.815	79,26
Summe Kapitalinvestitionen			353.307.815	79,26
Sonstiges Nettovermögen			92.447.750	20,74
Nettoinventarwert			445.755.565	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Helix

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
Aktien				
Belgien			426.527	0,14
16.806	EUR	Azelis Group	426.527	0,14
Brasilien			9.035.889	3,02
582.079	BRL	Aliansce Sonae Shopping Centers	2.020.530	0,68
329.700	BRL	B3 – Brasil Bolsa Balcao	673.023	0,23
94.262	BRL	Banco Bradesco	244.846	0,08
560.726	BRL	Cia Brasileira de Alumínio	838.283	0,28
1.217.673	BRL	Itausa	1.974.118	0,66
52.022	BRL	Lojas Renner	170.012	0,06
151.200	BRL	Petro Rio	930.117	0,31
453.100	BRL	Raia Drogasil	2.184.960	0,72
Britische Jungferninseln			-	-
100.339	USD	Noventiq Holdings	-	-
Chile			2.776.948	0,93
1.037.166	CLP	Cencosud	2.015.010	0,68
107.379	CLP	Empresas Copec	761.938	0,25
China			29.103.203	9,74
3.782	USD	Alibaba Group Holding	386.445	0,13
124.000	HKD	China Mengniu Dairy	508.640	0,17
29.500	HKD	China Merchants Bank	150.695	0,05
130.600	HKD	China Pacific Insurance Group	346.882	0,12
19.000	CNH	China Tourism Group Duty Free	506.977	0,17
12.800	CNH	Chongqing Brewery	232.988	0,08
34.998	CNH	Contemporary Amperex Technology	2.069.363	0,69
144.800	CNH	East Money Information	422.341	0,14
33.200	CNH	Estun Automation	135.705	0,05
24.570	CNH	Foshan Haitian Flavouring & Food	273.847	0,09
6.552	USD	H World Group	320.917	0,11
92.021	CNH	Hangzhou First Applied Material	787.243	0,26
86.190	CNH	Han's Laser Technology Industry Group	380.916	0,13
300.700	CNH	Hengli Petrochemical	709.353	0,24
71.016	CNH	Hongfa Technology	337.019	0,11
98.775	CNH	Huafon Chemical	107.300	0,04
105.100	CNH	Hualan Biological Engineering	334.095	0,11
20.350	HKD	JD.com	445.888	0,15
6.708	USD	JinkoSolar Holding	342.242	0,11

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
2.300	CNH	Kweichow Moutai	609.555	0,20
49.889	CNH	Leader Harmonious Drive Systems	787.423	0,26
385.676	CNH	LONGi Green Energy Technology	2.269.475	0,76
390.174	CNH	Midea Group	3.057.282	1,03
109.560	CNH	NARI Technology	432.509	0,14
1.921	USD	PDD Holdings	145.804	0,05
29.300	CNH	Ping An Insurance Group of China	194.557	0,07
8.183	CNH	Pylon Technologies	292.535	0,10
533.700	CNH	Sany Heavy Industry	1.328.169	0,44
74.700	CNH	Shandong Sinocera Functional Material	308.272	0,10
162.508	CNH	Shenzhen Inovance Technology	1.663.581	0,56
12.400	CNH	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics	562.842	0,19
37.256	CNH	Thunder Software Technology	587.813	0,20
208.300	CNH	Tofflon Science & Technology Group	817.755	0,27
750.843	CNH	Toly Bread	1.702.361	0,57
164.603	CNH	Wanhua Chemical Group	2.298.158	0,77
63.800	CNH	Wuliangye Yibin	1.830.210	0,61
142.200	CNH	Wuxi Lead Intelligent Equipment	838.212	0,28
37.300	CNH	Zhejiang Huayou Cobalt	298.735	0,10
33.890	CNH	Zhejiang Jiechang Linear Motion Technology	121.499	0,04
113.500	HKD	Zylox-Tonbridge Medical Technology	157.600	0,05
Georgien			1.308.825	0,44
47.256	GBP	TBC Bank Group	1.308.825	0,44
Deutschland			420.243	0,14
3.278	EUR	Dr Ing hc F Porsche	420.243	0,14
Griechenland			4.419.184	1,48
242.293	EUR	Alpha Services & Holdings	296.144	0,10
40.753	EUR	Mytilineos	1.160.034	0,39
610.120	EUR	National Bank of Greece	2.963.006	0,99
Ungarn			2.047.530	0,69
97.858	HUF	Richter Gedeon	2.047.530	0,69
Indonesien			1.742.051	0,58
241.900	IDR	Bank Central Asia	141.160	0,05
1.999.900	IDR	Bank Mandiri Persero	1.377.103	0,46
826.500	IDR	Telkom Indonesia Persero	223.788	0,07

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen	Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
Italien			4.119.277	1,38	Südkorea			29.282.574	9,80
2.248	EUR	DiaSorin	237.053	0,08	3.718	KRW	Hana Financial Group	116.237	0,04
39.152	EUR	Eni	548.979	0,18	18.614	KRW	Hankook Tire & Technology	497.574	0,17
51.969	EUR	FinecoBank Banca Fineco	798.369	0,27	707	KRW	Hyundai Motor	100.197	0,03
310.761	EUR	Intesa Sanpaolo	799.330	0,27	3.731	KRW	KB Financial Group	136.561	0,05
5.029	EUR	Moncler	347.167	0,12	4.492	KRW	Korea Zinc	1.908.112	0,64
14.469	EUR	Prysmian	608.358	0,20	5.220	KRW	L&F	1.257.034	0,42
41.238	EUR	UniCredit	780.021	0,26	4.430	KRW	LG Chem	2.422.829	0,81
Japan			526.248	0,18	432	KRW	LG Chem – Preference	103.035	0,03
68.800	JPY	Monstarlab Holdings	526.248	0,18	425	KRW	NAVER	65.945	0,02
Kasachstan			2.443.921	0,82	235.780	KRW	Samsung Electronics	11.591.136	3,88
191.002	USD	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	2.207.983	0,74	92.228	KRW	Samsung Electronics – Preference	3.818.481	1,28
3.125	USD	Kaspi.KZ	235.938	0,08	15.721	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	2.487.634	0,83
Mexiko			2.685.961	0,90	2.621	KRW	Samsung SDI	1.479.767	0,50
61.626	USD	Banco Santander Mexico Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	417.208	0,14	2.345	KRW	SK Hynix	159.594	0,05
426.800	MXN	Grupo Mexico	2.014.867	0,68	6.740	KRW	SK Telecom	250.061	0,08
12.829	USD	Vista Energy	253.886	0,08	107.282	KRW	WONIK IPS	2.888.377	0,97
Peru			103.922	0,03	Schweiz			375.280	0,12
4.554	USD	Intercorp Financial Services	103.922	0,03	10.209	GBP	Wizz Air Holdings	375.280	0,12
Philippinen			3.112.302	1,04	Taiwan			39.450.569	13,20
347.780	PHP	International Container Terminal Services	1.365.148	0,46	104.792	TWD	Advantech	1.276.881	0,43
1.140.800	PHP	Puregold Price Club	656.802	0,22	474.000	TWD	ASE Technology Holding	1.751.375	0,59
1.975.900	PHP	Wilcon Depot	1.090.352	0,36	3.000	TWD	ASMedia Technology	112.817	0,04
Polen			3.409.960	1,14	146.000	TWD	Chroma ATE	851.137	0,28
8.251	PLN	Grupa Kety	1.015.084	0,35	227.000	TWD	CTBC Financial Holding	162.902	0,05
29.910	PLN	Grupa Pracuj	402.683	0,13	16.250	TWD	Dadi Early-Childhood Education Group	62.177	0,02
13.938	PLN	KRUK	997.131	0,33	26.000	TWD	Delta Electronics	257.033	0,09
122.200	PLN	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	995.062	0,33	61.000	TWD	Eclat Textile	991.707	0,33
Katar			1.169.736	0,39	448.000	TWD	Hon Hai Precision Industry	1.530.241	0,51
1.230.945	QAR	Qatar Gas Transport	1.169.736	0,39	165.000	TWD	MediaTek	4.264.882	1,43
Russland			-	-	132.000	TWD	Merida Industry	730.503	0,24
262.653	USD	Fix Price Group	-	-	26.000	TWD	Micro-Star International	122.966	0,04
Slowenien			3.793.821	1,27	84.000	TWD	Nien Made Enterprise	902.143	0,30
255.820	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	3.793.821	1,27	61.000	TWD	Novatek Microelectronics	864.488	0,29
Südafrika			1.688.810	0,57	88.750	TWD	Sporton International	787.010	0,26
13.477	ZAR	Capitec Bank Holdings	1.281.950	0,43	1.289.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	22.564.644	7,56
36.000	ZAR	Tiger Brands	406.860	0,14	78.000	TWD	Uni-President Enterprises	184.192	0,06
					724.000	TWD	United Microelectronics	1.257.890	0,42

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
13.650	TWD	Voltronic Power Technology	775.581	0,26
Thailand			1.796.760	0,60
169.000	THB	Kasikornbank	654.847	0,22
250.200	THB	Kasikornbank-XDR	969.484	0,32
598.600	THB	Land & Houses	172.429	0,06
Vereinigte Arabische Emirate			2.333.890	0,78
1.392.492	AED	Emaar Development	2.089.212	0,70
160.461	AED	Emaar Properties	244.678	0,08
Vereinigtes Königreich			2.841.513	0,95
294.973	PLN	Pepco Group	2.841.513	0,95
USA			1.086.384	0,36
1.511	USD	Mastercard	549.113	0,18
2.383	USD	Visa	537.271	0,18
Vietnam			481.923	0,16
152.000	VND	Vietnam Dairy Products	481.923	0,16
Summe Aktien			151.983.251	50,85
Anleihen				
Angola			447.961	0,15
340.000	USD	Angolan Government International Bond 26/11/29, 8.00%	292.536	0,10
200.000	USD	Angolan Government International Bond 26/11/49, 9.13%	155.425	0,05
Brasilien			1.203.545	0,39
2.096.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10.00%	382.944	0,13
1.210.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/31, 10.00%	214.975	0,07
3.500.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/33, 10.00%	605.626	0,19
Burkina Faso			319.694	0,11
380.000	USD	Endeavour Mining 14/10/26, 5.00%	319.694	0,11
Kolumbien			566.795	0,19
3.430.000.000	COP	Colombian TES 26/03/31, 7.00%	566.795	0,19
Tschechische Republik			317.637	0,11
570.000	EUR	CPI Property Group 27/01/31, 1.50%	317.637	0,11
Ägypten			127.500	0,04

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
200.000	USD	Egypt Government International Bond 29/05/32, 7.63%	127.500	0,04
Ungarn			299.367	0,10
138.000.000	HUF	Hungary Government Bond 24/11/32, 4.75%	299.367	0,10
Elfenbeinküste			537.268	0,18
470.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5.88%	420.929	0,14
140.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 30/01/32, 4.88%	116.339	0,04
Kenia			236.176	0,08
290.000	USD	Kenya Government International Bond 22/05/32, 8.00%	236.176	0,08
Mexiko			1.110.710	0,37
2.700.000	MXN	Mexican Bonos 18/11/38, 8.50%	142.870	0,05
8.110.000	MXN	Mexican Bonos 13/11/42, 7.75%	391.933	0,13
8.870.000	MXN	Mexican Bonos 07/11/47, 8.00%	437.531	0,14
2.900.000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/11/26, 7.47%	138.376	0,05
Nigeria			289.272	0,10
350.000	USD	Nigeria Government International Bond 24/03/29, 8.38%	289.272	0,10
Peru			204.284	0,07
840.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/32, 6.15%	204.284	0,07
Russland			158.945	0,05
38.000.000	RUB	Russian Federal Bond – OFZ 23/03/33, 7.70%	158.945	0,05
Senegal			224.265	0,08
320.000	EUR	Senegal Government International Bond 08/06/37, 5.38%	224.265	0,08
Südafrika			987.337	0,33
3.000.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	147.612	0,05
6.690.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	323.631	0,11
6.500.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8.50%	295.060	0,10
4.819.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/40, 9.00%	221.034	0,07

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
Türkei				
200.000	USD	Pegasus Hava Tasimaciligi 30/04/26, 9.25%	202.400	0,07
Ukraine				
330.000	USD	VF Ukraine PAT via VFU Funding 11/02/25, 6.20%	196.350	0,07
Summe Anleihen			7.429.506	2,49
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			159.412.757	53,34

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
Anleihen				
Brasilien				
241.563	USD	MC Brazil Downstream Trading 30/06/31, 7.25%	189.351	0,07
USA				
40.321.000	USD	United States Treasury Bill 06/04/23, ZCP	40.296.119	13,48
7.056.400	USD	United States Treasury Bill 13/04/23, ZCP	7.045.904	2,36
8.000.000	USD	United States Treasury Bill 20/04/23, ZCP	7.980.548	2,67
8.000.000	USD	United States Treasury Bill 27/04/23, ZCP	7.973.697	2,67
10.074.000	USD	United States Treasury Bill 04/05/23, ZCP	10.031.152	3,36
5.036.600	USD	United States Treasury Bill 11/05/23, ZCP	5.011.708	1,68
2.014.000	USD	United States Treasury Bill 18/05/23, ZCP	2.002.584	0,67
1.006.600	USD	United States Treasury Bill 25/05/23, ZCP	1.000.244	0,33
Summe Anleihen			81.531.307	27,29
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			81.531.307	27,29

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Investitionen	Marktwert USD	% Nettovermögen
Luxemburg			14.576.550	4,88
100.000	USD	Schroder GAIA Asian Equity Long Short	10.397.000	3,48
4.078	USD	Schroder ISF – China A	631.451	0,21
2.007	USD	Schroder ISF Emerging Markets Value	300.511	0,10
10.025	USD	Schroder ISF Indian Equity	3.247.588	1,09
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Investitionen			14.576.550	4,88
Summe Kapitalinvestitionen			255.520.614	85,51
Sonstiges Nettovermögen			43.283.785	14,49
Nettoinventarwert			298.804.399	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermög- en
Anleihen				
Argentinien			954.154	1,50
150.000	USD	Transportadora de Gas del Sur 02/05/25, 6.75%	135.113	0,21
775.000	USD	YPF 27/06/29, 8.50%	595.952	0,94
250.000	USD	YPF Energia Electrica 25/07/26, 10.00%	223.089	0,35
Belgien			198.564	0,31
200.000	EUR	Telenet Finance Luxembourg Notes 01/03/28, 3.50%	198.564	0,31
Kanada			324.759	0,51
300.000	EUR	Primo Water Holdings 31/10/28, 3.88%	284.692	0,45
40.000	USD	Royal Bank of Canada 12/01/26, 4.88%	40.067	0,06
China			154.565	0,24
200.000	USD	Shimao Group Holdings 15/07/26, 5.60%	29.363	0,05
200.000	USD	Shimao Group Holdings 13/07/30, 4.60%	29.202	0,05
200.000	USD	Sino-Ocean Land Treasure IV 05/05/26, 3.25%	96.000	0,14
Frankreich			1.829.017	2,87
50.911	EUR	Accor 07/12/27, 0.70%	52.041	0,08
200.000	EUR	Afflelou 19/05/26, 4.25%	200.964	0,31
100.000	EUR	Altice France 15/01/25, 2.50%	101.265	0,16
200.000	EUR	Altice France 15/07/29, 4.00%	163.076	0,26
100.000	EUR	Banijay Entertainment 01/03/25, 3.50%	105.867	0,17
210.000	EUR	CAB Selas 01/02/28, 3.38%	187.533	0,29
200.000	EUR	Electricite de France perpetual, variabel	212.803	0,33
100.000	EUR	Elis 24/05/27, 4.13%	108.506	0,17
300.000	EUR	Iliad Holding 15/10/28, 5.63%	303.683	0,48
100.000	EUR	Loxam 15/07/26, 3.75%	100.930	0,16
100.000	EUR	Loxam 15/04/27, 4.50%	91.116	0,14
110.000	EUR	Parts Europe 16/07/25, 6.50%	120.302	0,19
16.099	EUR	Safran 01/04/28, ZCP	17.160	0,03
65.573	EUR	Worldline 30/07/25, ZCP	63.771	0,10
Deutschland			933.436	1,46
165.000	EUR	IHO Verwaltungs 15/05/25, 3.63%	178.352	0,28
115.000	EUR	IHO Verwaltungs 15/05/28, 8.75%	127.611	0,20

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermög- en
100.000	EUR	Nidda BondCo 30/09/25, 5.00%	107.203	0,17
100.000	EUR	Nidda Healthcare Holding 21/08/26, 7.50%	106.295	0,17
100.000	EUR	Phoenix PIB Dutch Finance 05/08/25, 2.38%	103.434	0,16
200.000	EUR	Renk 15/07/25, 5.75%	212.936	0,33
100.000	EUR	TUI Cruisesa 15/05/26, 6.50%	97.605	0,15
Indien			283.940	0,45
200.000	USD	Vedanta Resources Finance II 21/01/24, 13.88%	160.255	0,26
200.000	USD	Vedanta Resources Finance II 11/03/25, 8.95%	123.685	0,19
Irland			294.574	0,46
100.000	EUR	eircom Finance DAC 15/05/26, 3.50%	103.170	0,16
100.000	EUR	eircom Finance DAC 15/02/27, 2.63%	97.541	0,15
100.000	EUR	Rockford Tower Europe CLO DAC 20/04/34, variabel	93.863	0,15
Italien			1.061.792	1,66
210.000	EUR	Castor 15/02/29, variabel	217.922	0,33
200.000	EUR	Centurion Bidco 30/09/26, 5.88%	195.291	0,31
200.000	EUR	Lottomatica 15/07/25, 5.13%	214.447	0,34
100.000	EUR	Mooney Group 17/12/26, variabel	106.362	0,17
110.000	EUR	TeamSystem 15/02/28, 3.50%	105.571	0,17
200.000	EUR	Telecom Italia 15/02/28, 6.88%	222.199	0,34
Luxemburg			784.044	1,23
310.000	EUR	Altice Financing 15/01/28, 3.00%	268.940	0,42
205.000	EUR	INEOS Finance 15/05/28, 6.63%	224.797	0,35
100.000	EUR	Matterhorn Telecom 15/11/27, 4.00%	100.514	0,16
200.000	EUR	Summer BC Holdco B 31/10/26, 5.75%	189.793	0,30
Niederlande			945.745	1,48
110.000	EUR	Q-Park Holding I 01/03/26, variabel	117.379	0,18
210.000	EUR	TMNL Holding 15/01/29, 3.75%	199.728	0,31
100.000	EUR	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 3.75%	100.317	0,16
260.000	USD	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 5.50 %	249.395	0,40

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
100.000	EUR	UPC Holding 15/06/29, 3,88%	90.402	0,14	310.000	EUR	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 2,13%	295.300	0,46
120.000	EUR	VZ Vendor Financing II 15/01/29, 2,88%	104.236	0,16	125.000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/27, 5,25%	98.676	0,15
100.000	EUR	Ziggo Bond 28/02/30, 3,38%	84.288	0,13	43.000	USD	AT&T 20/02/26, 5,54%	43.133	0,07
Spanien			684.837	1,07	100.000	EUR	Avantor Funding 15/07/28, 3,88%	101.414	0,16
100.000	EUR	Cellnex Telecom 20/11/31, 0,75%	86.847	0,14	45.000	USD	Celanese US Holdings 05/07/24, 5,90%	45.022	0,07
200.000	EUR	Cirsa Finance International 15/03/27, 4,50%	189.785	0,30	30.000	USD	Cigna Group 15/03/26, 5,69%	30.196	0,05
210.000	EUR	Lorca Telecom Bondco 18/09/27, 4,00%	209.806	0,32	100.000	EUR	Clarios Global 15/05/26, 4,38%	103.806	0,16
100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	92.361	0,14	310.000	EUR	Dana Financing Luxembourg 15/07/29, 3,00%	260.966	0,41
100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	106.038	0,17	200.000	EUR	Energizer Gamma Acquisition 30/06/29, 3,50%	175.011	0,27
Schweden			358.657	0,56	50.000	USD	Energy Transfer 15/03/25, 4,05%	49.039	0,08
100.000	EUR	Samhallsbyggnadsbola- get i Norden perpetual, variabel	40.241	0,06	20.000	USD	Ford Motor Credit 17/11/23, 3,37%	19.645	0,03
200.000	EUR	Verisure Holding 15/07/26, 3,88%	201.760	0,32	65.000	USD	Ford Motor Credit 13/11/30, 4,00%	55.284	0,09
100.000	EUR	Verisure Holding 15/10/27, 9,25%	116.656	0,18	31.000	USD	HCA 15/03/24, 5,00%	30.828	0,05
Vereinigtes Königreich			1.359.395	2,13	27.000	USD	Hewlett Packard Enterprise 01/10/24, 5,90%	27.356	0,04
100.000	GBP	AA Bond 31/01/26, 6,50%	104.854	0,16	20.000	USD	Lowe's 01/04/26, 4,80%	20.109	0,03
200.000	EUR	BCP V Modular Services Finance II 30/11/28, 4,75%	185.117	0,29	85.000	USD	MGIC Investment 15/08/28, 5,25%	80.881	0,13
200.000	EUR	EG Global Finance 30/10/25, 6,25%	201.185	0,32	170.000	USD	MPT Operating Partnership 15/10/27, 5,00%	140.013	0,22
100.000	GBP	Hurricane Finance 15/10/25, 8,00%	111.880	0,18	190.000	USD	Oceaneering International 01/02/28, 6,00%	178.754	0,28
100.000	EUR	Motion Finco 15/05/25, 7,00%	110.110	0,17	70.000	USD	Oracle 01/04/25, 2,50%	67.013	0,11
200.000	GBP	Pinewood Finance 15/11/27, 3,63%	219.753	0,34	110.000	EUR	Silgan Holdings 01/06/28, 2,25%	101.017	0,16
100.000	GBP	Premier Foods Finance 15/10/26, 3,50%	112.584	0,18	55.000	USD	TransDigm 15/03/27, 7,50%	54.918	0,09
100.000	GBP	Thames Water Kemble Finance 19/05/26, 4,63%	109.231	0,17	260.000	USD	TransDigm 15/11/27, 5,50%	245.440	0,38
100.000	GBP	Virgin Media Secured Finance 15/05/29, 5,25%	107.945	0,17	69.000	USD	Zimmer Biomet Holdings 01/04/25, 3,55%	66.908	0,10
110.000	EUR	Vodafone Group 27/08/80, variabel	96.736	0,15	Summe Anleihen			12.568.893	19,70
USA			2.401.414	3,77	Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			12.568.893	19,70
60.000	USD	Advance Auto Parts 09/03/26, 5,90%	61.282	0,10					
52.000	USD	American Tower 15/03/25, 2,40%	49.403	0,08					

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
Anleihen				
Argentinien			176.914	0,28
42.300	USD	Genneia 02/09/27, 8.75%	40.588	0,06
150.000	USD	Pampa Energia 15/04/29, 9.13%	136.326	0,22
Australien			1.445.209	2,27
295.000	USD	Mineral Resources 01/05/27, 8.13%	299.716	0,47
125.000	USD	Mineral Resources 01/05/30, 8.50%	128.413	0,20
262.000	AUD	Ruby Bond Trust 12/03/53, variabel	175.190	0,27
272.000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2021-1 12/03/53, variabel	179.703	0,28
500.000	AUD	Ruby Bond Trust 14/01/54, variabel	331.059	0,52
500.000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2022-1 14/01/54, variabel	331.128	0,53
Bermuda			781.167	1,22
400.000	USD	Eagle Re 25/11/28, variabel	400.694	0,62
400.000	USD	Home Re 25/01/34, variabel	380.473	0,60
Brasilien			131.315	0,21
200.000	USD	Azul Investments 15/06/26, 7.25%	131.315	0,21
Kanada			1.418.211	2,22
15.000	USD	Bombardier 15/03/25, 7.50%	15.017	0,02
255.000	USD	Bombardier 15/06/26, 7.13%	256.148	0,40
405.000	USD	Cascades 15/01/28, 5.38%	385.081	0,60
105.000	USD	GFL Environmental 01/08/28, 4.00%	95.120	0,15
300.000	USD	Intelligent Packaging 15/09/28, 6.00%	258.750	0,41
195.000	USD	Precision Drilling 15/01/26, 7.13%	190.624	0,30
56.000	USD	Shopify 01/11/25, 0.13%	49.504	0,08
100.000	USD	Strathcona Resources 01/08/26, 6.88%	79.623	0,12
55.000	USD	Toronto-Dominion Bank 09/01/26, 5.10%	55.332	0,09
33.000	USD	TransCanada PipeLines 09/03/26, variabel	33.012	0,05
Kaimaninseln			3.744.074	5,87
250.000	USD	ACAM 17/11/34, variabel	235.060	0,37
250.000	USD	ACAM Series 2019-FL1 17/11/34, variabel	238.700	0,37

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
375.000	USD	ICG US CLO 16/01/33, variabel	290.119	0,45
375.000	USD	Marble Point CLO XV 23/07/32, variabel	316.047	0,50
250.000	USD	MP CLO VIII 28/04/34, variabel	223.626	0,35
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI 20/07/34, variabel	216.934	0,34
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI Series 2021-11A 20/07/34, variabel	223.925	0,35
494.941	USD	Pioneer Aircraft Finance 15/06/44, 3.97%	429.319	0,67
375.000	USD	Trinitas CLO XVI 20/07/34, variabel	329.629	0,52
1.000.000	USD	Trinitas CLO XVIII 20/01/35, variabel	873.304	1,37
400.000	USD	TRTX Issuer 15/03/38, variabel	367.411	0,58
Deutschland			381.385	0,60
64.000	USD	Daimler Truck Finance North America 16/01/26, 5.15%	64.245	0,10
17.000	USD	Mercedes-Benz Finance North America 30/03/25, variabel	17.016	0,03
350.000	USD	Mercer International 01/02/29, 5.13%	300.124	0,47
Hongkong			187.433	0,29
240.000	USD	Seaspan 01/08/29, 5.50%	187.433	0,29
Irland			10.862.263	17,02
500.000	EUR	Adagio X EUR CLO DAC 20/07/36, variabel	511.606	0,80
375.000	EUR	Ares European CLO XII DAC 20/04/32, variabel	361.429	0,57
321.530	EUR	Arrow CMBS 2018 DAC 22/05/30, variabel	333.790	0,52
750.000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 15/04/32, variabel	731.756	1,15
750.000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 19/10/34, variabel	720.742	1,13
800.000	EUR	Barings Euro CLO 2022-1 DAC 28/10/34, variabel	850.412	1,33
550.000	EUR	BBAM European CLO I DAC 22/07/34, variabel	516.419	0,81
250.000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund 15/01/37, variabel	241.696	0,38
300.000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund 15/01/37, variabel	300.942	0,47
466.170	EUR	European Loan Conduit No 36 DAC 17/02/30, variabel	487.440	0,76
388.475	EUR	European Loan Conduit No 36 DAC 17/02/30, variabel	401.289	0,63

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
103.751	EUR	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	98.121	0,15	Vereinigtes Königreich				
99.756	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	112.283	0,18	200.000	GBP	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 15/07/28, 4.88%	210.601	0,33
108.734	GBP	Frost CMBS DAC* 20/11/33, variabel	118.917	0,19	USA				
375.000	EUR	Goldentree Loan Management CLO 4 DAC 20/07/34, variabel	353.448	0,55	195.000	USD	Academy 15/11/27, 6.00%	190.440	0,30
800.000	EUR	ICG Euro CLO 19/04/36, variabel	858.649	1,34	125.000	USD	Acadia Healthcare 01/07/28, 5.50%	121.206	0,19
174.770	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 17/08/33, variabel	172.196	0,27	65.000	USD	Acadia Healthcare 15/04/29, 5.00%	61.159	0,10
550.821	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance Series 1A 17/08/33, variabel	544.678	0,85	170.000	USD	Ahead DB Holdings 01/05/28, 6.63%	141.310	0,22
375.000	EUR	Palmer Square European CLO DAC 15/04/35, variabel	350.422	0,55	47.000	USD	Airbnb 15/03/26, ZCP	41.219	0,06
300.000	EUR	Penta CLO 10 DAC 20/11/34, variabel	279.128	0,44	61.000	USD	Alarm.com Holdings 15/01/26, ZCP	51.770	0,08
375.000	EUR	Segovia European CLO 20/07/32, variabel	363.802	0,57	310.000	USD	Albertsons 15/02/28, 5.88%	308.419	0,48
250.000	EUR	St Paul's CLO VII DAC 18/07/34, variabel	241.540	0,38	60.000	USD	Albertsons 15/02/30, 4.88%	56.068	0,09
399.359	GBP	Taurus UK DAC 17/11/29, variabel	459.051	0,72	135.000	USD	Allied Universal 01/06/28, 4.63%	115.025	0,18
310.000	GBP	Taurus UK DAC 17/05/31, variabel	324.636	0,51	280.000	USD	Allied Universal Finance 15/07/26, 6.63%	269.360	0,42
279.432	GBP	Taurus UK DAC 17/08/31, variabel	305.174	0,48	275.000	USD	AMC Networks 15/02/29, 4.25%	169.371	0,27
500.000	EUR	Tikehau CLO VIII DAC 25/10/34, variabel	508.208	0,80	245.000	USD	American Airlines 15/07/25, 11.75%	268.321	0,42
375.000	EUR	Vendome Funding CLO DAC 20/07/34, variabel	314.489	0,49	245.000	USD	APX Group 15/02/27, 6.75%	244.046	0,38
Israel			45.136	0,07	250.000	USD	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 15/05/36, variabel	228.352	0,36
52.000	USD	Wix.com 15/08/25, ZCP	45.136	0,07	265.000	USD	Arconic 15/02/28, 6.13%	261.241	0,41
Japan			64.600	0,10	80.000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 4.13 %	74.708	0,12
64.000	USD	Sumitomo Mitsui Financial Group 13/01/26, 5.46%	64.600	0,10	103.000	USD	AREIT Trust 14/09/36, variabel	91.857	0,14
Luxemburg			104.038	0,16	305.000	USD	ASP Unifrax Holdings 30/09/28, 5.25%	244.092	0,38
130.000	USD	ION Trading Technologies 15/05/28, 5.75%	104.038	0,16	170.000	USD	AssuredPartners 15/01/29, 5.63%	147.107	0,23
Mexiko			151.056	0,24	50.000	USD	Bausch Health 01/02/27, 6.13%	32.411	0,05
200.000	USD	Braskem Idesa 20/02/32, 6.99%	151.056	0,24	55.000	USD	Bausch Health 01/06/28, 4.88%	32.500	0,05
Singapur			79.722	0,12	49.000	USD	Beauty Health 01/10/26, 1.25%	41.038	0,06
2.000	USD	Sea 01/12/25, 2.38%	2.449	-	375.000	USD	BellRing Brands 15/03/30, 7.00%	380.201	0,61
98.000	USD	Sea 15/09/26, 0.25%	77.273	0,12	57.000	USD	Bentley Systems 01/07/27, 0.38%	48.393	0,08
					12.000	USD	BILL Holdings 01/12/25, ZCP	11.034	0,02

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermög- en	Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermög- en
18.000	USD	BioMarin Pharmaceutical 01/08/24, 0.60%	18.513	0,03	35.000	USD	Comstock Resources 15/01/30, 5.88%	30.102	0,05
309.999	USD	Blackbird Capital Aircraft 15/07/46, 2.44%	269.310	0,42	380.000	USD	Consolidated Communications 01/10/28, 6.50%	275.776	0,43
41.000	USD	Blackline 15/03/26, ZCP	34.953	0,05	335.000	USD	Coty 15/04/26, 6.50%	333.663	0,52
11.000	USD	Block 01/05/26, ZCP	9.020	0,01	260.000	USD	Covanta Holding 01/12/29, 4.88%	231.611	0,36
370.000	USD	Bloomin' Brands 15/04/29, 5.13%	330.482	0,52	45.000	USD	Crocs 15/03/29, 4.25%	39.522	0,06
250.000	USD	BRSF 19/08/38, variabel	231.025	0,36	265.000	USD	CSC Holdings 01/02/28, 5.38 %	217.806	0,34
50.000	USD	Cable One 15/03/26, ZCP	39.700	0,06	145.000	USD	CVR Energy 15/02/25, 5.25%	139.364	0,22
235.000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/28, 5.63%	162.423	0,25	11.000	USD	Datadog 15/06/25, 0.13%	11.930	0,02
280.000	USD	Calpine 01/02/29, 4.63%	242.133	0,38	76.000	USD	DigitalOcean Holdings 01/12/26, ZCP	60.060	0,09
165.000	USD	Carnival 01/03/27, 5.75%	135.892	0,21	390.000	USD	Directv Financing 15/08/27, 5.88%	351.549	0,55
20.000	USD	Carnival 01/06/30, 10.50%	19.218	0,03	115.000	USD	DISH DBS 01/12/26, 5.25%	91.353	0,14
500.354	USD	Castlelake Aircraft Structured Trust 2017-1R 15/08/41, 2.74%	447.816	0,71	50.000	USD	DISH DBS 01/12/28, 5.75%	37.406	0,06
120.000	USD	CCO Holdings 01/02/28, 5.00%	110.846	0,17	85.000	USD	Edgewell Personal Care 01/04/29, 4.13%	74.566	0,12
200.000	USD	CCO Holdings 01/09/29, 6.38%	191.180	0,30	24.000	USD	Enphase Energy 01/03/28, ZCP	25.003	0,04
45.000	USD	Ceridian HCM Holding 15/03/26, 0.25%	40.586	0,06	16.000	USD	Etsy 15/06/28, 0.25%	13.325	0,02
67.000	USD	Charles Schwab 13/05/26, variabel	63.871	0,10	9.000	USD	Exact Sciences 15/03/27, 0.38%	8.419	0,01
80.000	USD	Citigo Holding 01/08/24, 9.25%	80.226	0,13	125.000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/29, 4.63%	109.813	0,17
330.000	USD	CITGO Petroleum 15/06/25, 7.00%	325.900	0,51	90.000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/30, 6.75%	74.127	0,12
65.000	USD	Citigroup 01/06/24, variabel	64.981	0,10	405.000	USD	FirstCash 01/01/30, 5.63%	374.167	0,60
220.000	USD	Cloud Software Group Holdings 31/03/29, 6.50%	194.273	0,30	400.000	USD	FMC GMSR Issuer Trust 25/07/26, variabel	343.724	0,54
40.000	USD	Cloudflare 15/08/26, ZCP	33.980	0,05	24.000	USD	Ford Motor 15/03/26, ZCP	24.096	0,04
280.000	USD	Cogent Communications Group 15/06/27, 7.00%	277.928	0,44	160.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/08/27, 9.75%	168.966	0,26
45.000	USD	CommScope 01/07/28, 7.13%	33.245	0,05	195.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/05/28, 5.50%	178.144	0,28
225.000	USD	CommScope 01/09/29, 4.75%	187.763	0,29	210.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/28, 5.00%	182.465	0,29
145.000	USD	CommScope Technologies 15/06/25, 6.00%	136.697	0,21	170.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/29, 6.75%	134.890	0,21
145.000	USD	Community Health Systems 15/03/27, 5.63%	127.446	0,20	500.000	USD	FS Rialto Issuer 17/08/37, variabel	494.385	0,78
30.000	USD	Community Health Systems 15/01/29, 6.00%	25.407	0,04	45.000	USD	General Motors Financial 08/03/24, variabel	44.671	0,07
420.000	USD	Compass Group Diversified Holdings 15/04/29, 5.25%	369.998	0,58					

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
40.000	USD	Goldman Sachs Group 29/09/25, variabel	38.815	0,06	296.829	USD	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 15/03/35, variabel	280.470	0,44
195.000	USD	Graham Packaging 15/08/28, 7.13%	168.809	0,26	25.000	USD	NCR 01/10/28, 5.00%	22.000	0,03
305.000	USD	Gray Television 15/10/30, 4.75%	202.825	0,32	245.000	USD	NCR 15/04/29, 5.13%	212.246	0,33
23.000	USD	Haemonetics 01/03/26, ZCP	19.630	0,03	160.000	USD	NCR 01/09/29, 6.13%	157.963	0,25
40.000	USD	Harley-Davidson Financial Services 08/06/25, 3.35%	38.206	0,06	180.000	USD	Necessity Retail Real Estate Investment Trust 30/09/28, 4.50%	134.843	0,21
200.000	USD	HAT Holdings I 15/04/25, 6.00%	192.239	0,30	245.000	USD	Neptune Bidco US 15/04/29, 9.29%	227.385	0,36
130.000	USD	HAT Holdings I 15/06/26, 3.38%	112.928	0,18	50.000	USD	Nexstar Media 01/11/28, 4.75%	44.527	0,07
350.000	USD	Hawaiian Brand Intellectual Property 20/01/26, 5.75%	332.717	0,52	28.000	USD	NextEra Energy Partners 15/06/24, ZCP	26.138	0,04
170.000	USD	Hess Midstream Operations 15/06/28, 5.13%	161.563	0,25	185.000	USD	NFP 15/08/28, 4.88%	167.105	0,26
350.000	USD	Hunt 15/04/29, 5.25%	273.982	0,43	52.000	USD	Nutanix 01/10/27, 0.25%	43.595	0,07
10.000	USD	Hyundai Capital America 30/03/26, 5.50%	10.019	0,02	52.000	USD	NuVasive 15/03/25, 0.38%	46.046	0,07
25.000	USD	iHeartCommunications 01/05/27, 8.38%	18.250	0,03	56.000	USD	Okta 15/06/26, 0.38%	47.936	0,08
365.000	USD	iHeartCommunications 15/08/27, 5.25%	298.738	0,47	275.000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/28, 4.25%	227.833	0,36
44.000	USD	Intel 10/02/26, 4.88%	44.550	0,07	290.000	USD	OneMain Finance 15/03/26, 7.13%	279.067	0,44
185.000	USD	Iron Mountain 15/03/28, 5.25%	176.480	0,28	330.000	USD	Pediatrix Medical Group 15/02/30, 5.38%	299.033	0,47
180.000	USD	Iron Mountain 15/07/28, 5.00%	167.691	0,26	40.000	USD	Penske Truck Leasing 15/07/25, 4.00%	38.759	0,06
305.000	USD	JB Poindexter 15/04/26, 7.13%	286.279	0,45	50.000	USD	Perficient 15/11/26, 0.13%	39.974	0,06
63.000	USD	JetBlue Airways 01/04/26, 0.50%	48.636	0,08	205.000	USD	Performance Food Group 15/10/27, 5.50%	200.597	0,31
145.000	USD	LABL 01/11/28, 5.88%	129.053	0,20	125.000	USD	Permian Resources Operating 15/02/26, 7.75%	125.468	0,20
245.000	USD	Legends Hospitality Holding 01/02/26, 5.00%	219.491	0,34	360.000	USD	Pike 01/09/28, 5.50%	315.382	0,49
375.000	USD	Level 3 Financing 01/07/28, 4.25%	211.959	0,33	200.000	USD	Post Holdings 15/01/28, 5.63%	196.186	0,31
6.000	USD	LivaNova USA 15/12/25, 3.00%	6.057	0,01	420.000	USD	Prime Security Services Borrower 15/01/28, 6.25%	393.095	0,63
340.000	USD	Medline Borrower 01/10/29, 5.25%	295.313	0,46	293.416	USD	PRPM 25/06/26, variabel	232.317	0,36
295.000	USD	Minerals Technologies 01/07/28, 5.00%	270.360	0,42	200.000	USD	PRPM 25/09/26, variabel	170.147	0,27
67.000	USD	Mondelez International Holdings Netherlands 15/09/25, 4.25%	66.447	0,10	85.000	USD	Rocket Mortgage 15/10/26, 2.88%	76.451	0,12
26.000	USD	MP Materials 01/04/26, 0.25%	24.561	0,04	65.000	USD	Sabine Pass Liquefaction 01/03/25, 5.63%	65.419	0,10
155.000	USD	MPH Acquisition Holdings 01/09/28, 5.50%	124.465	0,20	394.841	USD	Santander Bank Mortgage Credit-Linked Notes 26/02/52, variabel	394.685	0,63
					165.000	USD	SEG Holding 15/10/28, 5.63%	156.831	0,25

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
59.000	USD	Shake Shack 01/03/28, ZCP	43.174	0,07
40.000	USD	Shift4 Payments 01/08/27, 0.50%	37.940	0,06
240.000	USD	Six Flags Entertainment 15/04/27, 5.50%	232.884	0,36
195.000	USD	SK Invictus Intermediate II 30/10/29, 5.00%	162.107	0,25
58.000	USD	Snap 01/03/28, 0.13%	40.977	0,06
335.000	USD	Spirit AeroSystems 15/04/25, 7.50%	335.328	0,53
72.000	USD	Splunk 15/06/27, 1.13%	61.884	0,10
99.000	USD	Spotify USA 15/03/26, ZCP	83.358	0,13
20.000	USD	Sprint 15/09/23, 7.88%	20.165	0,03
55.000	USD	Standard Industries 15/01/28, 4.75%	51.458	0,08
170.000	USD	Standard Industries 15/07/30, 4.38%	148.092	0,23
160.000	USD	Suburban Propane Partners 01/06/31, 5.00%	139.996	0,22
55.000	USD	Tenet Healthcare 01/02/27, 6.25%	54.148	0,08
325.000	USD	Tenet Healthcare 01/10/28, 6.13%	310.887	0,49
52.000	USD	T-Mobile USA 15/02/26, 2.25%	48.416	0,08
95.000	USD	TMS International 15/04/29, 6.25%	73.352	0,11
40.000	USD	Tronox 15/03/29, 4.63%	33.479	0,05
105.000	USD	Uber Technologies 15/09/27, 7.50%	108.379	0,17
110.000	USD	Uber Technologies 15/01/28, 6.25%	109.836	0,17
370.000	USD	United States Treasury Bill 06/04/23, ZCP	369.778	0,58
71.000	USD	Unity Software 15/11/26, ZCP	55.345	0,09
180.000	USD	Univision Communications 01/06/27, 6.63%	170.838	0,27
165.000	USD	Univision Communications 30/06/30, 7.38%	156.146	0,24
80.000	USD	US Foods 01/06/30, 4.63%	72.225	0,11
382.550	USD	Verus Securitization Trust 25/08/67, variabel	375.447	0,60
400.000	USD	Verus Securitization Trust 25/08/67, variabel	371.104	0,58
370.000	USD	VM Consolidated 15/04/29, 5.50%	328.080	0,51
189.000	USD	VMC Finance 16/06/36, variabel	175.388	0,27

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
455.000	USD	VMC Finance Series 2021-FL4 16/06/36, variabel	430.526	0,68
49.000	USD	Warnermedia Holdings 15/03/25, 3.64%	47.340	0,07
370.000	USD	Wash Multifamily Acquisition 15/04/26, 5.75%	350.523	0,55
375.000	USD	Watco 15/06/27, 6.50%	351.976	0,55
85.000	USD	Xerox Holdings 15/08/25, 5.00%	80.113	0,13
115.000	USD	Xerox Holdings 15/08/28, 5.50%	99.651	0,16
11.000	USD	Zscaler 01/07/25, 0.13%	11.655	0,02
Summe Anleihen			45.793.043	71,77
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			45.793.043	71,77

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Sonstige Wertpapiere	Marktwert USD	% Nettovermögen
Anleihen				
Kaimaninseln			692.132	1,08
787.079	USD	Horizon Aircraft Finance I 15/12/38, 4.46%	692.132	1,08
Irland			1.164.789	1,83
500.000	EUR	Dryden 27 R Euro CLO DAC 15/04/33, variabel	453.543	0,71
250.000	EUR	ICG Euro CLO DAC 15/05/35, variabel	226.873	0,36
500.000	EUR	ICG Euro CLO DAC Series 2022-1A 15/05/35, variabel	484.373	0,76
USA			838.813	1,31
100.000	EUR	Darling Global Finance 15/05/26, 3.63%	105.707	0,17
750.000	USD	Voya CLO 20/10/34, variabel	733.106	1,14
Summe Anleihen			2.695.734	4,22
Summe sonstige Wertpapiere			2.695.734	4,22
Summe Kapitalinvestitionen			61.057.670	95,69
Sonstiges Nettovermögen			2.747.117	4,31
Nettoinventarwert			63.804.787	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Aktien				
Schweiz				
135.219	USD	Alcon	9.538.348	5,03
Vereinigtes Königreich				
9.529	USD	Endava	640.158	0,34
USA				
18.164	USD	Abbott Laboratories	1.839.287	0,97
33.331	USD	Activision Blizzard	2.852.800	1,50
11.247	USD	Adobe	4.334.256	2,28
12.086	USD	agilon health	287.043	0,15
27.207	USD	American Express	4.487.795	2,37
28.320	USD	Analog Devices	5.585.270	2,94
3.316	USD	AptarGroup	391.918	0,21
113.181	USD	Boston Scientific	5.662.445	2,98
21.456	USD	Comerica	931.620	0,49
13.016	USD	Constellation Brands	2.940.184	1,55
4.465	USD	CyberArk Software	660.731	0,35
3.845	USD	Danaher	969.094	0,51
93.022	USD	Delta Air Lines	3.248.328	1,71
5.192	USD	DuPont de Nemours	372.630	0,20
22.223	USD	Eaton	3.807.689	2,01
9.612	USD	Eli Lilly	3.300.953	1,74
34.733	USD	Fifth Third Bancorporation	925.287	0,49
1.841	USD	HCA Healthcare	485.435	0,26
13.530	USD	HEICO	1.838.727	0,97
11.174	USD	Hess	1.478.767	0,78
7.279	USD	Inari Medical	449.405	0,24
4.705	USD	Intuit	2.097.630	1,11
18.639	USD	Keysight Technologies	3.009.826	1,59
18.760	USD	Lantheus Holdings	1.548.826	0,82
2.348	USD	Linde	834.573	0,44
11.924	USD	LPL Financial Holdings	2.413.418	1,27
41.605	USD	Medtronic	3.354.195	1,77
12.431	USD	Microsoft	3.583.857	1,89
25.645	USD	Nabors Industries	3.126.382	1,65
4.047	USD	Natera	224.689	0,12
4.919	USD	NextEra Energy	379.157	0,20
216.462	USD	Norwegian Cruise Line Holdings	2.911.414	1,53
13.136	USD	Occidental Petroleum	820.080	0,43
15.340	USD	Option Care Health	487.352	0,26
52.415	USD	PACCAR	3.836.778	2,02
76.571	USD	PacWest Bancorporation	745.036	0,39
4.314	USD	Palo Alto Networks	861.678	0,45

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
41.707	USD	Pfizer	1.701.646	0,90
98.887	USD	Portillo's	2.113.215	1,11
50.201	USD	Regions Financial	931.731	0,49
21.082	USD	Roper Technologies	9.290.627	4,89
31.753	USD	S&P Global	10.947.481	5,76
55.133	USD	Schlumberger	2.707.030	1,43
12.917	USD	Sherwin-Williams	2.903.354	1,53
14.318	USD	Silgan Holdings	768.447	0,41
39.365	USD	Southwest Airlines	1.280.937	0,68
8.340	USD	Splunk	799.639	0,42
12.715	USD	Tenable Holdings	604.090	0,32
11.030	USD	Tenet Healthcare	655.403	0,35
21.366	USD	Texas Instruments	3.974.290	2,10
17.334	USD	Union Pacific	3.488.641	1,84
26.024	USD	US Bancorporation	938.165	0,49
2.104	USD	Vulcan Materials	360.962	0,19
16.130	USD	Waste Connections	2.243.199	1,18
125.829	USD	Wells Fargo	4.703.488	2,48
18.920	USD	Workday	3.907.737	2,06
Summe Aktien			141.583.143	74,64
Anleihen				
USA				
2.111.000	USD	TransDigm 15/11/27, 5.50%	1.992.781	1,05
Summe Anleihen			1.992.781	1,05
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			143.575.924	75,69
Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
USA				
3.741.000	USD	NCL 15/03/26, 5.88%	3.183.853	1,68
2.515.000	USD	Royal Caribbean Cruises 31/08/26, 5.50%	2.355.813	1,24
36.000.000	USD	United States Treasury Bill 11/05/23, ZCP	35.826.000	18,89
Summe Anleihen			41.365.666	21,81
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			41.365.666	21,81
Summe Kapitalinvestitionen			184.941.590	97,50
Sonstiges Nettovermögen			4.744.985	2,50
Nettoinventarwert			189.686.575	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert GBP	% Netto- vermö- gen
Aktien				
Vereinigtes Königreich			2.787.303	8,93
1.296.958	GBP	Comptoir Group	74.575	0,24
547.250	GBP	Everyman Media Group	363.921	1,17
746.167	GBP	Harworth Group	809.592	2,59
170.003	GBP	Team17 Group	646.011	2,07
268.314	GBP	TT Electronics	502.284	1,61
58.000	GBP	Vp	390.920	1,25
Summe Aktien			2.787.303	8,93
Anleihen				
Vereinigtes Königreich			17.678.952	56,64
5.900.000	GBP	United Kingdom Gilt 22/07/23, 0.75%	5.842.067	18,72
4.600.000	GBP	United Kingdom Gilt 07/09/23, 2.25%	4.563.715	14,62
6.850.000	GBP	United Kingdom Gilt 31/01/24, 0.13%	6.643.130	21,28
650.000	GBP	United Kingdom Gilt 22/04/24, 1.00%	630.040	2,02
Summe Anleihen			17.678.952	56,64
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			20.466.255	65,57

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert GBP	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
Vereinigtes Königreich			10.726.374	34,37
1.500.000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 26/06/23, ZCP	1.486.307	4,76
1.500.000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 10/07/23, ZCP	1.483.883	4,75
2.000.000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 04/09/23, ZCP	1.965.081	6,30
5.900.000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 11/09/23, ZCP	5.791.103	18,56
Summe Anleihen			10.726.374	34,37
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			10.726.374	34,37
Summe Kapitalinvestitionen			31.192.629	99,94
Sonstiges Nettovermögen			18.850	0,06
Nettoinventarwert			31.211.479	100,00

* Für Einzelheiten zu den während des Berichtszeitraums vorgenommenen Kapitalmaßnahmen wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen. Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
Deutschland			70.782	0,02
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4,25%	13.455	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4,75%	14.344	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3,25%	12.178	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2,50%	11.032	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2,50%	11.116	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1,25%	8.657	-
USA			24.591	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2,50%	7.968	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3,00%	8.695	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2,50%	7.928	-
Summe Anleihen			95.373	0,02
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			95.373	0,02

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregeltten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
USA			49.360.846	8,73
25.000.000	USD	United States Treasury Bill 09/05/23, ZCP	24.877.556	4,40
25.000.000	USD	United States Treasury Bill 21/09/23, ZCP	24.458.174	4,33
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2,88%	8.508	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3,00%	8.684	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2,50%	7.924	-
Summe Anleihen			49.360.846	8,73
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregeltten Markt gehandelt werden			49.360.846	8,73

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Investitionen	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Luxemburg				
5.000.000	USD	JPMorgan Liquidity Funds-US Dollar Treasury Liquidity Fund	5.000.000	0,88
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Investitionen			5.000.000	0,88
Summe Kapitalinvestitionen			54.456.219	9,63

Termineinlagen				
Finanzen			304.885.000	53,96
75.000.000	USD	Banque 03/04/23, 4,80%	75.000.000	13,28
75.000.000	USD	Credit Agricole 03/04/23, 4,80%	75.000.000	13,27
22.000.000	USD	Mizuho Bank 03/04/23, 4,82%	22.000.000	3,89
57.885.000	USD	Rabobank 03/04/23, 4,79%	57.885.000	10,24
75.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank 03/04/23, 4,81%	75.000.000	13,28
Summe Termineinlagen			304.885.000	53,96
Sonstiges Nettovermögen			205.715.473	36,41
Nettoinventarwert			565.056.692	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Aktien				
Australien			989.498	0,15
172.648	GBP	Glencore	989.498	0,15
Österreich			3.427.444	0,51
31.251	EUR	Addiko Bank	491.430	0,07
54.261	EUR	BAWAG Group	2.628.065	0,39
9.310	EUR	Erste Group Bank	307.949	0,05
Belgien			3.217.905	0,48
37.335	EUR	KBC Group	2.563.005	0,38
7.325	EUR	UCB	654.900	0,10
Bermuda			283.610	0,05
7.062	USD	Seadrill	283.610	0,05
Brasilien			719.706	0,11
230.353	USD	Banco Bradesco	603.524	0,09
224.756	BRL	Hapvida Participacoes e Investimentos	116.182	0,02
Burkina Faso			53.717	0,01
2.229	CAD	Endeavour Mining	53.717	0,01
Kamerun			100.246	0,01
4.641	USD	Golar LNG	100.246	0,01
Kanada			13.000.728	1,93
93.832	CAD	Advantage Energy	542.233	0,08
158.235	CAD	ARC Resources	1.794.852	0,27
88.688	USD	Barrick Gold	1.646.936	0,24
22.167	USD	Canadian Natural Resources	1.226.943	0,18
104.422	USD	Cenovus Energy	1.823.209	0,27
3.200	USD	Clementia Pharmaceuticals	-	-
93.592	CAD	Enerplus	1.348.999	0,20
68.876	CAD	Foran Mining	201.302	0,03
66.440	CAD	Headwater Exploration	310.201	0,05
1.877	CAD	Intact Financial	268.627	0,04
3.109	CAD	Ivanhoe Mines	28.088	-
1.908	CAD	MEG Energy	30.649	-
63.805	CAD	NuVista Energy	516.011	0,08
5.489	USD	Pan American Silver	99.900	0,01
20.127	CAD	Parex Resources	374.393	0,06
104.959	CAD	Peyto Exploration & Development	940.476	0,14
6.684	CAD	Royal Bank of Canada	639.221	0,10
5.024	USD	Shopify	240.851	0,04
4.638	USD	Suncor Energy	144.010	0,02
15.791	CAD	Tourmaline Oil	658.046	0,10

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
5.788	CAD	Vecima Networks	98.501	0,01
4.431	CAD	Vermilion Energy	57.474	0,01
274	USD	Xenon Pharmaceuticals	9.806	-
China			8.890.116	1,32
7.862	TWD	Airtac International Group	305.985	0,05
255.078	HKD	Alibaba Group Holding	3.262.439	0,49
21.943	CNH	Amoy Diagnostics	89.840	0,01
100.218	HKD	Anhui Conch Cement	347.257	0,05
17.145	HKD	Baidu	324.776	0,05
8.949	HKD	China National Building Material	7.342	-
5.880	CNH	China Railway Group	5.886	-
160.062	HKD	China Vanke	252.432	0,04
14.481	CNH	Contemporary Amperex Technology	855.517	0,14
15.446	HKD	Country Garden Holdings	4.349	-
6.859	HKD	Ganfeng Lithium Group	42.640	0,01
3.350	CNH	Ganfeng Lithium Group	32.398	-
951	CNH	Guangzhou Tinci Materials Technology	5.806	-
1.500	CNH	Hangzhou Tigermed Consulting	20.888	-
44.768	HKD	Hope Education Group	3.536	-
33.000	HKD	Innovent Biologics	147.766	0,02
57.000	HKD	Li Ning	449.471	0,07
178.204	HKD	Lifetech Scientific	63.337	0,01
1.090	HKD	Meituan	19.926	-
650	HKD	Ping An Insurance Group of China	4.231	-
47.505	HKD	Remegen	253.262	0,04
1.960	CNH	Sany Heavy Industry	4.874	-
184.200	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer	294.254	0,04
213.249	CNH	Sinoma Science & Technology	748.678	0,11
7.300	HKD	Tencent Holdings	358.774	0,05
145.500	HKD	Venus MedTech Hangzhou	199.439	0,03
35.100	HKD	WuXi AppTec	367.549	0,05
873	HKD	XPeng	4.866	-
240	CNH	Yunnan Energy New Material	3.974	-
11.927	USD	Zai Lab	396.692	0,06
1.132	CNH	Zhejiang HangKe Technology	7.379	-

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
5.039	CNH	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology	4.553	-
Dänemark			1.697.285	0,25
5.629	USD	Ascendis Pharma	603.541	0,09
570	DKK	Genmab	214.828	0,03
21.753	DKK	Vestas Wind Systems	630.168	0,09
7.955	DKK	Zealand Pharma	248.748	0,04
Finnland			2.351.786	0,35
8.604	EUR	Metso Outotec	93.684	0,01
99.366	EUR	Nordea Bank Abp	1.060.706	0,16
107.769	SEK	Nordea Bank Abp	1.148.815	0,17
5.156	EUR	Wartsila Abp	48.581	0,01
Frankreich			7.173.218	1,07
165.066	EUR	ALD	1.933.352	0,30
26.840	EUR	BNP Paribas	1.607.052	0,24
2.003	EUR	Dassault Aviation	396.653	0,06
94.211	EUR	Engie	1.489.052	0,22
5.567	EUR	Publicis Groupe	433.365	0,06
15.012	EUR	Technip Energies	319.994	0,05
10.737	EUR	TotalEnergies	632.983	0,09
28.628	EUR	Vallourec	360.767	0,05
Deutschland			8.368.562	1,24
3.692	EUR	Bayer	235.113	0,03
133.750	EUR	Commerzbank	1.407.293	0,21
91.786	EUR	Deutsche Bank	931.314	0,14
5.477	EUR	Hensoldt	197.202	0,03
33.556	USD	Immatics	231.536	0,03
27.871	EUR	Infineon Technologies	1.138.919	0,17
2.070	EUR	Rheinmetall	614.209	0,09
7.231	EUR	Siemens	1.170.500	0,17
51.145	EUR	Talanx	2.368.431	0,36
457	EUR	Wacker Chemie	74.045	0,01
Griechenland			840.429	0,12
97.111	EUR	Public Power	840.429	0,12
Hongkong			2.854.516	0,42
187.495	HKD	AIA Group	1.974.097	0,29
14.100	HKD	Hong Kong Exchanges & Clearing	625.437	0,09
20.030	USD	Melco Resorts & Entertainment	254.982	0,04
Indien			1.932.304	0,29
133.785	INR	Axis Bank	1.396.739	0,21
49.297	INR	Bharti Airtel	450.186	0,07
15.192	USD	ReNew Energy Global	85.379	0,01

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Irland			4.787.758	0,71
911.363	EUR	AIB Group	3.698.492	0,55
161.316	EUR	Irish Continental Group	763.645	0,11
6.718	USD	Prothena	325.621	0,05
Italien			6.975.444	1,04
10.227	EUR	BFF Bank	101.484	0,02
5.113	EUR	DiaSorin	538.202	0,08
126.241	EUR	FinecoBank Banca Fineco	1.935.884	0,29
233.030	EUR	UniCredit	4.399.874	0,65
Japan			10.904.090	1,62
9.124	JPY	Astellas Pharma	129.396	0,02
10.300	JPY	Bank of Kyoto	484.843	0,07
194	JPY	Calbee	4.049	-
129.900	JPY	Chiba Bank	836.487	0,12
32.635	JPY	Chugai Pharmaceutical	803.739	0,12
34.300	JPY	Concordia Financial Group	126.066	0,02
23.932	JPY	Daiichi Sankyo	869.140	0,13
2.789	JPY	Daikin Industries	496.884	0,07
12.600	JPY	Ebara	581.721	0,09
7.932	JPY	Eisai	448.290	0,07
4.155	JPY	Hitachi	226.941	0,03
10.100	JPY	Japan Steel Works	188.574	0,03
170.700	JPY	Mitsubishi UFJ Financial Group	1.090.088	0,16
89.355	JPY	Nikon	911.889	0,14
569	JPY	Nippon Shinyaku	24.984	-
488	JPY	Nippon Television Holdings	4.194	-
2.230	JPY	Ono Pharmaceutical	46.422	0,01
35.685	JPY	Panasonic Holdings	317.678	0,05
3.959	JPY	Rohm	327.096	0,05
18.000	JPY	Sanken Electric	1.431.594	0,21
207	JPY	Seria	4.088	-
43.100	JPY	Shiga Bank	869.628	0,13
4.800	JPY	Shiseido	223.452	0,03
3.700	JPY	Sony Group	333.982	0,05
9.400	JPY	T&D Holdings	116.177	0,02
200	JPY	Taiyo Yuden	6.688	-
Jersey			1.515.753	0,23
33.781	USD	WisdomTree Brent Crude Oil	1.515.753	0,23
Jordanien			44.983	0,01
2.177	GBP	Hikma Pharmaceuticals	44.983	0,01
Mexiko			771.284	0,11
83.811	GBP	Fresnillo	771.284	0,11

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Niederlande					7.909.719	1,18			
140	EUR	Adyen	221.550	0,03	51.464	GBP	British American Tobacco	1.803.320	0,27
2.665	USD	Argenx	992.926	0,15	43.492	EUR	CNH Industrial	664.112	0,10
30.475	EUR	ASR Nederland	1.214.262	0,18	28.683	GBP	Cranswick	1.062.916	0,16
39.373	EUR	EXOR	3.238.370	0,48	4.480	GBP	Entain	69.441	0,01
20.725	USD	Merus	381.340	0,06	5.924	GBP	Genus	210.028	0,03
65.359	GBP	Shell	1.861.271	0,28	8.105	GBP	IMI	153.374	0,02
Norwegen					74.095	0,01			
44.536	NOK	Aker Carbon Capture	62.849	0,01	2.469	USD	Immunocore Holdings	122.067	0,02
12.201	NOK	PGS	11.246	-	20.568	GBP	Imperial Brands	472.947	0,07
Philippinen					5.070	-			
2.996	PHP	Security Bank	5.070	-	104.730	GBP	John Wood Group	258.390	0,04
Singapur					1.261.104	0,19			
82.296	SGD	AEM Holdings	196.650	0,03	13.528	GBP	London Stock Exchange Group	1.313.023	0,20
47.600	SGD	United Overseas Bank	1.064.454	0,16	108.705	USD	Nomad Foods	2.037.132	0,30
Südafrika					1.240.528	0,18			
37.551	GBP	Anglo American	1.240.528	0,18	20.665	GBP	Persimmon	320.184	0,05
Südkorea					1.677.750	0,25			
34.125	KRW	Samsung Electronics	1.677.612	0,25	12.266	GBP	Smith & Nephew	169.774	0,03
1	KRW	SK Innovation	138	-	35.362	NOK	Subsea 7	418.475	0,06
Spanien					1.575.221	0,23			
203.411	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	1.449.558	0,21	23.327	USD	TechnipFMC	318.414	0,05
12.722	EUR	Grifols	125.663	0,02	18.131	USD	Verona Pharma	364.070	0,05
Schweden					412.316	0,06			
36.007	SEK	Hexagon	412.316	0,06	USA				
Schweiz					4.768.528	0,71			
9.161	CHF	Alcon	647.813	0,10	9.355	USD	Abbott Laboratories	947.287	0,14
4.254	CHF	Cie Financiere Richemont	678.352	0,10	6.595	USD	Acadia Healthcare	476.489	0,07
10.129	CHF	Julius Baer Group	689.917	0,10	38.260	USD	Aclaris Therapeutics	309.523	0,05
91	CHF	Lonza Group	54.444	0,01	8.695	USD	Activision Blizzard	744.205	0,11
11.725	CHF	Novartis	1.073.377	0,16	3.933	USD	AdaptHealth	48.887	0,01
599	CHF	Tecan Group	261.348	0,04	3.663	USD	Addus HomeCare	391.062	0,06
64.662	CHF	UBS Group	1.363.277	0,20	560	USD	Advanced Micro Devices	54.886	0,01
Taiwan					965.102	0,14			
162.997	TWD	Unimicron Technology	789.623	0,11	11.410	USD	AES	274.753	0,04
101.000	TWD	United Microelectronics	175.479	0,03	786	USD	Agilent Technologies	108.735	0,02
Thailand					259.922	0,04			
1.771	USD	Fabrinet	210.324	0,03	8.975	USD	agilon health	213.156	0,03
12.800	THB	Kasikornbank	49.598	0,01	7.147	USD	Akero Therapeutics	273.444	0,04
Vereinigtes Königreich					13.660.354	2,03			
19.525	USD	Abcam	262.807	0,04	16.693	USD	Alkermes	470.576	0,07
33.271	GBP	Admiral Group	836.458	0,12	4.940	USD	Alnylam Pharmaceuticals	989.581	0,15
41.754	EUR	Allfunds Group	275.316	0,04	1.656	USD	Alphabet	171.777	0,03
17.000	GBP	AstraZeneca	2.355.484	0,34	2.521	USD	Amazon.com	260.394	0,04
27.395	GBP	BP	172.622	0,03	1.258	USD	Amedisys	92.526	0,01
					24.688	USD	American Electric Power	2.246.361	0,33
					21.576	USD	American Express	3.558.961	0,53
					1.589	USD	AmerisourceBergen	254.415	0,04
					6.238	USD	AMETEK	906.569	0,13
					2.230	USD	Amicus Therapeutics	24.731	-
					20.802	USD	Antero Midstream	218.213	0,03
					7.565	USD	Apellis Pharmaceuticals	498.987	0,07
					9.178	USD	Apollo Global Management	579.682	0,09
					1.938	USD	Applied Industrial Technologies	275.448	0,04
					837	USD	Aptiv	93.903	0,01
					41.519	USD	Ares Management	3.464.345	0,51

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
1.449	USD	Arista Networks	243.229	0,04	18.842	USD	Dominion Energy	1.053.456	0,16
16.149	USD	Atmos Energy	1.814.502	0,27	10.250	USD	DR Horton	1.001.323	0,15
9.411	USD	AtriCure	390.086	0,06	1.485	USD	Duke Energy	143.258	0,02
2.328	USD	Autodesk	484.596	0,07	4.130	USD	Edison International	291.537	0,04
4.066	USD	Avantor	85.955	0,01	532	USD	Edwards Lifesciences	44.012	0,01
35.440	USD	AZEK	834.258	0,12	21.442	USD	Elanco Animal Health	201.555	0,03
12.248	USD	Baker Hughes	353.477	0,05	1.229	USD	Elevance Health	565.106	0,08
10.428	USD	Bath & Body Works	381.456	0,06	5.453	USD	Eli Lilly	1.872.669	0,28
1.860	USD	Becton Dickinson	460.424	0,07	4.640	USD	Encompass Health	251.024	0,04
5.838	USD	Biogen	1.623.139	0,24	290	USD	Enphase Energy	60.981	0,01
1.171	USD	Bio-Techne	86.876	0,01	857	USD	Enstar Group	198.644	0,03
10.494	USD	Bioxcel Therapeutics	195.818	0,03	7.738	USD	Entergy	833.692	0,12
5.914	USD	BJ's Wholesale Club Holdings	449.878	0,07	1.370	USD	Enviva	39.566	0,01
13.963	USD	Block	958.560	0,14	35.900	USD	EOG Resources	4.115.217	0,61
5.791	USD	Blueprint Medicines	260.537	0,04	89.172	USD	EQT	2.845.479	0,42
197	USD	Booking Holdings	522.525	0,08	12.803	USD	Eversource Energy	1.001.963	0,15
7.600	USD	Boston Scientific	380.228	0,06	10.098	USD	Exact Sciences	684.745	0,10
15.533	USD	Builders FirstSource	1.379.020	0,20	63.971	USD	Exelon	2.679.745	0,40
19.786	USD	BWX Technologies	1.247.309	0,19	11.716	USD	Expro Group Holdings	215.106	0,03
2.883	USD	Cabot	220.953	0,03	7.093	USD	Exxon Mobil	777.818	0,12
28.294	USD	Cactus	1.166.562	0,17	40.811	USD	Federated Hermes	1.638.154	0,24
14.627	USD	Cargurus	273.232	0,04	347	USD	First Solar	75.473	0,01
1.699	USD	Celldex Therapeutics	61.130	0,01	2.019	USD	Five9	145.954	0,02
7.907	USD	Centene	499.801	0,07	2.105	USD	FleetCor Technologies	443.839	0,07
30.620	USD	CenterPoint Energy	902.065	0,13	15.597	USD	Flex	358.887	0,05
813	USD	Charter Communications	290.737	0,04	246	USD	Fluor-Preference	352.134	0,05
10.891	USD	Cheniere Energy	1.716.422	0,26	5.241	USD	FormFactor	166.926	0,02
39.855	USD	Chesapeake Energy	3.030.574	0,45	9.829	USD	Fortive	670.043	0,10
15.206	USD	Chord Energy	2.046.728	0,30	13.886	USD	Freeport-McMoRan	568.076	0,08
2.486	USD	Chubb	482.731	0,07	4.536	USD	Generac Holdings	489.933	0,07
1.089	USD	Civitas Resources	74.422	0,01	108.234	USD	Geron	234.868	0,03
7.248	USD	ConocoPhillips	719.074	0,11	2.518	USD	Glaukos	126.152	0,02
9.624	USD	Consolidated Edison	920.728	0,14	2.380	USD	GoDaddy	184.974	0,03
105.050	USD	Coterra Energy	2.577.927	0,38	13.491	USD	Goldman Sachs Group	4.413.042	0,66
16.204	USD	Crinetics Pharmaceuticals	260.236	0,04	7.024	USD	Green Plains	217.674	0,03
8.483	USD	CTI BioPharma	35.629	0,01	17.250	GBP	GSK	304.085	0,05
24.720	USD	Cytokinetics	869.897	0,13	5.915	USD	Gulfport Energy	473.200	0,07
2.820	USD	Danaher	710.753	0,11	301.658	GBP	Haleon	1.198.243	0,18
597	USD	Deere	246.489	0,04	7.833	USD	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital	224.024	0,03
9.425	USD	Denali Therapeutics	217.152	0,03	54.527	USD	Harmonic	795.549	0,12
1.991	USD	Denbury	174.471	0,03	2.657	USD	HCA Healthcare	700.598	0,10
555	USD	Dexcom	64.480	0,01	12.335	USD	Health Catalyst	143.949	0,02
42.918	USD	Diamond Offshore Drilling	516.733	0,08	4.510	USD	Hologic	363.957	0,05
30.956	USD	Diamondback Energy	4.184.323	0,62	1.453	USD	Humana	705.373	0,10
14.015	USD	DocuSign	817.075	0,12	142	USD	ICON	30.330	-

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
607	USD	IDEXX Laboratories	303.549	0,05	7.716	USD	ON Semiconductor	635.181	0,09
1.852	USD	Illumina	430.683	0,06	8.824	USD	Owens & Minor	128.389	0,02
53.444	USD	ImmunoGen	205.225	0,03	1.230	USD	Palo Alto Networks	245.680	0,04
2.126	USD	Inari Medical	131.259	0,02	781	USD	Paycom Software	237.432	0,04
2.524	USD	Incyte	182.409	0,03	10.719	USD	Pfizer	437.335	0,07
4.378	USD	Insulet	1.396.407	0,21	110.245	USD	PG&E	1.782.662	0,26
7.834	USD	Intel	255.937	0,04	1.686	USD	Phillips 66	170.927	0,03
3.512	USD	Intellia Therapeutics	130.892	0,02	11.749	USD	Portland General Electric	574.409	0,09
10.680	USD	Intra-Cellular Therapies	578.322	0,09	12.167	USD	ProFrac Holding	154.156	0,02
1.491	USD	Intuitive Surgical	380.906	0,06	1.560	USD	Progressive	223.174	0,03
7.246	USD	Johnson Controls International	436.354	0,06	448	USD	PTC Therapeutics	21.701	-
13.391	USD	JPMorgan Chase	1.744.981	0,26	2.661	USD	QuidelOrtho	237.068	0,04
4.889	USD	Karuna Therapeutics	888.038	0,13	27.999	USD	Range Resources	741.134	0,11
25.251	USD	KKR	1.326.183	0,20	493	USD	Regeneron Pharmaceuticals	405.083	0,06
367	USD	KLA	146.495	0,02	3.743	USD	Revolution Medicines	81.073	0,01
4.699	USD	Kymera Therapeutics	139.231	0,02	8.096	USD	Rice Acquisition II	82.863	0,01
1.554	USD	Laboratory of America Holdings	356.519	0,05	10.553	USD	Rice Acquisition II-XNYS	108.010	0,02
4.185	USD	Las Vegas Sands	240.428	0,04	20.464	USD	Rocket Pharmaceuticals	350.548	0,05
7.425	USD	Legend Biotech	358.034	0,05	39.959	USD	Roivant Sciences	294.897	0,04
5.793	USD	Lennar	608.902	0,09	725	USD	S&P Global	249.958	0,04
1.557	USD	Marathon Petroleum	209.930	0,03	9.095	USD	Sage Therapeutics	381.626	0,06
1.982	USD	MasTec	187.180	0,03	3.279	USD	Salesforce	655.079	0,10
12.156	USD	Merck	1.293.277	0,19	520	USD	Sarepta Therapeutics	71.672	0,01
3.529	USD	Meta Platforms	747.936	0,11	28.138	USD	Schlumberger	1.381.576	0,21
1.270	USD	Microsoft	366.141	0,05	1.442	EUR	Schneider Electric	240.332	0,04
917	USD	Mirati Therapeutics	34.094	0,01	4.870	USD	Seagen	986.029	0,15
953	USD	Moderna	146.362	0,02	1.092	USD	Sempra Energy	165.067	0,02
3.703	USD	Moody's	1.133.192	0,17	448	USD	ServiceNow	208.195	0,03
54.282	USD	Morgan Stanley	4.765.961	0,71	21.662	USD	Shoals Technologies Group	493.677	0,07
1.646	USD	Morphic Holding	61.955	0,01	4.693	USD	SiTime	667.485	0,10
30.526	USD	NanoString Technologies	302.207	0,04	35.867	USD	Sitio Royalties	810.594	0,12
20.269	USD	Navigator Holdings	283.766	0,04	10.051	USD	Skyline Champion	756.137	0,11
1.011	USD	Netflix	349.280	0,05	5.237	USD	SolarEdge Technologies	1.591.786	0,24
28.530	USD	Newmont	1.398.541	0,21	3.353	USD	Southern	233.302	0,03
17.198	USD	NextDecade	85.474	0,01	8.437	USD	Southwest Gas Holdings	526.891	0,08
29.957	USD	NextEra Energy	2.309.086	0,34	7.477	USD	Stanley Black & Decker	602.497	0,09
30.763	USD	NiSource	860.133	0,13	201	USD	Stryker	57.379	0,01
5.807	USD	Noble	229.202	0,03	4.259	USD	Super Micro Computer	453.796	0,07
14.522	USD	Northern Oil & Gas	440.743	0,07	11.700	USD	Surgery Partners	403.299	0,06
9.749	USD	NOV	180.454	0,03	1.110	USD	Syndax Pharmaceuticals	23.443	-
10.626	USD	Nuvalent	277.232	0,04	7.197	USD	Syneos Health	256.357	0,04
3.966	USD	NVIDIA	1.101.636	0,16					

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
1.718	USD	Take-Two Interactive Software	204.957	0,03
30.289	USD	Talos Energy	449.489	0,07
17.500	USD	Targa Resources	1.276.625	0,19
170	USD	Teleflex	43.063	0,01
270	USD	Thermo Fisher Scientific	155.620	0,02
2.141	USD	T-Mobile US	310.102	0,05
30.317	USD	Tradeweb Markets	2.395.649	0,36
13.176	USD	Uber Technologies	417.679	0,06
857	USD	Ulta Beauty	467.639	0,07
846	USD	Ultragenyx Pharmaceutical	33.925	0,01
2.438	USD	United Therapeutics	546.014	0,08
2.300	USD	UnitedHealth Group	1.086.957	0,16
10.159	USD	Valero Energy	1.418.196	0,21
900	USD	Vaxcyte	33.732	0,01
3.980	USD	Veeva Systems	731.484	0,11
7.000	USD	Veracyte	156.100	0,02
3.230	USD	Vertex Pharmaceuticals	1.017.676	0,15
10.221	USD	Vicor	479.774	0,07
22.880	USD	Viper Energy Partners	640.640	0,10
7.436	USD	Visa	1.676.521	0,25
6.584	USD	Walmart	970.811	0,14
1.679	USD	Waters	519.869	0,08
81.117	USD	Wells Fargo	3.032.153	0,45
8.776	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	886.903	0,13
29.017	USD	Weyerhaeuser	874.282	0,13
133.540	USD	WisdomTree	782.544	0,12
3.870	USD	Workday	799.310	0,12
12.429	USD	Zillow Group	552.718	0,08
4.788	USD	Zoetis	796.915	0,12
7.821	USD	Zoom Video Communications	577.503	0,09
Summe Aktien			270.260.802	40,17
Anleihen				
Finnland			1.804.391	0,27
520.000	EUR	Finnair perpetual, 10,25%	499.087	0,07
1.360.000	EUR	Finnair perpetual *, 10,25%	1.305.304	0,20
Frankreich			532.853	0,08
200.000	GBP	Dexia Credit Local 22/07/23, 0,50%	243.532	0,04
267.153	EUR	Vallourec 30/06/26, 8,50%	289.321	0,04

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Deutschland			1.674.694	0,25
1.200.000	EUR	Allianz 07/09/38, variabel	1.269.860	0,19
400.000	EUR	Allianz 06/07/47, variabel	404.834	0,06
Ungarn			906.179	0,13
1.175.000	EUR	Hungary Government International Bond 18/11/30, 0,50%	906.179	0,13
Italien			1.932.968	0,29
1.765.000	EUR	Enel perpetual, variabel	1.932.968	0,29
Japan			6.468.917	0,96
470.579.784	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 10/03/29, 0,10%	3.703.679	0,55
353.033.208	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 10/03/31, 0,01%	2.765.238	0,41
Luxemburg			1.364.572	0,20
1.300.000	USD	ArcelorMittal 29/11/32, 6,80%	1.364.572	0,20
Mexiko			12.612.106	1,88
32.186.600	MXN	Mexican Bonos 26/05/33, 7,50%	1.629.541	0,24
2.420.835.400	MXN	Mexico Cetes 23/01/25, ZCP	10.982.565	1,64
Niederlande			1.890.496	0,28
1.740.000	EUR	Koninklijke KPN perpetual, variabel	1.890.496	0,28
Peru			2.480.541	0,37
2.530.000	PEN	Peru Government Bond 12/02/29, 5,94%	635.151	0,09
1.825.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/32, 6,15%	443.624	0,07
6.280.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/34, 5,40%	1.401.766	0,21
Rumänien			684.145	0,10
694.000	USD	Romanian Government International Bond 25/11/27, 5,25%	684.145	0,10
Südkorea			1.410.501	0,21
1.010.000	USD	Export-Import Bank of Korea 27/04/23, variabel	1.010.576	0,15
200.000	USD	Korea Development Bank 16/04/23, variabel	200.063	0,03
200.000	USD	Korea Development Bank 09/03/24, variabel	199.862	0,03
Supranational			8.156.163	1,22
127.500.000	ZAR	Asian Development Bank 30/04/40, ZCP	1.382.342	0,21

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
16.000.000	TRY	European Bank for Reconstruction & Development 15/10/26, ZCP	355.087	0,05
40.000.000	MXN	European Bank for Reconstruction & Development 19/01/32, ZCP	693.452	0,10
5.110.000	EUR	European Union 04/07/34, 3.25%	5.634.593	0,85
7.200.000	TRY	International Finance 09/05/27, ZCP	90.689	0,01
Vereinigtes Königreich			4.036.694	0,60
320.000	GBP	AA Bond 31/07/29, 7.38%	379.470	0,06
2.295.000	EUR	British American Tobacco perpetual, variabel	1.860.175	0,28
460.000	GBP	Heathrow Funding 09/08/49, 2.75%	354.804	0,05
1.640.000	EUR	Vodafone Group 27/08/80, variabel	1.442.245	0,21
USA			499.886	0,07
500.000	USD	United States Treasury Note 31/10/23, variabel	499.886	0,07
Summe Anleihen			46.455.106	6,91
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			316.715.908	47,08

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
Anleihen				
Kanada			28.099.902	4,18
500.000	CAD	CDP Financial 23/05/23, ZCP	367.534	0,05
400.000	USD	CDP Financial 26/06/23, ZCP	396.493	0,06
1.000.000	USD	CDP Financial 28/06/23, ZCP	988.676	0,15
1.750.000	CAD	City of Edmonton Canada 16/06/23, ZCP	1.282.743	0,20
400.000	CAD	City of Montreal Canada 11/05/23, 0.45%	294.758	0,04
1.000.000	CAD	City of Montreal Canada 01/09/23, 3.50%	736.730	0,11
1.178.000	CAD	City of Ottawa Ontario 05/04/23, ZCP	871.191	0,13
500.000	CAD	City of Ottawa Ontario 26/04/23, ZCP	368.816	0,05

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
500.000	CAD	City of Quebec Canada 01/05/23, 3.00%	369.458	0,05
310.000	CAD	City of Quebec Canada 25/09/23, 4.00%	228.698	0,03
700.000	CAD	City of Toronto Canada 29/09/23, 3.90%	516.339	0,08
700.000	CAD	Hydro Quebec Interest Strip 15/08/23, ZCP	509.659	0,08
600.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 12/04/23, ZCP	443.341	0,07
1.000.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 19/04/23, ZCP	738.253	0,11
500.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 03/05/23, ZCP	368.477	0,05
500.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 17/05/23, ZCP	367.834	0,05
400.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 31/05/23, ZCP	293.733	0,04
700.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 06/04/23, ZCP	517.625	0,08
900.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 27/04/23, ZCP	663.783	0,10
500.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 18/05/23, ZCP	367.778	0,05
700.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 25/05/23, ZCP	514.438	0,08
200.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 15/06/23, ZCP	146.611	0,02
1.010.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 22/06/23, ZCP	739.799	0,11
1.250.000	CAD	Ontario Teachers' Finance Trust 01/08/23, ZCP	910.831	0,14
1.205.000	CAD	Ontario Treasury Bill 19/04/23, ZCP	889.645	0,13
2.275.000	CAD	Ontario Treasury Bill 26/04/23, ZCP	1.678.139	0,26
400.000	CAD	Ontario Treasury Bill 09/08/23, ZCP	291.174	0,04
500.000	CAD	Ontario Treasury Bill 06/09/23, ZCP	362.599	0,05
200.000	CAD	Ontario Treasury Bill 27/09/23, ZCP	144.776	0,02
1.500.000	CAD	Ontario Treasury Bill 18/10/23, ZCP	1.081.921	0,16
1.000.000	CAD	Prince Edward Island Treasury Note 30/05/23, ZCP	734.451	0,11

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
1.000.000	CAD	Province of British Columbia 18/07/23, ZCP	726.319	0,11
1.300.000	CAD	Province of British Columbia Canada Principal Strip 08/09/23, ZCP	943.876	0,14
750.000	CAD	Province of Manitoba Canada Treasury Bill 12/04/23, ZCP	554.191	0,08
1.520.000	CAD	Province of New Brunswick Canada Treasury Bill 20/04/23, ZCP	1.122.064	0,17
910.000	CAD	Quebec Treasury Bill 28/07/23, ZCP	663.705	0,10
500.000	CAD	Quebec Treasury Bill 25/08/23, ZCP	363.117	0,05
500.000	CAD	Quebec Treasury Bill 01/09/23, ZCP	363.059	0,05
425.000	CAD	Regional Municipality of York 25/05/23, ZCP	312.328	0,05
3.595.000	CAD	Regional Municipality of York 14/06/23, ZCP	2.635.828	0,40
550.000	CAD	Regional Municipality of York 23/06/23, ZCP	402.708	0,06
1.480.000	CAD	Saskatchewan Canada Coupon Strip 11/04/23, ZCP	1.093.737	0,16
1.000.000	CAD	Saskatchewan Canada Coupon Strip 20/06/23, ZCP	732.667	0,11
Japan			30.103.092	4,47
686.500.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 04/04/23, ZCP	5.170.448	0,78
209.700.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 10/04/23, ZCP	1.579.409	0,23
53.950.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 17/04/23, ZCP	406.350	0,06
172.650.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 20/04/23, ZCP	1.300.435	0,19
309.800.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 24/04/23, ZCP	2.333.505	0,35
321.200.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 08/05/23, ZCP	2.419.510	0,36
366.450.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 15/05/23, ZCP	2.760.461	0,41
31.950.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 22/05/23, ZCP	240.692	0,04
421.100.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 29/05/23, ZCP	3.172.315	0,47
491.350.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 05/06/23, ZCP	3.701.556	0,55
17.200.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 12/06/23, ZCP	129.590	0,02
271.000.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 19/06/23, ZCP	2.041.922	0,30
218.050.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 26/06/23, ZCP	1.643.272	0,24
305.200.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 03/07/23, ZCP	2.299.969	0,34
119.950.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 10/07/23, ZCP	903.658	0,13
Macau			871.200	0,13
800.000	USD	Wynn Macau 07/03/29, 4.50%	871.200	0,13
Südkorea			2.721.725	0,40
500.000	USD	Export-Import Bank of Korea 30/05/23, ZCP	495.731	0,07
1.000.000	USD	Korea Development Bank 26/05/23, ZCP	993.010	0,14
250.000	USD	Korea Development Bank 07/07/23, ZCP	246.699	0,04
1.000.000	USD	Korea Development Bank * 07/07/23, ZCP	986.285	0,15
Schweiz			1.802.306	0,27
1.867.000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7.25%	-	-
200.000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7.50 %	-	-
325.000	USD	Credit Suisse Group perpetual *, 7.50%	-	-
650.000	CHF	Switzerland Treasury Bill 13/04/23, ZCP	710.200	0,11
500.000	CHF	Switzerland Treasury Bill 20/04/23, ZCP	546.188	0,08
500.000	CHF	Switzerland Treasury Bill 04/05/23, ZCP	545.918	0,08
USA			154.966.734	23,04
1.415.000	USD	Airbnb 15/03/26, ZCP	1.240.955	0,18
680.000	USD	Carnival 01/12/27, 5.75%	737.460	0,11
1.220.000	USD	Federal Home Loan Bank Discount Notes 25/05/23, ZCP	1.211.399	0,18
375.000	USD	ON Semiconductor 01/03/29, 0.50%	391.728	0,06
1.214.000	USD	PPL Capital Funding 15/03/28, 2.88%	1.224.544	0,18
655.000	USD	Royal Caribbean Cruises 15/01/30, 7.25%	660.502	0,10
715.000	USD	Southern 15/12/25, 3.88%	726.606	0,11
1.370.000	USD	Spirit Loyalty Cayman 20/09/25, 8.00%	1.379.851	0,22
490.000	USD	Transocean 15/02/30, 8.75%	500.241	0,07
1.310.000	USD	United States Cash Management Bill 17/04/23, ZCP	1.307.313	0,19
12.351.000	USD	United States Treasury Bill 04/04/23, ZCP	12.346.342	1,84

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
270.000	USD	United States Treasury Bill 06/04/23, ZCP	269.854	0,04
1.795.000	USD	United States Treasury Bill 11/04/23, ZCP	1.792.712	0,27
10.773.000	USD	United States Treasury Bill 18/04/23, ZCP	10.749.292	1,60
15.647.000	USD	United States Treasury Bill 25/04/23, ZCP	15.598.498	2,32
1.600.000	USD	United States Treasury Bill 27/04/23, ZCP	1.594.647	0,24
1.485.000	USD	United States Treasury Bill 02/05/23, ZCP	1.479.056	0,22
2.178.000	USD	United States Treasury Bill 04/05/23, ZCP	2.169.116	0,32
6.068.000	USD	United States Treasury Bill 09/05/23, ZCP	6.038.095	0,90
15.700.000	USD	United States Treasury Bill 11/05/23, ZCP	15.622.809	2,32
4.125.000	USD	United States Treasury Bill 16/05/23, ZCP	4.101.952	0,61
8.965.000	USD	United States Treasury Bill 23/05/23, ZCP	8.906.956	1,32
9.500.000	USD	United States Treasury Bill 25/05/23, ZCP	9.437.684	1,40
9.700.000	USD	United States Treasury Bill 30/05/23, ZCP	9.630.556	1,43
2.860.000	USD	United States Treasury Bill 01/06/23, ZCP	2.838.300	0,43
4.790.000	USD	United States Treasury Bill 06/06/23, ZCP	4.750.436	0,71
13.105.000	USD	United States Treasury Bill 08/06/23, ZCP	12.993.501	1,93
340.000	USD	United States Treasury Bill 13/06/23, ZCP	336.742	0,05
5.615.000	USD	United States Treasury Bill 15/06/23, ZCP	5.562.111	0,83
1.660.000	USD	United States Treasury Bill 20/06/23, ZCP	1.642.362	0,24
755.000	USD	United States Treasury Bill 22/06/23, ZCP	747.003	0,11
1.655.000	USD	United States Treasury Bill 27/06/23, ZCP	1.635.721	0,24
2.610.000	USD	United States Treasury Bill 29/06/23, ZCP	2.579.988	0,38
2.530.000	USD	United States Treasury Bill 05/07/23, ZCP	2.497.525	0,37
1.525.000	USD	United States Treasury Bill 11/07/23, ZCP	1.503.926	0,22
4.560.000	USD	United States Treasury Bill 13/07/23, ZCP	4.499.285	0,67
2.615.000	USD	United States Treasury Bill 20/07/23, ZCP	2.577.846	0,38
1.500.000	USD	United States Treasury Bill 27/07/23, ZCP	1.477.175	0,22

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
210.000	USD	United States Treasury Bill 03/08/23, ZCP	206.645	0,03
Summe Anleihen			218.564.959	32,49
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			218.564.959	32,49

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
Kanada				
1.250.000	CAD	Toronto Hydro 10/04/23, 2,91%	924.570	0,14
Summe Anleihen			924.570	0,14
Summe sonstige Wertpapiere			924.570	0,14

Anzahl der Anteile oder Nennwert	Währung	Optionsscheine	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
USA				
3.660	USD	Metals Acquisition Warrants 12/07/26	2.672	-
2.024	USD	Rice Acquisition II Warrants 12/03/26	2.965	-
Summe Optionsscheine			5.637	-
Summe Kapitalinvestitionen			536.211.074	79,71
Sonstiges Nettovermögen			136.530.228	20,29
Nettoinventarwert			672.741.302	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023

Die Gesellschaft

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

Die Investitionsstrategie der einzelnen Teilfonds beruht auf einer alternativen Investitionsstrategie, 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 Board of Directors ausgegeben. Anleger können sich bei der Verwaltungsgesellschaft oder bei ihrer Vertriebsstelle erkundigen, ob innerhalb der Anteilsklassen und Teilfonds ausschüttende Anteile erhältlich sind.

Das Board of Directors kann beschließen, in jedem Teilfonds verschiedene Anteilsklassen einzuführen, deren Vermögenswerte in Übereinstimmung mit der besonderen Investitionspolitik 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. Dieser Wert kann aufgrund dieser variablen Faktoren unterschiedlich ausfallen. 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 Board of Directors ganz oder teilweise erlassen werden kann.

Anteilsklassen	Ausgabeaufschlag
Anteile der Klassen A ¹ , A2 und K	Bis zu 3,09278 % des Nettoinventarwerts je Anteil
Anteile der Klasse A1	Bis zu 2,04081 % des Nettoinventarwerts je Anteil
Anteile der Klassen C, C1, E, F und P	Bis zu 1,01010 % des Nettoinventarwerts je Anteil
Anteile der Klassen I, IF, IZ, N, PI, R, S, X, Y, Y1 und Y2	Kein Ausgabeaufschlag

Vertriebsgebühr

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

Swing-Pricing

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

Die Nettomittelflüsse 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 31. März 2023, dem letzten Berechnungstag des Berichtszeitraums, wurden Swing-Pricing-Anpassungen für Schroder GAIA Blue Trend und Schroder GAIA IndusPacifiChoice vorgenommen. In der folgenden Tabelle sind die offiziellen Nettoinventarwerte je Anteil dieser Teilfonds nach Anwendung der Swing-Pricing-Anpassung zu diesem Termin aufgeführt. Alle sonstigen in diesem Bericht aufgeführten Finanzinformationen werden vor den Swing Pricing-Anpassungen ausgewiesen.

	Währung	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Nettoinventarwert je Anteil * (einschließlich Swing-Pricing-Anpassung) zum 31. März 2023			
Klasse A Thes.	EUR	199,79	-
Klasse A Thes.	USD	-	114,20
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	CHF	-	101,67
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	EUR	-	103,45
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	GBP	190,41	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	SGD	-	156,60
Klasse A Thes., in USD abgesichert	USD	205,22	-
Klasse A Aussch. GBP	GBP	195,22	-
Klasse A1 Thes.	EUR	185,95	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	USD	196,28	-
Klasse C Thes.	EUR	217,62	-
Klasse C Thes.	USD	-	117,72
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	USD	-	147,22
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	CHF	-	105,12
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	EUR	-	106,69

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

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

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Swing-Pricing (Forts.)

	Währung	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	GBP	205,78	89,85
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	GBP	205,78	89,85
Klasse C Thes., in USD abgesichert	USD	223,76	-
Klasse C Aussch.	EUR	216,46	-
Klasse C Aussch. GBP	GBP	212,83	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	CHF	-	5.244,20
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	EUR	-	5.352,46
Klasse E Thes.	EUR	216,09	-
Klasse E Thes.	USD	-	121,27
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	CHF	-	107,94
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	EUR	-	109,75
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	GBP	-	92,44
Klasse X Thes.	EUR	216,62	-

Mindestanlage bei Erstzeichnung, Mindestanlage bei Folgezeichnungen und Mindestbeteiligung

Teilfonds	Anteilklassen	Mindestanlage	Mindestanlage bei Folgezeichnungen	Mindestens zu haltende Anlagesumme
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *				
	A- und C-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000
	I-Anteile	USD 5.000.000	USD 2.500.000	USD 5.000.000
	IZ-Anteile	USD 100.000.000	USD 20.000.000	USD 100.000.000
Schroder GAIA BlueTrend				
	A-, C-, E- und N-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000
Schroder GAIA Cat Bond				
	A-, C-, F- und PI-Anteile	USD 100.000	USD 50.000	USD 100.000
	I-Anteile	USD 5.000.000	USD 2.500.000	USD 5.000.000
	IF-Anteile	USD 1.000.000	USD 500.000	USD 1.000.000
	Y-, Y1- und Y2*-Anteile	USD 100.000.000	USD 2.500.000	USD 100.000.000
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 Sirius US Equity				
	A-, C- und E-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000
	X-Anteile	USD 100.000.000	USD 2.500.000	USD 100.000.000
Schroder GAIA Tellworth 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	Entfällt	Entfällt	Entfällt
Schroder GAIA Two Sigma Diversified				
	C- und K-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000
Schroder GAIA Wellington Pagosa				
	A-, C-, C1- und E-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden

Der Finanzbericht 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 die nächsten bis zu vier Dezimalstellen gerundet. Weitere Details zu den Regeln für die Bewertung des Gesamtvermögens befinden sich 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 einem Wertpapier, das nicht an einer amtlichen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt wird oder zum Handel zugelassen ist, oder bei Wertpapieren, die zwar gehandelt werden oder zum Handel zugelassen sind, deren letzter verfügbarer Kurs aber nicht ihren tatsächlichen Wert widerspiegelt, muss das Board of Directors 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 das Board of Directors 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

Das Board of Directors behält sich das Recht vor, Fair Value Pricing immer dann anzuwenden, wenn dies für angebracht erachtet wird.

Zum 31. März 2023 wurde die Fair-Value-Anpassung auf die folgenden Wertpapiere angewandt:

Teilfonds	Wertpapiername
Schroder GAIA Cat Bond	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP
	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP
	Putnam Re 07/06/24, 10.18%
	Voussoir Re perpetual, variabel
Schroder GAIA Helix	CFD auf MAGNIT PJSC
	CFD auf TRINITY LIMITED
	Fix Price Group
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Clementia Pharmaceuticals
	Credit Suisse Group perpetual, 7.25%
	Credit Suisse Group perpetual, 7.50 %
	Credit Suisse Group perpetual *, 7.50%

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 Dividenden erträge 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 Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Verwaltungsgebühren

Die Anlageverwalter sind berechtigt, Verwaltungsgebühren für ihre Dienste zu beziehen, die auf der Grundlage der Nettoinventarwerte der Teilfonds täglich berechnet und verbucht sowie monatlich gezahlt werden. Die für den Berichtszeitraum tatsächlich anfallenden Gebühren sind in der folgenden Tabelle dargestellt:

Teilfonds	Anteilsklasse	Managementgebühr
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *	A*-Anteile	2,00 %
	C*- und IZ*-Anteile	1,25 %
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA BlueTrend	A-Anteile	1,60 %
	C-, E- und N-Anteile	1,00 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Cat Bond	A- und F-Anteile	1,50 %
	C- und IF-Anteile	1,10 %
	PI-Anteile (Effektivzins)	bis zu 1,10 % (0,46 %)
	Y-Anteile (Effektivzins)	bis zu 1,10 % (0,88 %)
	Y1-Anteile (Effektivzins)	bis zu 1,50 % (1,28 %)
	Y2*-Anteile (Effektivzins)	bis zu 1,10 % (0,24 %)
	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 (Effektivzins)	bis zu 1,00 % (0,35 %)
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00 % (0,60 %)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Oaktree Credit	Anteile der Klasse A2	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 Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *	C- und R-Anteile	0,75 %
	K-Anteile	1,25 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C-Anteile	1,40 %
	K-Anteile	1,90 %
	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 Mitglieder des Board of Directors

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini erhielt für den Berichtszeitraum eine Vergütung in Höhe von 10.083 EUR. Bernard Herman und Eric Bertrand erhielten für den Berichtszeitraum jeweils eine Vergütung in Höhe von 9.243 EUR. Hugh Mullan erhielt für den Berichtszeitraum eine Vergütung in Höhe von 8.000 EUR. Die verbleibenden Mitglieder des Board of Director verzichteten auf ihr Honorar.

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Performancegebühren

Die Performancegebühr wird dann fällig, wenn der Fonds eine sog. Outperformance erzielt, d. h. dass der Zuwachs des Nettoinventarwertes pro Anteil während des entsprechenden Wertentwicklungszeitraums die High-Water-Mark übersteigt, d. h. als Referenz gilt der jeweils am Ende eines vorhergehenden Wertentwicklungszeitraums verzeichnete Nettoinventarwert je 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 Berichtszeitraums 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 Berichtszeitraums umlaufenden Anteile. Für I-Anteile wird keine Performancegebühr berechnet.

Nähere Einzelheiten zur Berechnung der während des Berichtszeitraums angefallenen Performancegebühren sind in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt. Weitere Angaben zur Berechnung der Performancegebühren sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Die für den Berichtszeitraum zahlbaren Gebühren sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Fällige Performancegebühren“ ausgewiesen. Die für die einzelnen Anteilsklassen während des Berichtszeitraums in Rechnung gestellten Performancegebühren sind auf den Seiten 136–137 aufgeführt.

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

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

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

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

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

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

** Der Anlageverwalter des Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * ist mit Wirkung zum 5. Dezember 2022 statt „BennBridge Ltd.“ nun „Tellworth Investments LLP“.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Gebühren für Verwahrstelle und 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.

Reinvestition 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 reinvestieren.

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

Devisenterminkontrakte

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

Am 31. März 2023 waren die folgenden Teilfonds in Devisenterminkontrakten engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *					
Absicherung des Portfolios					
AUD	2.489.000	USD	1.736.518	17. Apr. 2023	(71.970)
GBP	470.000	USD	571.405	17. Apr. 2023	8.542
NZD	260.000	USD	165.358	17. Apr. 2023	(2.773)
SGD	1.270.000	USD	957.524	17. Apr. 2023	(2.822)
USD	82.925	AUD	124.000	17. Apr. 2023	(1)
USD	82.732	GBP	68.000	17. Apr. 2023	(1.176)
USD	63.655	SGD	85.332	17. Apr. 2023	(491)
					USD (70.691)
Schroder GAIA BlueTrend					
Absicherung des Portfolios					
AUD	37.100.000	USD	24.807.913	19. Apr. 2023	4.906
AUD	8.560.000	USD	5.728.863	20. Apr. 2023	(3.654)
BRL	1.641.410	USD	309.771	20. Apr. 2023	13.246
BRL	379.730	USD	70.800	25. Mai 2023	3.426
BRL	291.802.390	USD	55.178.568	21. Jun. 2023	1.556.231
CAD	87.406.514	USD	63.930.362	19. Apr. 2023	756.983
CAD	685.000	USD	501.715	20. Apr. 2023	5.244
CHF	26.367.427	USD	28.902.180	19. Apr. 2023	(37.307)
CHF	5.670.000	USD	6.171.201	20. Apr. 2023	36.519
CLP	31.842.861.584	USD	39.103.459	22. Jun. 2023	595.792
CNH	170.734.047	USD	24.879.311	19. Apr. 2023	(8.773)
EUR	43.600.000	USD	46.898.732	19. Apr. 2023	424.880
EUR	15.280.000	USD	16.422.446	20. Apr. 2023	163.462
GBP	34.300.000	USD	41.752.325	19. Apr. 2023	573.342
GBP	2.640.000	USD	3.254.303	20. Apr. 2023	3.484
HUF	11.327.343.292	USD	31.276.982	19. Apr. 2023	892.820
IDR	257.817.835.748	USD	17.010.653	21. Jun. 2023	148.261
ILS	76.662.537	USD	21.140.585	19. Apr. 2023	184.976
INR	4.837.067.172	USD	58.507.529	21. Jun. 2023	73.528
JPY	4.887.214.910	USD	36.703.586	19. Apr. 2023	191.393
JPY	143.515.000	USD	1.089.940	20. Apr. 2023	(6.320)
KRW	28.527.844.715	USD	22.066.834	21. Jun. 2023	(46.963)
MXN	1.217.809.319	USD	66.837.351	19. Apr. 2023	544.826
NOK	541.577.440	USD	51.166.128	19. Apr. 2023	597.600
NZD	41.500.000	USD	25.804.582	19. Apr. 2023	146.461

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
PHP	1.123.479.489	USD	20.493.807	21. Jun. 2023	129.008
PLN	159.772.023	USD	36.189.353	19. Apr. 2023	791.699
SEK	208.208.406	USD	19.820.769	19. Apr. 2023	256.819
SEK	20.415.000	USD	1.967.603	20. Apr. 2023	1.132
SGD	63.687.627	USD	47.400.800	19. Apr. 2023	478.372
THB	477.207.490	USD	13.931.222	19. Apr. 2023	47.004
TRY	26.315.000	USD	1.342.919	20. Apr. 2023	3.951
TWD	936.011.786	USD	31.026.003	21. Jun. 2023	(20.429)
USD	61.914.829	AUD	92.100.000	19. Apr. 2023	317.513
USD	12.423.615	AUD	18.550.000	20. Apr. 2023	16.766
USD	311.205	BRL	1.641.410	20. Apr. 2023	(11.812)
USD	21.233.646	BRL	113.628.207	21. Jun. 2023	(858.954)
USD	108.565.639	CAD	149.077.118	19. Apr. 2023	(1.762.563)
USD	8.685.156	CAD	11.855.000	20. Apr. 2023	(88.559)
USD	24.125.751	CHF	22.419.883	19. Apr. 2023	(417.678)
USD	7.586.077	CHF	6.960.000	20. Apr. 2023	(33.979)
USD	18.283.897	CLP	15.004.183.714	22. Jun. 2023	(422.175)
USD	30.118.737	CNH	208.497.583	19. Apr. 2023	(252.749)
USD	10.562	CZK	230.000	20. Apr. 2023	(57)
USD	37.419.895	EUR	35.100.000	19. Apr. 2023	(677.783)
USD	29.485.509	EUR	27.130.000	20. Apr. 2023	36.839
USD	33.281.676	GBP	27.700.000	19. Apr. 2023	(899.692)
USD	5.256.083	GBP	4.265.000	20. Apr. 2023	(6.970)
USD	806.633	GBP	700.000	21. Jun. 2023	(58.237)
USD	1.405.327	HKD	11.015.000	20. Apr. 2023	879
USD	16.482.886	HUF	6.166.913.141	19. Apr. 2023	(1.031.226)
USD	5.970	HUF	2.125.000	20. Apr. 2023	(63)
USD	14.408.374	IDR	221.745.409.516	21. Jun. 2023	(349.761)
USD	37.863.202	ILS	137.057.434	19. Apr. 2023	(262.679)
USD	54.702.286	INR	4.563.679.220	21. Jun. 2023	(567.807)
USD	53.328.328	JPY	7.242.192.443	19. Apr. 2023	(1.345.048)
USD	5.286.148	JPY	694.030.000	20. Apr. 2023	45.826
USD	5.590.224	KRW	7.271.484.040	20. Apr. 2023	(785)
USD	31.021.915	KRW	40.165.490.751	21. Jun. 2023	19.260
USD	38.197.679	MXN	721.678.768	19. Apr. 2023	(1.733.271)
USD	613.818	MXN	11.460.000	20. Apr. 2023	(20.148)
USD	72.893.244	NOK	762.707.076	19. Apr. 2023	(5.959)
USD	41.632.284	NZD	67.600.000	19. Apr. 2023	(639.780)
USD	514.515	NZD	825.000	20. Apr. 2023	(1.380)
USD	7.314.335	PHP	405.337.274	21. Jun. 2023	(126.118)
USD	17.933.356	PLN	79.177.531	19. Apr. 2023	(393.185)
USD	191.665	PLN	835.000	20. Apr. 2023	(1.592)
USD	31.108.159	SEK	326.879.251	19. Apr. 2023	(412.890)
USD	4.494.873	SEK	46.720.000	20. Apr. 2023	(10.605)
USD	24.727.123	SGD	33.298.118	19. Apr. 2023	(305.782)
USD	275.072	SGD	365.000	20. Apr. 2023	662
USD	16.175.992	THB	562.269.722	19. Apr. 2023	(293.853)
USD	473.613	THB	16.135.426	20. Apr. 2023	924
USD	2.375.182	TRY	46.325.000	20. Apr. 2023	4.148
USD	52.264.304	TWD	1.571.597.699	21. Jun. 2023	204.821

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
USD	35.771.487	ZAR	657.864.223	19. Apr. 2023	(1.128.016)
USD	1.180.460	ZAR	21.535.000	20. Apr. 2023	(27.327)
ZAR	473.856.381	USD	25.944.146	19. Apr. 2023	634.387
					USD (4.364.539)
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	238.958.049	USD	44.739.496	28. Apr. 2023	2.218.284
CHF	2.203.721	USD	2.408.674	28. Apr. 2023	6.122
EUR	113.201.995	USD	121.641.036	28. Apr. 2023	1.291.301
GBP	154.626.561	USD	188.988.590	28. Apr. 2023	1.853.973
SEK	134.851.570	USD	12.956.401	28. Apr. 2023	54.015
USD	3.460.000	BRL	18.236.551	28. Apr. 2023	(123.675)
USD	4.920	CHF	4.495	28. Apr. 2023	(6)
USD	927.376	EUR	858.041	28. Apr. 2023	(4.419)
USD	1.690.923	GBP	1.382.241	28. Apr. 2023	(15.063)
USD	122.430	SEK	1.274.903	28. Apr. 2023	(572)
					USD 5.279.960
					USD 915.421
Schroder GAIA Cat Bond					
Absicherung des Portfolios					
USD	70.444.487	EUR	64.500.000	13. Apr. 2023	459.709
					USD 459.709
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	235.230.905	USD	257.101.466	28. Apr. 2023	660.122
EUR	712.057.998	USD	765.094.319	28. Apr. 2023	8.169.014
GBP	7.720.851	USD	9.436.327	28. Apr. 2023	92.870
JPY	1.265.709	USD	9.800	28. Apr. 2023	(230)
SEK	6.901.956.213	USD	663.119.747	28. Apr. 2023	2.777.741
SGD	373.513	USD	280.359	28. Apr. 2023	521
USD	148.445	CHF	135.993	28. Apr. 2023	(574)
USD	1.561.629	EUR	1.448.826	28. Apr. 2023	(11.732)
USD	8.540	GBP	6.981	28. Apr. 2023	(76)
USD	6.186	SEK	64.388	28. Apr. 2023	(26)
					USD 11.687.630
					USD 12.147.339
Schroder GAIA Contour Tech Equity					
Absicherung des Portfolios					
AUD	2.844.205	USD	1.931.719	10. Mai 2023	(28.031)
EUR	3.285.275	USD	3.528.918	10. Mai 2023	41.255
JPY	448.732.383	USD	3.427.932	10. Mai 2023	(28.895)
NOK	53.714.674	USD	5.226.385	10. Mai 2023	(87.293)
USD	1.581.819	AUD	2.311.420	10. Mai 2023	34.733
USD	4.542.677	EUR	4.220.750	10. Mai 2023	(44.092)
USD	3.127.932	JPY	413.334.022	10. Mai 2023	(2.971)
USD	5.492.660	NOK	56.710.489	10. Mai 2023	66.944
					USD (48.350)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2.293.573	USD	2.506.842	28. Apr. 2023	6.411
EUR	54.392.824	USD	58.443.800	28. Apr. 2023	624.389
GBP	17.566.680	USD	21.469.655	28. Apr. 2023	211.422
SEK	86.420.138	USD	8.302.997	28. Apr. 2023	34.777

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)					
SGD	874.432	USD	656.346	28. Apr. 2023	1.222
USD	147.802	EUR	136.139	28. Apr. 2023	(41)
					USD 878.180
					USD 829.830
Schroder GAIA Egerton Equity					
Absicherung des Portfolios					
CHF	7.918.000	EUR	7.910.880	13. Apr. 2023	72.607
EUR	40.263.185	CAD	58.593.000	13. Apr. 2023	302.060
EUR	5.742.878	INR	508.015.000	17. Apr. 2023	51.805
EUR	5.056.436	JPY	732.359.000	13. Apr. 2023	(33.866)
EUR	3.844.333	SEK	42.866.000	13. Apr. 2023	36.004
EUR	319.407.155	USD	341.852.000	13. Apr. 2023	4.346.640
GBP	7.139.000	EUR	8.015.134	13. Apr. 2023	102.855
INR	265.749.000	EUR	2.985.273	17. Apr. 2023	(8.201)
KRW	2.772.839.000	EUR	1.991.381	14. Apr. 2023	(27.347)
TWD	27.764.000	EUR	854.277	14. Apr. 2023	(13.014)
USD	29.917.000	EUR	27.926.676	13. Apr. 2023	(354.318)
					EUR 4.475.225
Absicherung der Anteilsklasse					
EUR	293.489	GBP	258.459	28. Apr. 2023	(255)
EUR	2.485.962	USD	2.681.758	28. Apr. 2023	16.473
GBP	19.917.272	EUR	22.659.208	28. Apr. 2023	(22.730)
USD	194.734.467	EUR	181.198.189	28. Apr. 2023	(1.877.418)
					EUR (1.883.930)
					EUR 2.591.295
Schroder GAIA Helix					
Absicherung des Portfolios					
AUD	14.228.000	USD	9.926.930	17. Apr. 2023	(393.267)
AUD	12.402.517	USD	8.302.484	25. Mai 2023	19.826
BRL	3.273.000	USD	635.492	04. Apr. 2023	10.038
CAD	4.061.000	USD	2.961.917	25. Mai 2023	41.254
CHF	2.636.000	EUR	2.667.517	25. Mai 2023	(4.952)
CHF	5.229.000	USD	5.674.923	25. Mai 2023	81.313
DKK	4.430.000	EUR	595.514	25. Mai 2023	(543)
DKK	23.525.000	USD	3.390.872	25. Mai 2023	52.256
EUR	29.979.491	USD	32.159.821	25. Mai 2023	508.217
GBP	2.170.000	EUR	2.471.765	25. Mai 2023	(7.460)
GBP	231.000	USD	278.249	06. Apr. 2023	7.382
GBP	2.887.000	USD	3.509.907	17. Apr. 2023	60.682
GBP	15.778.000	USD	19.279.081	25. Mai 2023	250.540
HKD	436.232.000	USD	55.784.435	25. Mai 2023	(69.315)
INR	393.525.000	USD	4.741.551	25. Mai 2023	32.051
JPY	3.066.632.375	USD	23.564.618	25. Mai 2023	(343.015)
NOK	9.264.000	EUR	808.903	25. Mai 2023	5.271
NOK	12.369.000	USD	1.159.455	25. Mai 2023	24.460
NZD	1.650.000	USD	1.049.409	17. Apr. 2023	(17.044)
NZD	220.000	USD	136.971	25. Mai 2023	679
SEK	19.993.000	EUR	1.784.504	25. Mai 2023	(11.085)
SEK	58.477.569	USD	5.604.203	25. Mai 2023	50.958
SGD	7.596.000	USD	5.727.610	17. Apr. 2023	(12.069)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)					
SGD	4.909.000	USD	3.672.330	25. Mai 2023	25.969
USD	768.426	AUD	1.146.000	25. Mai 2023	(561)
USD	612.062	BRL	3.273.000	04. Apr. 2023	(33.469)
USD	337.554	CAD	461.000	25. Mai 2023	(3.363)
USD	403.056	CHF	369.000	25. Mai 2023	(3.149)
USD	203.696	DKK	1.405.000	25. Mai 2023	(1.940)
USD	2.820.838	EUR	2.620.931	25. Mai 2023	(35.137)
USD	402.705	GBP	331.000	17. Apr. 2023	(6.670)
USD	10.853.688	GBP	8.883.769	25. Mai 2023	(142.424)
USD	2.906.898	HKD	22.746.000	25. Mai 2023	1.802
USD	2.673.570	JPY	350.040.364	25. Mai 2023	22.943
USD	111.150	NOK	1.170.093	25. Mai 2023	(847)
USD	3.434.494	SEK	35.834.514	25. Mai 2023	(30.937)
USD	403.927	SGD	543.000	17. Apr. 2023	(4.648)
USD	150.627	SGD	200.000	25. Mai 2023	(47)
					USD 73.699
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	1.025.643	USD	1.121.029	28. Apr. 2023	4.570
EUR	196.617.104	USD	211.263.244	28. Apr. 2023	2.638.396
GBP	17.269.616	USD	21.106.504	28. Apr. 2023	257.104
JPY	1.271.399	USD	9.844	28. Apr. 2023	(254)
SEK	65.469	USD	6.291	28. Apr. 2023	32
SGD	31.072	USD	23.323	28. Apr. 2023	65
USD	3.885.873	EUR	3.601.388	28. Apr. 2023	(32.110)
USD	574.650	GBP	464.678	28. Apr. 2023	(188)
USD	197	SEK	2.039	28. Apr. 2023	0
					USD 2.867.615
					USD 2.941.314
Schroder GAIA Oaktree Credit					
Absicherung des Portfolios					
AUD	42.000	USD	29.737	19. Apr. 2023	(1.647)
EUR	17.436.702	USD	18.599.051	19. Apr. 2023	326.814
EUR	189.993	USD	206.045	20. Jul. 2023	1.231
GBP	33.730	USD	41.285	19. Apr. 2023	337
USD	1.087.330	AUD	1.570.944	19. Apr. 2023	36.668
USD	18.974.097	EUR	17.436.704	19. Apr. 2023	48.233
USD	19.686.718	EUR	18.340.296	20. Jul. 2023	(321.853)
USD	2.321.528	GBP	1.906.583	19. Apr. 2023	(31.165)
					USD 58.618
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	104.508	USD	114.227	28. Apr. 2023	289
EUR	10.739.859	USD	11.539.716	28. Apr. 2023	123.294
GBP	1.744.811	USD	2.133.230	28. Apr. 2023	20.242
USD	231	GBP	190	28. Apr. 2023	(3)
					USD 143.822
					USD 202.440

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity					
Absicherung des Portfolios					
CAD	147.000	USD	107.594	21. Jun. 2023	1.315
CHF	486.000	USD	540.143	21. Jun. 2023	(4.386)
DKK	2.553.000	USD	370.993	21. Jun. 2023	2.638
GBP	2.293.000	USD	2.844.660	21. Jun. 2023	(11.592)
USD	3.808.685	CAD	5.210.000	21. Jun. 2023	(51.308)
USD	9.312.667	EUR	8.617.000	21. Jun. 2023	(74.555)
USD	24.274.946	GBP	19.874.000	21. Jun. 2023	(279.955)
					USD (417.843)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2.980.327	USD	3.257.507	28. Apr. 2023	8.279
EUR	35.435.513	USD	38.074.599	28. Apr. 2023	406.793
GBP	4.423.847	USD	5.406.685	28. Apr. 2023	53.299
USD	554.525	EUR	508.244	28. Apr. 2023	2.596
					USD 470.967
					USD 53.124
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *					
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	782.489	GBP	699.868	28. Apr. 2023	(5.146)
EUR	14.434.693	GBP	12.687.705	28. Apr. 2023	13.022
GBP	7.751.802	EUR	8.801.048	28. Apr. 2023	7.980
GBP	5.473	USD	6.777	28. Apr. 2023	(19)
USD	1.373.357	GBP	1.123.708	28. Apr. 2023	(10.972)
					GBP 4.865
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
AUD	12.871.001	USD	8.735.727	21. Jun. 2023	(107.021)
BRL	4.831.206	USD	919.949	06. Apr. 2023	32.982
BRL	4.831.206	USD	930.958	28. Apr. 2023	18.425
CAD	9.593.291	USD	7.054.566	21. Jun. 2023	52.928
CHF	2.576.524	USD	2.777.623	21. Jun. 2023	62.686
CNH	28.336.840	USD	4.139.490	21. Jun. 2023	10.160
CZK	7.261.459	USD	327.766	21. Jun. 2023	6.443
EUR	17.000.000	USD	18.365.751	21. Jun. 2023	153.777
GBP	14.447.674	USD	17.520.527	21. Jun. 2023	329.991
ILS	532.724	USD	145.574	21. Jun. 2023	3.038
INR	580.429	USD	7.039	10. Apr. 2023	21
JPY	2.036.973.057	USD	15.285.510	21. Jun. 2023	236.259
KRW	3.934.695.902	USD	3.049.000	21. Jun. 2023	(11.915)
MXN	257.139.852	USD	13.753.210	21. Jun. 2023	296.906
NOK	13.392.484	USD	1.306.407	21. Jun. 2023	(22.648)
NZD	9.220.921	USD	5.749.246	21. Jun. 2023	16.435
PLN	27.182.160	USD	6.116.537	21. Jun. 2023	149.939
SEK	13.828.772	USD	1.336.567	21. Jun. 2023	1.341
SGD	4.915.283	USD	3.689.539	21. Jun. 2023	13.443
TWD	3.409.000	USD	112.620	06. Apr. 2023	(632)
USD	3.967.117	AUD	5.846.185	21. Jun. 2023	47.840
USD	933.945	BRL	4.831.206	06. Apr. 2023	(18.986)
USD	13.380.400	CAD	18.188.174	21. Jun. 2023	(94.887)

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)					
USD	21.268.644	CHF	19.717.977	21. Jun. 2023	(468.064)
USD	7.653.822	CNH	52.346.240	21. Jun. 2023	(11.768)
USD	44.975.019	EUR	42.000.000	21. Jun. 2023	(779.107)
USD	11.318.689	GBP	9.377.586	21. Jun. 2023	(267.590)
USD	659.753	HUF	239.934.747	21. Jun. 2023	(8.233)
USD	522.096	ILS	1.908.000	21. Jun. 2023	(10.168)
USD	7.056	INR	580.429	10. Apr. 2023	(4)
USD	7.030	INR	580.429	28. Apr. 2023	(22)
USD	21.594.416	JPY	2.891.553.018	21. Jun. 2023	(439.265)
USD	4.103.990	KRW	5.354.854.598	21. Jun. 2023	(29.277)
USD	2.821.397	MXN	52.650.750	21. Jun. 2023	(55.438)
USD	2.324.091	NOK	23.824.536	21. Jun. 2023	40.349
USD	1.694.698	NZD	2.718.759	21. Jun. 2023	(5.294)
USD	1.710.704	SEK	17.694.924	21. Jun. 2023	(1.248)
USD	6.425.121	SGD	8.599.386	21. Jun. 2023	(53.321)
USD	111.807	TWD	3.409.000	06. Apr. 2023	(180)
USD	112.993	TWD	3.409.000	27. Apr. 2023	750
USD	324.075	TWD	9.764.684	21. Jun. 2023	618
USD	1.306.872	ZAR	23.953.911	21. Jun. 2023	(29.146)
ZAR	27.635.984	USD	1.506.716	21. Jun. 2023	34.669
					USD (905.214)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	3.680.545	USD	4.022.902	28. Apr. 2023	10.170
EUR	132.393.013	USD	142.253.044	28. Apr. 2023	1.519.883
GBP	81.716.032	USD	99.872.441	28. Apr. 2023	982.786
USD	7.266	CHF	6.649	28. Apr. 2023	(20)
USD	2.570.212	EUR	2.369.032	28. Apr. 2023	(2.450)
USD	846	GBP	687	28. Apr. 2023	(2)
					USD 2.510.367
					USD 1.605.153
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Absicherung des Portfolios					
AUD	50.855.000	USD	34.103.774	04. Apr. 2023	(109.746)
AUD	16.975.000	USD	11.389.563	03. Mai 2023	(30.876)
AUD	650.000	USD	437.002	21. Jun. 2023	(1.243)
BRL	118.693.000	USD	22.702.463	04. Apr. 2023	715.545
BRL	52.203.000	USD	10.063.338	03. Mai 2023	185.931
BRL	9.278.000	USD	1.717.035	10. Mai 2023	102.026
BRL	14.925.000	USD	2.854.255	02. Jun. 2023	58.442
BRL	4.606.000	USD	832.460	16. Jun. 2023	63.957
CAD	46.885.000	USD	34.451.797	04. Apr. 2023	239.287
CAD	13.915.000	USD	10.225.144	03. Mai 2023	75.183
CAD	3.695.000	USD	2.685.342	21. Jun. 2023	52.216
CHF	48.712.000	USD	52.708.583	04. Apr. 2023	531.485
CHF	5.910.000	USD	6.467.348	03. Mai 2023	12.212
CHF	358.000	USD	388.594	21. Jun. 2023	6.059
CLP	23.894.525.000	USD	29.903.446	04. Apr. 2023	156.720
CLP	1.784.545.000	USD	2.208.595	06. Apr. 2023	35.781
CLP	148.465.000	USD	182.479	28. Apr. 2023	3.805

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
CLP	2.472.400.000	USD	3.083.408	03. Mai 2023	17.309
CLP	468.607.000	USD	585.759	16. Mai 2023	924
CLP	457.452.000	USD	565.803	24. Mai 2023	6.293
CLP	3.056.401.000	USD	3.771.025	22. Jun. 2023	39.462
CNH	117.218.000	USD	17.100.370	04. Apr. 2023	(45.642)
CNH	18.258.000	USD	2.656.831	04. Mai 2023	5.889
CNH	15.741.000	USD	2.295.956	21. Jun. 2023	9.158
COP	79.093.500.000	USD	16.679.661	04. Apr. 2023	304.127
COP	9.430.016.000	USD	1.945.776	10. Apr. 2023	77.379
COP	3.987.586.000	USD	862.554	26. Apr. 2023	(10.061)
COP	28.095.477.000	USD	6.030.884	03. Mai 2023	(33.919)
COP	5.189.780.000	USD	1.075.491	16. Jun. 2023	22.219
COP	13.324.506.000	USD	2.768.501	21. Jun. 2023	47.026
CZK	275.870.000	USD	12.389.612	04. Apr. 2023	358.600
CZK	32.530.000	USD	1.480.118	21. Jun. 2023	17.076
DKK	2.566.000	USD	365.712	04. Apr. 2023	7.831
DKK	1.553.000	USD	225.090	28. Apr. 2023	1.341
DKK	7.139.000	USD	1.040.741	03. Mai 2023	484
EGP	8.966.000	USD	303.932	10. Apr. 2023	(16.108)
EGP	5.044.000	USD	163.395	18. Apr. 2023	(3.871)
EGP	21.410.000	USD	806.099	01. Jun. 2023	(173.123)
EUR	47.585.000	USD	51.010.407	04. Apr. 2023	595.521
EUR	7.852.000	USD	8.525.664	28. Apr. 2023	1.260
EUR	13.910.000	USD	15.029.983	03. Mai 2023	79.926
EUR	9.698.000	USD	10.511.843	21. Jun. 2023	53.002
GBP	37.683.000	USD	45.660.805	04. Apr. 2023	824.918
GBP	403.000	USD	497.356	28. Apr. 2023	33
GBP	4.275.000	USD	5.275.272	03. Mai 2023	1.555
GBP	4.606.000	USD	5.570.598	21. Jun. 2023	120.248
HKD	12.320.000	USD	1.569.827	04. Apr. 2023	(380)
HKD	2.430.000	USD	311.004	21. Jun. 2023	(308)
HUF	7.476.281.000	USD	20.886.595	04. Apr. 2023	453.121
HUF	1.827.181.000	USD	5.166.344	03. Mai 2023	(879)
HUF	332.854.000	USD	911.055	02. Jun. 2023	20.711
HUF	1.336.300.000	USD	3.588.161	21. Jun. 2023	132.145
IDR	31.848.000.000	USD	2.094.619	04. Apr. 2023	29.359
IDR	30.313.000.000	USD	2.011.800	03. Mai 2023	8.210
IDR	23.449.000.000	USD	1.535.487	21. Jun. 2023	25.148
ILS	23.875.000	USD	6.714.335	04. Apr. 2023	(75.198)
ILS	525.000	USD	146.513	03. Mai 2023	(418)
ILS	1.138.000	USD	311.457	08. Jun. 2023	5.787
ILS	14.920.000	USD	4.164.371	21. Jun. 2023	(2.219)
INR	2.424.205.000	USD	29.438.348	03. Apr. 2023	59.476
INR	202.152.000	USD	2.462.266	28. Apr. 2023	(6.334)
INR	67.723.000	USD	821.084	02. Mai 2023	1.457
INR	2.230.225.000	USD	27.046.516	03. Mai 2023	39.223
INR	143.350.000	USD	1.737.483	21. Jun. 2023	(1.390)
JPY	13.762.808.000	USD	102.822.029	04. Apr. 2023	833.086

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
JPY	3.088.508.000	USD	23.400.988	02. Mai 2023	(33.349)
JPY	47.199.000	USD	352.867	21. Jun. 2023	6.790
KRW	33.889.770.000	USD	25.945.339	04. Apr. 2023	86.671
KRW	2.184.315.000	USD	1.665.998	12. Apr. 2023	12.613
KRW	855.100.000	USD	659.835	28. Apr. 2023	(2.001)
KRW	5.653.430.000	USD	4.348.445	03. Mai 2023	2.231
KRW	204.820.000	USD	155.994	02. Jun. 2023	1.909
KRW	1.702.210.000	USD	1.309.706	21. Jun. 2023	4.184
KZT	37.366.000	USD	78.889	24. Apr. 2023	2.709
KZT	96.084.000	USD	202.987	25. Apr. 2023	6.782
KZT	160.700.000	USD	338.851	15. Jun. 2023	7.729
KZT	267.900.000	USD	594.447	21. Jun. 2023	(17.464)
KZT	133.450.000	USD	275.155	24. Jul. 2023	10.097
KZT	115.100.000	USD	241.300	09. Aug. 2023	3.833
MXN	485.355.948	USD	26.242.509	04. Apr. 2023	691.784
MXN	112.227.000	USD	6.036.435	24. Apr. 2023	167.146
MXN	70.213.000	USD	3.701.132	27. Apr. 2023	177.785
MXN	142.084.000	USD	7.804.412	03. Mai 2023	35.917
MXN	4.076.000	USD	212.364	05. Jun. 2023	11.047
MXN	135.402.000	USD	7.126.455	21. Jun. 2023	271.907
NOK	389.146.000	USD	37.399.773	04. Apr. 2023	(231.345)
NOK	214.924.000	USD	20.616.558	03. Mai 2023	(60.760)
NZD	72.686.000	USD	44.999.961	04. Apr. 2023	450.577
NZD	6.795.000	USD	4.251.096	03. Mai 2023	(2.007)
NZD	635.000	USD	395.620	21. Jun. 2023	1.434
PEN	10.395.000	USD	2.738.190	04. Apr. 2023	24.380
PEN	10.395.000	USD	2.763.746	03. Mai 2023	(6.775)
PEN	6.180.000	USD	1.630.401	21. Jun. 2023	3.439
PHP	167.530.000	USD	3.066.730	04. Apr. 2023	14.847
PHP	100.380.000	USD	1.844.119	03. Mai 2023	888
PHP	91.315.000	USD	1.658.381	21. Jun. 2023	17.816
PLN	109.130.000	USD	25.044.025	04. Apr. 2023	238.030
PLN	10.566.000	USD	2.449.491	02. Mai 2023	(5.892)
PLN	22.234.000	USD	5.047.481	21. Jun. 2023	78.265
RON	9.465.000	USD	2.038.012	21. Jun. 2023	30.361
SEK	454.239.000	USD	43.183.501	04. Apr. 2023	581.698
SEK	5.972.000	USD	574.667	28. Apr. 2023	1.509
SEK	221.366.000	USD	21.278.216	03. Mai 2023	85.136
SGD	36.318.000	USD	27.008.745	04. Apr. 2023	281.608
SGD	19.341.000	USD	14.558.008	03. Mai 2023	(11.387)
SGD	1.965.000	USD	1.476.715	21. Jun. 2023	3.640
THB	370.355.000	USD	10.847.935	04. Apr. 2023	(17.258)
THB	19.128.000	USD	548.395	17. Apr. 2023	11.768
THB	9.345.000	USD	248.769	25. Apr. 2023	25.153
THB	200.268.000	USD	5.868.709	27. Apr. 2023	2.927
THB	12.413.000	USD	363.644	17. Mai 2023	1.055
THB	380.950.000	USD	11.207.913	21. Jun. 2023	22.560
THB	6.237.000	USD	185.957	29. Sep. 2023	(383)
TRY	296.000	USD	15.443	04. Apr. 2023	(10)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
TRY	10.147.000	USD	512.734	24. Apr. 2023	3.988
TRY	296.000	USD	14.830	03. Mai 2023	74
TRY	24.036.000	USD	1.196.190	21. Jun. 2023	(95.599)
TWD	55.008.000	USD	1.821.531	28. Apr. 2023	(10.170)
TWD	97.574.000	USD	3.235.534	03. Mai 2023	(20.766)
TWD	24.960.000	USD	826.775	21. Jun. 2023	29
USD	42.344.066	AUD	62.946.000	04. Apr. 2023	267.807
USD	19.039.117	AUD	28.386.000	03. Mai 2023	44.850
USD	1.371.672	AUD	2.065.000	21. Jun. 2023	(12.701)
USD	22.578.587	BRL	118.693.000	04. Apr. 2023	(839.420)
USD	3.003.835	BRL	15.965.000	02. Jun. 2023	(111.822)
USD	34.289.015	CAD	46.885.000	04. Apr. 2023	(402.070)
USD	854.584	CAD	1.178.000	05. Apr. 2023	(17.052)
USD	515.629	CAD	700.000	06. Apr. 2023	(2.327)
USD	973.040	CAD	1.250.000	10. Apr. 2023	48.071
USD	1.108.076	CAD	1.480.000	11. Apr. 2023	12.900
USD	1.008.813	CAD	1.350.000	12. Apr. 2023	9.818
USD	1.642.722	CAD	2.205.000	19. Apr. 2023	10.858
USD	1.131.011	CAD	1.520.000	20. Apr. 2023	6.082
USD	2.072.648	CAD	2.775.000	26. Apr. 2023	18.723
USD	674.463	CAD	900.000	27. Apr. 2023	8.315
USD	93.866	CAD	128.000	28. Apr. 2023	(877)
USD	374.978	CAD	500.000	01. Mai 2023	4.873
USD	8.417.485	CAD	11.396.000	03. Mai 2023	(18.198)
USD	317.158	CAD	400.000	11. Mai 2023	21.022
USD	373.096	CAD	500.000	17. Mai 2023	2.884
USD	369.642	CAD	500.000	18. Mai 2023	(576)
USD	361.704	CAD	500.000	23. Mai 2023	(8.548)
USD	822.155	CAD	1.125.000	25. Mai 2023	(10.943)
USD	727.902	CAD	1.000.000	30. Mai 2023	(12.699)
USD	294.072	CAD	400.000	31. Mai 2023	(2.174)
USD	2.619.980	CAD	3.595.000	14. Jun. 2023	(43.175)
USD	146.035	CAD	200.000	15. Jun. 2023	(2.126)
USD	1.282.285	CAD	1.750.000	16. Jun. 2023	(14.148)
USD	733.884	CAD	1.000.000	20. Jun. 2023	(6.986)
USD	6.749.870	CAD	9.315.000	21. Jun. 2023	(151.444)
USD	745.341	CAD	1.010.000	22. Jun. 2023	(2.961)
USD	404.551	CAD	550.000	23. Jun. 2023	(2.948)
USD	741.612	CAD	1.000.000	18. Jul. 2023	406
USD	664.345	CAD	910.000	28. Jul. 2023	(10.259)
USD	934.465	CAD	1.250.000	01. Aug. 2023	7.753
USD	300.256	CAD	400.000	09. Aug. 2023	3.671
USD	533.649	CAD	700.000	15. Aug. 2023	14.577
USD	368.293	CAD	500.000	25. Aug. 2023	(2.531)
USD	1.128.474	CAD	1.500.000	01. Sep. 2023	15.879
USD	549.345	CAD	750.000	06. Sep. 2023	(6.996)
USD	989.996	CAD	1.300.000	08. Sep. 2023	25.642
USD	228.482	CAD	310.000	25. Sep. 2023	(1.541)
USD	148.158	CAD	200.000	27. Sep. 2023	(248)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	526.422	CAD	700.000	29. Sep. 2023	6.983
USD	1.092.966	CAD	1.500.000	18. Okt. 2023	(20.432)
USD	46.970.877	CHF	43.422.000	04. Apr. 2023	(487.454)
USD	711.620	CHF	650.000	13. Apr. 2023	514
USD	547.813	CHF	500.000	20. Apr. 2023	396
USD	1.631.454	CHF	1.495.000	03. Mai 2023	(7.622)
USD	546.694	CHF	500.000	04. Mai 2023	(1.552)
USD	165.074	CHF	150.000	21. Jun. 2023	(283)
USD	28.843.701	CLP	23.894.525.000	04. Apr. 2023	(1.216.465)
USD	2.096.086	CLP	1.784.545.000	06. Apr. 2023	(148.290)
USD	14.610.799	CLP	11.611.125.000	03. Mai 2023	48.909
USD	1.754.922	CLP	1.429.735.000	08. Jun. 2023	(29.878)
USD	3.642.920	CLP	3.005.791.000	22. Jun. 2023	(104.471)
USD	16.966.115	CNH	117.218.000	04. Apr. 2023	(88.613)
USD	3.431.757	CNH	23.610.000	21. Jun. 2023	(25.694)
USD	537.759	CNH	3.653.000	28. Sep. 2023	(1.216)
USD	361.647	CNY	2.472.000	21. Jun. 2023	(535)
USD	16.621.932	COP	79.093.500.000	04. Apr. 2023	(361.854)
USD	1.983.596	COP	9.430.016.000	10. Apr. 2023	(39.558)
USD	394.733	COP	1.930.245.000	26. Apr. 2023	(17.928)
USD	2.402.175	COP	11.250.300.000	03. Mai 2023	804
USD	2.598.239	COP	12.574.052.000	21. Jun. 2023	(58.712)
USD	17.171.991	CZK	381.703.000	04. Apr. 2023	(466.862)
USD	911.692	CZK	19.977.000	28. Apr. 2023	(10.283)
USD	4.886.723	CZK	105.833.000	03. Mai 2023	3.611
USD	1.546.641	CZK	34.696.000	21. Jun. 2023	(50.243)
USD	1.539.799	DKK	10.757.000	04. Apr. 2023	(26.142)
USD	1.033.415	DKK	7.130.000	28. Apr. 2023	(6.155)
USD	1.197.656	DKK	8.191.000	03. Mai 2023	2.996
USD	504.213	DKK	3.495.000	21. Jun. 2023	(7.280)
USD	290.294	EGP	8.966.000	10. Apr. 2023	2.470
USD	166.194	EGP	5.044.000	18. Apr. 2023	6.670
USD	706.601	EGP	21.410.000	01. Jun. 2023	73.624
USD	50.718.078	EUR	47.585.000	04. Apr. 2023	(887.848)
USD	53.432.662	EUR	49.495.000	28. Apr. 2023	(316.708)
USD	30.257.648	EUR	27.910.000	03. Mai 2023	(59.930)
USD	20.216.485	EUR	18.809.000	21. Jun. 2023	(273.737)
USD	47.907.770	GBP	39.796.000	04. Apr. 2023	(1.184.547)
USD	18.653.581	GBP	15.206.000	28. Apr. 2023	(113.907)
USD	8.016.324	GBP	6.488.000	03. Mai 2023	7.890
USD	7.386.530	GBP	6.132.000	21. Jun. 2023	(189.733)
USD	248.304	GBP	200.000	24. Jul. 2023	1.096
USD	1.571.924	HKD	12.320.000	04. Apr. 2023	2.478
USD	624.194	HKD	4.892.000	28. Apr. 2023	198
USD	2.201.444	HKD	17.250.000	03. Mai 2023	578
USD	430.448	HKD	3.366.000	21. Jun. 2023	77
USD	21.216.758	HUF	7.846.400.000	04. Apr. 2023	(1.179.398)
USD	850.978	HUF	311.458.000	28. Apr. 2023	(30.960)
USD	6.212.854	HUF	2.197.300.000	03. Mai 2023	1.057

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	2.726.815	HUF	1.028.633.000	21. Jun. 2023	(136.936)
USD	2.097.020	IDR	31.848.000.000	04. Apr. 2023	(26.958)
USD	504.343	IDR	7.786.000.000	21. Jun. 2023	(13.850)
USD	15.450.601	ILS	56.000.000	04. Apr. 2023	(121.824)
USD	10.400.315	ILS	37.270.000	03. Mai 2023	28.941
USD	4.113.037	ILS	14.866.000	21. Jun. 2023	(34.052)
USD	29.402.063	INR	2.424.205.000	03. Apr. 2023	(95.762)
USD	2.137.898	INR	176.460.000	28. Apr. 2023	(5.903)
USD	6.005.950	INR	494.620.000	03. Mai 2023	(1.134)
USD	1.667.174	INR	137.890.000	21. Jun. 2023	(2.793)
USD	104.484.303	JPY	13.995.673.000	04. Apr. 2023	(924.642)
USD	1.602.051	JPY	209.700.000	10. Apr. 2023	21.339
USD	422.486	JPY	53.950.000	17. Apr. 2023	15.341
USD	1.227.458	JPY	172.650.000	20. Apr. 2023	(76.148)
USD	2.432.848	JPY	309.800.000	24. Apr. 2023	92.092
USD	11.774.369	JPY	1.536.647.000	28. Apr. 2023	156.017
USD	8.644.806	JPY	1.143.673.000	02. Mai 2023	(8.219)
USD	2.505.926	JPY	321.200.000	08. Mai 2023	73.578
USD	2.888.919	JPY	366.450.000	15. Mai 2023	111.260
USD	245.879	JPY	31.950.000	22. Mai 2023	3.470
USD	3.170.914	JPY	421.100.000	30. Mai 2023	(27.520)
USD	3.699.804	JPY	491.350.000	05. Jun. 2023	(35.360)
USD	127.605	JPY	17.200.000	12. Jun. 2023	(3.283)
USD	2.009.513	JPY	271.000.000	20. Jun. 2023	(55.202)
USD	717.279	JPY	95.100.000	21. Jun. 2023	(7.384)
USD	1.659.258	JPY	218.050.000	26. Jun. 2023	(3.529)
USD	2.376.045	JPY	305.200.000	03. Jul. 2023	46.238
USD	919.110	JPY	119.950.000	10. Jul. 2023	2.517
USD	25.837.802	KRW	33.889.770.000	04. Apr. 2023	(194.205)
USD	1.316.764	KRW	1.710.062.000	28. Apr. 2023	1.202
USD	11.346.644	KRW	14.739.600.000	03. Mai 2023	3.577
USD	2.562.669	KRW	3.324.505.000	21. Jun. 2023	(3.426)
USD	23.133.873	MXN	428.464.225	04. Apr. 2023	(643.277)
USD	591.969	MXN	12.310.000	24. Apr. 2023	(88.492)
USD	1.295.676	MXN	26.711.000	27. Apr. 2023	(179.975)
USD	4.668.893	MXN	85.000.000	03. Mai 2023	(21.487)
USD	865.362	MXN	16.395.000	05. Jun. 2023	(33.268)
USD	26.388.227	MXN	487.410.000	21. Jun. 2023	(243.841)
USD	17.897.555	NOK	189.252.000	04. Apr. 2023	(178.436)
USD	1.321.265	NOK	13.730.000	03. Mai 2023	8.098
USD	202.932	NOK	2.110.000	21. Jun. 2023	674
USD	51.820.166	NZD	83.740.000	04. Apr. 2023	(542.434)
USD	9.067.020	NZD	14.514.000	03. Mai 2023	(8.961)
USD	757.276	NZD	1.225.000	21. Jun. 2023	(8.695)
USD	2.769.046	PEN	10.395.000	04. Apr. 2023	6.476
USD	1.708.403	PEN	6.523.000	21. Jun. 2023	(16.118)
USD	3.054.527	PHP	167.530.000	04. Apr. 2023	(27.051)
USD	2.403.342	PHP	132.550.000	21. Jun. 2023	(29.772)
USD	23.376.147	PLN	103.234.000	04. Apr. 2023	(539.988)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	820.413	PLN	3.577.000	28. Apr. 2023	(7.051)
USD	1.082.635	PLN	4.670.000	02. Mai 2023	2.604
USD	1.104.305	PLN	4.903.000	21. Jun. 2023	(26.015)
USD	603.458	RON	2.775.000	21. Jun. 2023	(2.959)
USD	23.843.082	SEK	250.340.000	04. Apr. 2023	(276.776)
USD	549.336	SEK	5.673.000	28. Apr. 2023	2.008
USD	4.053.678	SEK	42.106.000	03. Mai 2023	(9.842)
USD	646.288	SEK	6.734.000	21. Jun. 2023	(5.214)
USD	27.159.533	SGD	36.318.000	04. Apr. 2023	(130.819)
USD	270.212	SGD	360.000	28. Apr. 2023	(506)
USD	1.789.155	SGD	2.377.000	03. Mai 2023	1.382
USD	2.703.430	SGD	3.615.000	21. Jun. 2023	(19.969)
USD	10.664.929	THB	370.355.000	04. Apr. 2023	(165.748)
USD	704.273	THB	23.241.000	17. Apr. 2023	23.662
USD	5.045.768	THB	172.637.000	25. Apr. 2023	(14.584)
USD	3.983.696	THB	135.605.000	03. Mai 2023	5.138
USD	731.577	THB	25.415.000	01. Jun. 2023	(16.236)
USD	11.364.912	THB	392.267.000	21. Jun. 2023	(199.190)
USD	15.401	TRY	296.000	04. Apr. 2023	(33)
USD	573.388	TRY	11.204.000	24. Apr. 2023	2.840
USD	1.599.871	TRY	32.320.000	21. Jun. 2023	119.961
USD	1.068.297	TWD	32.238.000	28. Apr. 2023	6.730
USD	1.522.478	TWD	46.055.000	03. Mai 2023	5.105
USD	647.135	TWD	19.690.000	21. Jun. 2023	(5.101)
USD	36.872.645	ZAR	675.499.000	04. Apr. 2023	(1.066.080)
USD	2.338.171	ZAR	42.695.000	06. Apr. 2023	(59.339)
USD	11.819.160	ZAR	214.700.000	03. Mai 2023	(208.170)
USD	5.316.136	ZAR	97.980.000	21. Jun. 2023	(148.656)
ZAR	675.499.000	USD	37.052.829	04. Apr. 2023	885.896
ZAR	28.999.000	USD	1.711.865	06. Apr. 2023	(83.445)
ZAR	138.209.000	USD	7.586.648	03. Mai 2023	155.714
ZAR	31.696.000	USD	1.727.302	08. Jun. 2023	42.520
ZAR	108.960.000	USD	5.999.492	21. Jun. 2023	77.704
					USD (4.504.764)
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	123.129.551	USD	23.053.733	28. Apr. 2023	1.142.525
CHF	11.333.868	USD	12.388.107	28. Apr. 2023	31.332
EUR	190.543.503	USD	204.735.489	28. Apr. 2023	2.186.286
GBP	98.641.405	USD	120.565.949	28. Apr. 2023	1.178.842
SGD	2.635.689	USD	1.978.359	28. Apr. 2023	3.665
USD	122.000	BRL	630.935	28. Apr. 2023	(1.985)
USD	4.523	CHF	4.142	28. Apr. 2023	(16)
USD	13.497.222	EUR	12.437.068	28. Apr. 2023	(8.882)
USD	220.944	GBP	180.701	28. Apr. 2023	(2.079)
					USD 4.529.688
					USD 24.924

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Die Devisenterminkontrakte waren mit den folgenden Kontrahenten verbunden:

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *	Banks of Hong Kong	(491)
	BNP Paribas	(1)
	Canadian Imperial Bank of Commerce	(2.773)
	Royal Bank of Canada	5.720
	Standard Chartered Bank	(71.970)
	State Street	(1.176)
	USD	(70.691)
Schroder GAIA BlueTrend	HSBC	5.279.960
	UBS	(4.364.539)
	USD	915.421
Schroder GAIA Cat Bond	Brown Brothers Harriman & Co	459.709
	HSBC	11.687.630
	USD	12.147.339
Schroder GAIA Contour Tech Equity	HSBC	878.180
	Morgan Stanley	(48.350)
	USD	829.830
Schroder GAIA Egerton Equity	Brown Brothers Harriman & Co	4.471.983
	HSBC	(1.880.688)
	EUR	2.591.295
Schroder GAIA Helix	Goldman Sachs	346.462
	HSBC	2.867.615
	J.P. Morgan	(272.763)
	USD	2.941.314
Schroder GAIA Oaktree Credit	HSBC	143.822
	State Street	58.618
	USD	202.440
Schroder GAIA Sirius US Equity	HSBC	470.967
	Morgan Stanley	(417.843)
	USD	53.124
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *	HSBC	4.865
	GBP	4.865
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	(263.500)
	Deutsche Bank	(14.084)
	HSBC	2.510.367
	Morgan Stanley	(40.574)
	Newedge Group	(587.056)
	USD	1.605.153

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Bank of America	(50.768)
	Barclays Bank	(707.282)
	BNP Paribas	(1.238.144)
	Citi Bank	(875.113)
	Deutsche Bank	49.274
	Goldman Sachs	456.813
	HSBC	4.061.775
	J.P. Morgan	(250.149)
	Morgan Stanley	(695.892)
	Standard Chartered Bank	(269.799)
UBS	(455.791)	
	USD	24.924

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 31. März 2023 wies der folgende Teilfonds offene Kassageschäfte auf:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Abrechnungsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
EUR	2.153.331	USD	2.334.484	03. Apr. 2023	803
GBP	687	USD	846	03. Apr. 2023	2
JPY	103.545.702	USD	780.000	04. Apr. 2023	(142)
THB	2.577.600	USD	75.333	03. Apr. 2023	46
USD	1.268.186	EUR	1.161.584	03. Apr. 2023	8.447
USD	7.394	EUR	6.819	05. Apr. 2023	-
USD	109.208	GBP	88.709	03. Apr. 2023	(224)
				USD	8.932

Kontrahenten von Kassageschäften

Fonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Brown Brothers Harriman & Co	578
	Deutsche Bank	46
	Morgan Stanley	8.308
	USD	8.932

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 31. März 2023 hielten die folgenden Teilfonds offene Terminkontrakte auf Indizes (mit Marktwert Risiken), Rentenwerte und Währungen:

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long-Position	Markt-Preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Mrz. 24	4	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(971.325)	95,70	14.325
Jun. 24	1	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(240.000)	96,10	(237)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Sep. 24	2	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(481.688)	96,44	(487)
Dez. 25	18	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(4.362.363)	97,04	(4.437)
Mrz. 26	21	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(5.090.025)	97,07	(5.888)
Jun. 26	21	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(5.089.788)	97,07	(6.388)
Sep. 26	19	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(4.604.700)	97,07	(5.888)
Dez. 26	21	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(5.088.463)	97,05	(6.662)
Mrz. 27	21	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(5.056.525)	97,05	(38.337)
Jun. 27	18	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(4.360.975)	97,03	(5.375)
Jun. 23	87	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	57.651.691	9,91	(11.048)
Sep. 23	29	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	19.219.947	9,91	(4.050)
Dez. 23	16	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	10.604.126	9,91	(1.215)
Apr. 23	2	Amsterdam Index Future	Morgan Stanley	EUR	(322.726)	756,55	(5.466)
Jun. 23	71	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	5.845.970	122,89	(13.786)
Jun. 23	24	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(1.737.824)	108,82	(7.884)
Sep. 23	38	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(6.701.683)	95,35	(333)
Dez. 23	17	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(3.004.726)	95,57	(620)
Mrz. 24	10	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(1.772.623)	95,86	(592)
Jun. 24	10	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(1.778.709)	96,17	(240)
Apr. 23	596	BIST 30 Index Future	Morgan Stanley	TRY	1.760.325	5.350,00	(97.821)
Apr. 23	57	CAC 40 Index Future	Morgan Stanley	EUR	4.453.571	7.334,00	80.051
Jun. 23	57	Canada 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	(5.230.610)	126,16	(90.233)
Apr. 23	25	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(534.900)	20,76	15.795
Mai 23	34	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(767.750)	22,13	15.381
Jun. 23	10	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	J.P. Morgan	USD	(1.611.545)	33.460,00	(61.455)
Jun. 23	1	E-mini S&P 500 ESG Future	Morgan Stanley	USD	(170.440)	363,98	(11.550)
Jun. 23	6	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	1.229.750	4.137,75	11.575
Dez. 23	1	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(261.351)	96,46	(176)
Jun. 24	1	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(262.232)	96,78	(149)
Sep. 25	94	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(24.703.703)	97,20	(67.171)
Jun. 23	8	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(1.226.222)	140,86	4.121
Jun. 23	107	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	4.748.158	4.261,00	196.370
Jun. 23	26	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(3.327.658)	117,88	3.796
Jun. 23	2	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(247.993)	115,35	(2.202)
Jun. 23	25	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(3.664.970)	135,84	(17.992)
Jun. 23	75	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(10.386.267)	130,23	(206.315)
Jun. 23	39	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	3.657.334	7.639,00	17.819
Apr. 23	675	FTSE China A50 Future	Morgan Stanley	USD	(8.853.284)	13.306,00	(128.266)
Jun. 23	28	FTSE MIB Index Future	Morgan Stanley	EUR	3.975.669	26.656,00	71.512
Apr. 23	211	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	11.580.597	1.388,00	134.123
Jun. 23	11	FTSE/JSE Top 40 Future	Morgan Stanley	ZAR	(433.739)	71.234,00	(6.347)
Apr. 23	20	Hang Seng Index Future	Morgan Stanley	HKD	(2.578.937)	20.481,00	(30.141)
Apr. 23	86	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	(3.704.652)	7.012,00	(136.365)
Apr. 23	11	IBEX 35 Index Future	Morgan Stanley	EUR	(1.068.580)	9.193,20	(28.123)
Mrz. 24	6	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(1.766.762)	95,52	(648)
Jun. 24	6	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(1.777.047)	95,73	5.752
Sep. 24	6	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(1.775.073)	95,95	(293)
Dez. 25	96	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(28.525.796)	96,35	1.511
Jun. 23	32	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	35.768.179	148,12	(69.893)
Jun. 23	86	KOSPI2 Index Future	J.P. Morgan	KRW	(5.163.344)	323,70	(182.548)
Jun. 23	55	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(7.021.528)	103,35	9.437
Apr. 23	2.609	Mini Bovespa Future	Morgan Stanley	BRL	(11.044.883)	102.128,00	530.743
Jun. 23	42	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	4.382.005	2.096,50	20.645
Jun. 23	155	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(7.451.870)	995,50	(263.255)
Apr. 23	11	MSCI Singapore Index ETS Future	Morgan Stanley	SGD	(251.228)	306,25	(1.909)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Jun. 23	7	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1.722.293)	13.301,75	(139.952)
Jun. 23	10	Nikkei 225 (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	2.096.102	28.040,00	15.741
Jun. 23	23	Nikkei 225 (SGX) Future	Morgan Stanley	JPY	2.412.163	28.045,00	16.889
Apr. 23	87	OMXS30 Index Future	Morgan Stanley	SEK	1.799.860	2.216,75	58.288
Jun. 23	34	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(2.994.033)	1.813,50	(88.918)
Jun. 23	6	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1.470.560)	2.529,70	(47.260)
Jun. 23	21	S&P/TSX 60 Index Future	J.P. Morgan	CAD	(3.664.284)	1.209,20	(93.496)
Jun. 23	531	SET 50 Index Future	J.P. Morgan	THB	(2.995.309)	968,30	(11.957)
Apr. 23	340	SGX Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	(11.595.450)	17.417,50	(248.450)
Jun. 23	24	Short-Term Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(2.738.536)	105,37	(4.034)
Jun. 23	11	South Korea 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	975.573	113,85	(13.596)
Jun. 23	4	South Korea 3 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	(322.579)	104,88	330
Jun. 23	49	SPI 200 Future	Morgan Stanley	AUD	5.806.507	7.191,00	81.852
Jun. 23	19	Stoxx Euro ESG-X Index Future	Morgan Stanley	EUR	339.557	168,90	8.470
Jun. 23	19	Swiss Market Index Future	Morgan Stanley	CHF	(2.193.945)	10.996,00	(89.502)
Jun. 23	47	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	7.043.272	2.003,50	48.764
Jun. 23	145	WIG20 Index Future	Morgan Stanley	PLN	1.160.732	1.775,00	31.785
							USD (863.875)
Schroder GAIA Helix							
Jun. 23	20	E-mini S&P 500 Future	J.P. Morgan	USD	4.031.200	4.137,75	106.550
Jun. 23	95	Euro Stoxx 50 Future	Goldman Sachs	EUR	(4.256.988)	4.261,00	(140.907)
Jun. 23	357	Euro Stoxx Future	J.P. Morgan	EUR	(8.466.491)	451,70	(293.387)
Jun. 23	123	FTSE 100 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(11.859.166)	7.639,00	241.520
Jun. 23	428	FTSE 250 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(19.902.705)	18.906,50	(107.957)
Jun. 23	35	MSCI AC AXJ NTR Future	J.P. Morgan	USD	(1.733.865)	514,30	(66.185)
Jun. 23	277	MSCI Asia Future	J.P. Morgan	USD	(14.557.590)	546,70	(586.000)
Jun. 23	555	MSCI China Future	J.P. Morgan	USD	13.580.183	508,00	516.817
Jun. 23	132	MSCI EAFE Index Future	J.P. Morgan	USD	(13.260.060)	2.096,50	(576.840)
Jun. 23	161	MSCI Emerging Market Index Future	Goldman Sachs	USD	(7.749.245)	995,50	(264.530)
Jun. 23	205	MSCI Europe Future	J.P. Morgan	EUR	(6.259.145)	291,75	(238.777)
Jun. 23	30	MSCI Poland Future	Goldman Sachs	USD	(453.330)	145,60	16.530
Jun. 23	410	MSCI World Index Future	J.P. Morgan	USD	(33.918.169)	8.660,00	(1.587.831)
Apr. 23	57	SPI 200 Future	J.P. Morgan	AUD	(6.793.224)	7.182,00	(61.232)
Jun. 23	92	Topix Index Future	J.P. Morgan	JPY	(13.911.639)	2.003,50	62.214
Jun. 23	4	US 10 Year Note Future (CBT)	Goldman Sachs	USD	(446.875)	114,92	(12.813)
							USD (2.992.828)
Schroder GAIA Oaktree Credit							
Jun. 23	2	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(408.375)	103,23	(4.531)
Jun. 23	1	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	108.898	109,51	609
							USD (3.922)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Sep. 23	1	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(238.675)	95,13	863
Jun. 23	22	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	5.300.400	94,78	(87.500)
Dez. 23	145	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	35.182.275	95,44	(585.275)
Jun. 24	47	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	11.406.738	96,18	(106.175)
Dez. 24	6	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	1.465.638	96,62	(16.413)
Mrz. 25	41	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	9.954.263	96,71	(42.000)
Jun. 25	20	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	4.851.750	96,75	(14.250)
Apr. 23	13	Amsterdam Index Future	Newedge Group	EUR	2.074.638	756,55	58.606
Jun. 23	58	Australia 10 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	(4.697.065)	122,89	(67.254)
Jun. 23	40	Australia 3 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	2.888.893	108,82	20.620
Jun. 23	5	Australian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	331.906	67,01	3.144
Dez. 23	8	Bankers' Acceptance Future	Newedge Group	CAD	(1.405.568)	95,57	(8.713)
Jun. 23	4	British Pound Future	Morgan Stanley	USD	298.417	123,55	10.458

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Apr. 23	16	CAC 40 Index Future	Newedge Group	EUR	(1.237.143)	7.334,00	(35.452)
Jun. 23	148	Canada 10 Year Bond Future	Newedge Group	CAD	(13.367.236)	126,16	(448.287)
Jun. 23	4	Canadian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(290.332)	73,99	(5.628)
Apr. 23	7	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(143.850)	20,76	(1.499)
Mai 23	49	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(1.255.870)	22,13	171.573
Jun. 23	14	Dax Index Future	Newedge Group	EUR	(5.733.484)	15.797,00	(262.663)
Jun. 23	9	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Morgan Stanley	USD	(1.465.035)	33.460,00	(40.665)
Apr. 23	2	Dubai IRD FX Future	Newedge Group	USD	48.508	121,45	72
Jun. 23	114	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	22.319.800	4.137,75	1.265.375
Dez. 23	6	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(1.572.728)	96,46	3.565
Jun. 24	60	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(15.816.497)	96,78	73.624
Sep. 24	60	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	15.836.886	96,91	(72.051)
Dez. 24	87	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	22.983.107	97,01	(100.510)
Jun. 23	4	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Newedge Group	EUR	(570.577)	140,86	(40.474)
Jun. 23	4	Euro FX Future	Morgan Stanley	USD	532.275	1,09	12.900
Jun. 23	274	Euro Stoxx 50 Future	Newedge Group	EUR	12.044.277	4.261,00	617.412
Jun. 23	35	Euro Stoxx Bank Future	Morgan Stanley	EUR	192.105	99,05	(4.120)
Jun. 23	56	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(7.001.546)	117,88	(157.542)
Jun. 23	36	Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	(4.359.809)	115,35	(143.685)
Jun. 23	465	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(66.201.534)	135,84	(2.301.558)
Jun. 23	11	Euro-OAT Future	Newedge Group	EUR	1.497.152	130,23	56.427
Jun. 23	90	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(10.211.232)	105,70	(105.129)
Jun. 23	86	FTSE 100 Index Future	Newedge Group	GBP	7.967.286	7.639,00	136.899
Apr. 23	137	FTSE China A50 Future	Newedge Group	USD	(1.809.371)	13.306,00	(13.551)
Jun. 23	8	FTSE MIB Index Future	Newedge Group	EUR	(1.114.432)	26.656,00	(41.905)
Jun. 23	65	FTSE/JSE Top 40 Future	Newedge Group	ZAR	(2.544.458)	71.234,00	(56.053)
Apr. 23	33	IBEX 35 Index Future	Newedge Group	EUR	3.212.278	9.193,20	77.830
Sep. 23	44	ICE 3 Month SONIA Index Future	Newedge Group	GBP	12.939.523	95,45	11.981
Jun. 23	34	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Newedge Group	JPY	37.241.875	148,12	687.554
Jun. 23	4	Japanese Yen Future	Morgan Stanley	USD	(375.044)	76,23	(6.081)
Jun. 23	96	KOSDAQ150 Index Future	Newedge Group	KRW	878.215	1.251,50	44.656
Jun. 23	175	KOSPI2 Index Future	Newedge Group	KRW	(10.651.429)	323,70	(226.841)
Jun. 23	335	Long Gilt Future	Newedge Group	GBP	41.727.553	103,35	982.454
Jun. 23	17	Mexican Peso Future	Morgan Stanley	USD	462.740	5,47	1.955
Jun. 23	33	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(3.315.180)	2.096,50	(144.045)
Jun. 23	199	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(9.594.423)	995,50	(310.802)
Apr. 23	175	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	(3.983.649)	306,25	(43.534)
Jun. 23	158	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(38.391.296)	13.301,75	(3.642.234)
Jun. 23	1	New Zealand Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(61.075)	62,51	(1.435)
Jun. 23	27	Nikkei 225 (OSE) Future	Newedge Group	JPY	(5.710.864)	28.040,00	8.887
Jun. 23	34	Nikkei 225 (YEN) Future	Morgan Stanley	JPY	(3.577.330)	28.205,00	(33.930)
Apr. 23	5	OMXS30 Index Future	Newedge Group	SEK	104.736	2.216,75	2.055
Jun. 23	80	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(7.333.685)	1.813,50	79.685
Jun. 23	12	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	3.053.571	2.529,70	(17.931)
Jun. 23	43	S&P/TSX 60 Index Future	Newedge Group	CAD	7.501.582	1.209,20	192.920
Jun. 23	182	SET 50 Index Future	Newedge Group	THB	1.024.174	968,30	6.565
Apr. 23	135	SGX Nifty 50 Future	Newedge Group	USD	4.613.694	17.417,50	89.031
Jun. 23	58	Short-Term Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	6.558.297	105,37	69.582
Jun. 23	62	South Korea 10 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	5.421.108	113,85	945
Jun. 23	12	South Korea 3 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	966.002	104,88	745
Jun. 23	88	SPI 200 Future	Newedge Group	AUD	10.375.664	7.191,00	199.348
Jun. 23	3	Stoxx 600 Bank Future	Newedge Group	EUR	(22.997)	143,05	(273)
Jun. 23	88	Stoxx Europe 600 Future	Newedge Group	EUR	2.089.706	454,50	79.077
Jun. 23	1	Swiss Franc Future	Morgan Stanley	USD	135.069	110,31	2.812

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Apr. 23	85	TAIEX Future	Morgan Stanley	TWD	8.583.900	15.864,00	273.576
Jun. 23	86	Topix Index Future	Newedge Group	JPY	(13.061.118)	2.003,50	84.203
Jun. 23	1	UD Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	105.212	102,19	(3.026)
Jun. 23	700	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	78.251.044	114,92	2.194.269
Jun. 23	13	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(1.517.594)	121,14	(57.234)
Jun. 23	175	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	35.639.500	103,23	489.797
Jun. 23	4	US 3 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	831.602	105,95	15.961
Jun. 23	53	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(5.642.508)	109,51	(161.406)
Apr. 23	27	US Dollar Index Future	Newedge Group	KRW	272.136	1.299,40	(2.644)
Jun. 23	50	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(6.238.570)	131,16	(319.242)
Jun. 23	46	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(6.214.742)	141,13	(277.008)
Apr. 23	128	VSTOXX Mini Future	Newedge Group	EUR	(350.802)	20,75	62.759
Jun. 23	25	WIG20 Index Future	Newedge Group	PLN	(204.758)	1.775,00	(848)
							USD (1.916.681)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Jun. 23	1	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	81.888	122,89	256
Jun. 23	24	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	1.731.931	108,82	13.777
Jun. 23	8	Canada 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	(746.970)	126,16	185
Jun. 23	8	Canada 5 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	673.341	113,97	1.287
Jun. 23	3	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(597.838)	4.137,75	(22.825)
Jun. 23	5	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(735.508)	140,86	(28.305)
Jun. 23	73	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	(3.259.416)	4.261,00	(113.954)
Jun. 23	25	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(3.200.750)	117,88	4.728
Jun. 23	2	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	253.751	115,35	(3.557)
Jun. 23	309	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(45.846.294)	135,84	324.884
Jun. 23	41	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(5.775.993)	130,23	(14.619)
Jun. 23	12	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(1.185.546)	105,70	(189.969)
Apr. 23	8	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	(442.350)	1.388,00	(1.810)
Apr. 23	35	Hang Seng TECH Index Future	Morgan Stanley	HKD	956.382	4.320,00	6.688
Apr. 23	69	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	2.940.006	7.012,00	141.741
Jun. 23	35	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	(38.412.446)	148,12	(632.555)
Jun. 23	218	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(27.794.825)	103,35	1.447
Jun. 23	20	mini-10 Year JGB Index Future	Morgan Stanley	JPY	(2.211.689)	147,82	(14.935)
Jun. 23	13	Mini Dax Index Future	Morgan Stanley	EUR	(1.057.463)	15.797,00	(56.107)
Jun. 23	56	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(5.612.573)	2.096,50	(257.627)
Jun. 23	49	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(4.397.258)	1.813,50	(45.818)
Jun. 23	180	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	21.028.953	114,92	(343.016)
Jun. 23	45	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	5.452.172	121,14	(844)
Jun. 23	500	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	103.352.453	103,23	(125.890)
Jun. 23	237	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(25.446.648)	109,51	(506.703)
Jun. 23	2	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(216.758)	131,16	(45.555)
Jun. 23	10	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	1.560.531	141,13	(149.281)
							USD (2.058.377)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Optionskontrakte

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

Zum 31. März 2023 wiesen die folgenden Teilfonds offene Optionskontrakte auf Finanzindizes und international notierte Aktien auf:

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend						
(2.633.608)	Put auf UBS ETC Linked to a Systematica Strategy Delta-1 Basket on Commodity Future Ausübungskurs 52,75 Verfallstermin 31. Mrz. 2023	UBS	USD	(7.762)	-	7.762
				USD	-	7.762
Schroder GAIA Contour Tech Equity						
(410)	Call auf Chewy, Inc. Ausübungskurs 55,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(183.270)	(1.025)	182.245
(161)	Call auf Netflix, Inc. Ausübungskurs 430,00 Verfallstermin 19. Jan. 2024	Morgan Stanley	USD	(639.423)	(454.422)	185.001
(857)	Call auf Warner Music Group Ausübungskurs 40,00 Verfallstermin 21. Jul. 2023	Goldman Sachs	USD	(293.078)	(209.965)	83.113
				USD	(665.412)	450.359
Schroder GAIA Helix						
9.231	Call auf Bloomberg San Diego Telecommunications Index Ausübungskurs 114,08 Verfallstermin 28. Apr. 2023	Goldman Sachs	EUR	13.582	17.846	4.264
236	Put auf Deutsche Boerse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 13.800,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	UBS	EUR	213.612	17.115	(196.497)
97	Put auf Deutsche Boerse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 14.200,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	UBS	EUR	60.733	12.198	(48.535)
20	Put auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 875,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	UBS	USD	19.754	1.200	(18.554)
8	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.800,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	UBS	USD	30.670	5.240	(25.430)
				USD	53.599	(284.752)
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
247.420	Call auf Alibaba Group Holding Limited Ausübungskurs 105,00 Verfallstermin 29. Jun. 2023	J.P. Morgan	HKD	191.635	250.065	58.430
(247.420)	Call auf Alibaba Group Holding Limited Ausübungskurs 115,00 Verfallstermin 29. Jun. 2023	J.P. Morgan	HKD	(115.989)	(151.499)	(35.510)
31	Call auf BILL Holdings, Inc. Ausübungskurs 105,00 Verfallstermin 19. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	36.993	7.905	(29.088)
(31)	Call auf BILL Holdings, Inc. Ausübungskurs 140,00 Verfallstermin 19. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(10.127)	(1.240)	8.887
26.800	Call auf Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 495,60 Verfallstermin 30. Mai 2023	Morgan Stanley	CNY	82.368	12.626	(69.742)
(26.800)	Call auf Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 585,71 Verfallstermin 30. Mai 2023	Morgan Stanley	CNY	(18.954)	(1.312)	17.642
1.275.000	Call auf Wechselkurs AUD/JPY Ausübungskurs 91,20 Verfallstermin 05. Apr. 2023	J.P. Morgan	AUD	11.521	155	(11.366)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (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.)						
1.970.000	Call auf Wechselkurs AUD/USD Ausübungskurs 0,66 Verfallstermin 26. Apr. 2023	HSBC	AUD	19.097	20.578	1.481
1.275.000	Call auf Wechselkurs AUD/USD Ausübungskurs 0,67 Verfallstermin 05. Apr. 2023	HSBC	AUD	11.749	1.986	(9.763)
1.935.000	Call auf Wechselkurs AUD/USD Ausübungskurs 0,67 Verfallstermin 02. Mai 2023	Morgan Stanley	AUD	17.056	15.228	(1.828)
1.171.000	Call auf Wechselkurs EUR/PLN Ausübungskurs 4,71 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Morgan Stanley	EUR	10.353	3.667	(6.686)
1.240.000	Call auf Wechselkurs EUR/PLN Ausübungskurs 4,73 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Bank of America	EUR	10.988	4.237	(6.751)
1.174.000	Call auf Wechselkurs EUR/USD Ausübungskurs 1,07 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Barclays Bank	EUR	14.314	18.842	4.528
1.018.000	Call auf Wechselkurs EUR/USD Ausübungskurs 1,08 Verfallstermin 13. Jun. 2023	Barclays Bank	EUR	19.109	23.940	4.831
1.049.000	Call auf Wechselkurs EUR/USD Ausübungskurs 1,09 Verfallstermin 25. Apr. 2023	Morgan Stanley	EUR	18.018	5.436	(12.582)
1.074.000	Call auf Wechselkurs GBP/AUD Ausübungskurs 1,84 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Citi Bank	GBP	13.036	11.409	(1.627)
725.000	Call auf Wechselkurs GBP/JPY Ausübungskurs 159,72 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Barclays Bank	GBP	14.368	23.991	9.623
691.000	Call auf Wechselkurs GBP/JPY Ausübungskurs 159,84 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Goldman Sachs	GBP	14.113	21.371	7.258
906.000	Call auf Wechselkurs GBP/USD Ausübungskurs 1,22 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Barclays Bank	GBP	13.480	15.011	1.531
414.000	Call auf Wechselkurs GBP/USD Ausübungskurs 1,42 Verfallstermin 04. Mai 2023	Barclays Bank	GBP	35.096	-	(35.096)
1.290.000	Call auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,20 Verfallstermin 05. Apr. 2023	Goldman Sachs	USD	23.143	1.802	(21.341)
1.252.000	Call auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,27 Verfallstermin 13. Apr. 2023	HSBC	USD	26.383	3.549	(22.834)
1.099.000	Call auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,56 Verfallstermin 28. Jun. 2023	Goldman Sachs	USD	15.399	11.898	(3.501)
3.680.000	Call auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,97 Verfallstermin 08. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	82.248	1.880	(80.368)
1.806.000	Call auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 6,11 Verfallstermin 14. Jun. 2023	Goldman Sachs	USD	43.097	3.295	(39.802)
1.288.000	Call auf Wechselkurs USD/CAD Ausübungskurs 1,38 Verfallstermin 07. Apr. 2023	Bank of America	USD	11.038	235	(10.803)
1.144.000	Call auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,91 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	18.709	10.529	(8.180)
1.108.000	Call auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,92 Verfallstermin 12. Jun. 2023	Goldman Sachs	USD	18.290	9.603	(8.687)
(2.621.000)	Call auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,95 Verfallstermin 23. Nov. 2023	Goldman Sachs	USD	(28.624)	(20.348)	8.276

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (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.)						
261.000	Call auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 1,00 Verfallstermin 30. Mai 2023	Goldman Sachs	USD	33.356	43	(33.313)
(1.290.000)	Call auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 801,50 Verfallstermin 05. Apr. 2023	UBS	USD	(28.051)	(6.732)	21.319
(1.911.000)	Call auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 810,10 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Bank of America	USD	(72.094)	(23.015)	49.079
(3.736.000)	Call auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 876,40 Verfallstermin 06. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	(60.448)	(27.117)	33.331
5.700.000	Call auf Wechselkurs USD/CNH Ausübungskurs 6,79 Verfallstermin 26. Sep. 2023	UBS	USD	105.621	98.685	(6.936)
1.056.000	Call auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 21,93 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	20.061	6.824	(13.237)
(1.252.000)	Call auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 22,17 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Bank of America	USD	(16.519)	(2.583)	13.936
(1.320.000)	Call auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 22,42 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Bank of America	USD	(17.266)	(2.556)	14.710
(1.913.000)	Call auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 22,68 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Citi Bank	USD	(14.702)	(2.934)	11.768
(1.296.000)	Call auf Wechselkurs USD/HUF Ausübungskurs 352,80 Verfallstermin 02. Mai 2023	J.P. Morgan	USD	(25.460)	(27.732)	(2.272)
(1.913.000)	Call auf Wechselkurs USD/HUF Ausübungskurs 390,65 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Citi Bank	USD	(26.666)	(2.975)	23.691
1.049.000	Call auf Wechselkurs USD/IDR Ausübungskurs 15.231,00 Verfallstermin 15. Mai 2023	Citi Bank	USD	17.623	5.385	(12.238)
1.038.000	Call auf Wechselkurs USD/IDR Ausübungskurs 15.625,00 Verfallstermin 03. Apr. 2023	Citi Bank	USD	17.179	-	(17.179)
(1.288.000)	Call auf Wechselkurs USD/ILS Ausübungskurs 3,59 Verfallstermin 07. Apr. 2023	J.P. Morgan	USD	(18.451)	(11.473)	6.978
(4.715.000)	Call auf Wechselkurs USD/ILS Ausübungskurs 3,65 Verfallstermin 06. Jun. 2023	Citi Bank	USD	(110.142)	(68.151)	41.991
1.053.000	Call auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 82,15 Verfallstermin 26. Apr. 2023	J.P. Morgan	USD	11.604	6.661	(4.943)
1.023.000	Call auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 82,57 Verfallstermin 12. Jun. 2023	Barclays Bank	USD	11.294	9.589	(1.705)
5.740.000	Call auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 83,80 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	27.569	5.935	(21.634)
2.580.000	Call auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 83,84 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Deutsche Bank	USD	11.873	781	(11.092)
1.901.000	Call auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 84,15 Verfallstermin 27. Apr. 2023	UBS	USD	9.521	1.458	(8.063)
2.679.000	Call auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 84,80 Verfallstermin 31. Mai 2023	HSBC	USD	12.190	5.014	(7.176)
1.320.000	Call auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 130,02 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	19.668	32.350	12.682

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (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.)						
875.000	Call auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 130,75 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Goldman Sachs	USD	12.408	18.069	5.661
(6.013.000)	Call auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 132,50 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Goldman Sachs	USD	(48.104)	(76.738)	(28.634)
(1.933.000)	Call auf Wechselkurs USD/KRW Ausübungskurs 1.311,00 Verfallstermin 31. Mai 2023	Bank of America	USD	(43.144)	(30.372)	12.772
(1.320.000)	Call auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 18,63 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(22.546)	(5.980)	16.566
(1.229.000)	Call auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 18,94 Verfallstermin 19. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(24.961)	(2.136)	22.825
1.735.000	Call auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 19,15 Verfallstermin 05. Jun. 2023	Deutsche Bank	USD	16.928	13.338	(3.590)
1.028.000	Call auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 19,18 Verfallstermin 09. Mai 2023	Bank of America	USD	22.541	3.553	(18.988)
1.229.000	Call auf Wechselkurs USD/NOK Ausübungskurs 10,75 Verfallstermin 19. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	22.872	38.983	16.111
1.035.000	Call auf Wechselkurs USD/PHP Ausübungskurs 54,71 Verfallstermin 24. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	15.090	4.899	(10.191)
1.023.000	Call auf Wechselkurs USD/PHP Ausübungskurs 55,30 Verfallstermin 13. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	16.130	7.541	(8.589)
1.078.000	Call auf Wechselkurs USD/PLN Ausübungskurs 4,55 Verfallstermin 04. Mai 2023	Barclays Bank	USD	11.136	2.679	(8.457)
(1.913.000)	Call auf Wechselkurs USD/PLN Ausübungskurs 4,57 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Bank of America	USD	(18.740)	(2.921)	15.819
1.056.000	Call auf Wechselkurs USD/SGD Ausübungskurs 1,31 Verfallstermin 27. Apr. 2023	HSBC	USD	11.843	16.784	4.941
978.000	Call auf Wechselkurs USD/SGD Ausübungskurs 1,34 Verfallstermin 14. Jun. 2023	HSBC	USD	11.629	15.150	3.521
(3.800.000)	Call auf Wechselkurs USD/THB Ausübungskurs 33,45 Verfallstermin 27. Sep. 2023	J.P. Morgan	USD	(103.360)	(108.789)	(5.429)
(5.701.000)	Call auf Wechselkurs USD/THB Ausübungskurs 34,10 Verfallstermin 15. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(108.690)	(72.838)	35.852
(2.900.000)	Call auf Wechselkurs USD/THB Ausübungskurs 34,74 Verfallstermin 30. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(58.783)	(22.758)	36.025
2.900.000	Call auf Wechselkurs USD/THB Ausübungskurs 36,10 Verfallstermin 30. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	24.389	6.058	(18.331)
1.075.000	Call auf Wechselkurs USD/ZAR Ausübungskurs 18,13 Verfallstermin 11. Apr. 2023	J.P. Morgan	USD	14.214	4.879	(9.335)
1.320.000	Call auf Wechselkurs USD/ZAR Ausübungskurs 18,55 Verfallstermin 20. Apr. 2023	HSBC	USD	25.905	4.706	(21.199)
3.736.000	Call auf Wechselkurs USD/ZAR Ausübungskurs 19,43 Verfallstermin 06. Jun. 2023	Bank of America	USD	48.363	21.503	(26.860)
575	Call auf MSCI Brazil 25/50 Index Ausübungskurs 6.430,00 Verfallstermin 19. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	69.000	29.765	(39.235)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (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.)						
480	Call auf Murata Manufacturing Co., Ltd. Ausübungskurs 8.833,00 Verfallstermin 08. Jun. 2023	BNP Paribas	JPY	385	391	6
(480)	Call auf Murata Manufacturing Co., Ltd. Ausübungskurs 9.636,00 Verfallstermin 08. Jun. 2023	BNP Paribas	JPY	(87)	(88)	(1)
20	Call auf NASDAQ-100 Reduced Value Index Ausübungskurs 2.620,00 Verfallstermin 28. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	100.066	154.200	54.134
13	Call auf NASDAQ-100 Reduced Value Index Ausübungskurs 2.720,00 Verfallstermin 16. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	70.133	102.115	31.982
484	Call auf Nikkei 225 Index Ausübungskurs 28.071,05 Verfallstermin 14. Apr. 2023	Goldman Sachs	JPY	648	1.057	409
851	Call auf Samsung Electronics Co., Ltd. Ausübungskurs 64.612,83 Verfallstermin 11. Mai 2023	Morgan Stanley	KRW	663	1.191	528
5.000	Call auf Sinoma Science & Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 26,91 Verfallstermin 30. Mai 2023	Morgan Stanley	CNY	646	313	(333)
(5.000)	Call auf Sinoma Science & Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 31,80 Verfallstermin 30. Mai 2023	Morgan Stanley	CNY	(108)	(45)	63
3.162	Call auf XPeng Inc. Ausübungskurs 45,43 Verfallstermin 29. Jun. 2023	BNP Paribas	HKD	1.762	2.324	562
(3.162)	Call auf XPeng Inc. Ausübungskurs 51,63 Verfallstermin 29. Jun. 2023	BNP Paribas	HKD	(1.061)	(1.469)	(408)
1.292	Put auf Euro Stoxx 50 Index Ausübungskurs 3.400,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	J.P. Morgan	EUR	75.009	1.101	(73.908)
1.292	Put auf Euro Stoxx 50 Index Ausübungskurs 3.400,00 Verfallstermin 16. Jun. 2023	J.P. Morgan	EUR	48.971	19.233	(29.738)
-	Put auf Euro Stoxx 50 Index Ausübungskurs 4.100,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	Goldman Sachs	EUR	589	193	(396)
30.562	Put auf FinecoBank Banca Fineco SpA Ausübungskurs 14,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	Goldman Sachs	EUR	13.741	12.648	(1.093)
1.275.000	Put auf Wechselkurs AUD/JPY Ausübungskurs 91,20 Verfallstermin 05. Apr. 2023	J.P. Morgan	AUD	11.521	23.763	12.242
5.305.000	Put auf Wechselkurs AUD/USD Ausübungskurs 0,66 Verfallstermin 26. Apr. 2023	HSBC	AUD	51.429	31.878	(19.551)
1.275.000	Put auf Wechselkurs AUD/USD Ausübungskurs 0,67 Verfallstermin 05. Apr. 2023	HSBC	AUD	11.749	8.551	(3.198)
1.935.000	Put auf Wechselkurs AUD/USD Ausübungskurs 0,67 Verfallstermin 02. Mai 2023	Morgan Stanley	AUD	17.056	18.713	1.657
1.171.000	Put auf Wechselkurs EUR/PLN Ausübungskurs 4,71 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Morgan Stanley	EUR	10.353	8.305	(2.048)
1.240.000	Put auf Wechselkurs EUR/PLN Ausübungskurs 4,73 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Bank of America	EUR	10.988	13.730	2.742
234.000	Put auf Wechselkurs EUR/SEK Ausübungskurs 10,60 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Barclays Bank	EUR	17.906	1.013	(16.893)
1.174.000	Put auf Wechselkurs EUR/USD Ausübungskurs 1,07 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Barclays Bank	EUR	14.314	2.659	(11.655)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (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.)						
1.018.000	Put auf Wechselkurs EUR/USD Ausübungskurs 1,08 Verfallstermin 13. Jun. 2023	Barclays Bank	EUR	19.109	10.267	(8.842)
1.049.000	Put auf Wechselkurs EUR/USD Ausübungskurs 1,09 Verfallstermin 25. Apr. 2023	Morgan Stanley	EUR	18.019	14.599	(3.420)
1.074.000	Put auf Wechselkurs GBP/AUD Ausübungskurs 1,84 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Citi Bank	GBP	13.036	10.444	(2.592)
725.000	Put auf Wechselkurs GBP/JPY Ausübungskurs 159,72 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Barclays Bank	GBP	14.368	3.626	(10.742)
691.000	Put auf Wechselkurs GBP/JPY Ausübungskurs 159,84 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Goldman Sachs	GBP	14.113	1.859	(12.254)
906.000	Put auf Wechselkurs GBP/USD Ausübungskurs 1,22 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Barclays Bank	GBP	13.480	5.240	(8.240)
(3.680.000)	Put auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 4,95 Verfallstermin 08. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(65.798)	(32.582)	33.216
(1.806.000)	Put auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,05 Verfallstermin 14. Jun. 2023	Goldman Sachs	USD	(33.532)	(39.348)	(5.816)
1.290.000	Put auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,20 Verfallstermin 05. Apr. 2023	Goldman Sachs	USD	23.143	34.411	11.268
1.252.000	Put auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,27 Verfallstermin 13. Apr. 2023	HSBC	USD	26.383	51.253	24.870
262.000	Put auf Wechselkurs USD/CAD Ausübungskurs 1,27 Verfallstermin 06. Apr. 2023	Bank of America	USD	17.816	-	(17.816)
254.000	Put auf Wechselkurs USD/CAD Ausübungskurs 1,28 Verfallstermin 25. Apr. 2023	Bank of America	USD	24.232	808	(23.424)
1.288.000	Put auf Wechselkurs USD/CAD Ausübungskurs 1,38 Verfallstermin 07. Apr. 2023	Bank of America	USD	11.038	25.402	14.364
1.144.000	Put auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,91 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	18.709	8.227	(10.482)
(3.956.000)	Put auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,92 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(43.259)	(40.113)	3.146
1.108.000	Put auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,92 Verfallstermin 12. Jun. 2023	Goldman Sachs	USD	18.290	24.673	6.383
(3.861.000)	Put auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,92 Verfallstermin 27. Okt. 2023	Bank of America	USD	(159.178)	(154.603)	4.575
(2.621.000)	Put auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,93 Verfallstermin 23. Nov. 2023	Goldman Sachs	USD	(111.028)	(132.867)	(21.839)
1.896.000	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 754,00 Verfallstermin 12. Mai 2023	Bank of America	USD	23.857	7.620	(16.237)
1.915.000	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 761,60 Verfallstermin 22. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	24.436	14.528	(9.908)
3.736.000	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 765,50 Verfallstermin 06. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	48.979	42.157	(6.822)
(1.896.000)	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 800,00 Verfallstermin 12. Mai 2023	Bank of America	USD	(68.956)	(46.123)	22.833

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (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.)						
(1.290.000)	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 801,50 Verfallstermin 05. Apr. 2023	UBS	USD	(28.051)	(16.342)	11.709
(1.915.000)	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 808,50 Verfallstermin 22. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(70.223)	(63.031)	7.192
(1.911.000)	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 810,10 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Bank of America	USD	(63.965)	(54.534)	9.431
5.700.000	Put auf Wechselkurs USD/CNH Ausübungskurs 6,79 Verfallstermin 26. Sep. 2023	UBS	USD	99.864	101.989	2.125
3.544.000	Put auf Wechselkurs USD/COP Ausübungskurs 4.544,00 Verfallstermin 14. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	45.682	186.575	140.893
(3.544.000)	Put auf Wechselkurs USD/COP Ausübungskurs 4.825,50 Verfallstermin 14. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	(127.938)	(83.552)	44.386
1.913.000	Put auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 21,30 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Citi Bank	USD	12.071	7.114	(4.957)
1.056.000	Put auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 21,93 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	20.061	19.435	(626)
(1.252.000)	Put auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 22,17 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Bank of America	USD	(16.519)	(31.988)	(15.469)
(1.320.000)	Put auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 22,42 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Bank of America	USD	(17.266)	(48.482)	(31.216)
1.913.000	Put auf Wechselkurs USD/HUF Ausübungskurs 346,75 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Citi Bank	USD	21.056	18.824	(2.232)
2.912.000	Put auf Wechselkurs USD/HUF Ausübungskurs 346,86 Verfallstermin 31. Mai 2023	Citi Bank	USD	30.940	44.262	13.322
(1.296.000)	Put auf Wechselkurs USD/HUF Ausübungskurs 352,80 Verfallstermin 02. Mai 2023	J.P. Morgan	USD	(25.460)	(24.151)	1.309
(2.912.000)	Put auf Wechselkurs USD/HUF Ausübungskurs 365,35 Verfallstermin 31. Mai 2023	Citi Bank	USD	(93.111)	(126.421)	(33.310)
1.049.000	Put auf Wechselkurs USD/IDR Ausübungskurs 15.231,00 Verfallstermin 15. Mai 2023	Citi Bank	USD	17.623	24.241	6.618
1.038.000	Put auf Wechselkurs USD/IDR Ausübungskurs 15.625,00 Verfallstermin 03. Apr. 2023	Citi Bank	USD	17.179	45.925	28.746
(1.288.000)	Put auf Wechselkurs USD/ILS Ausübungskurs 3,59 Verfallstermin 07. Apr. 2023	J.P. Morgan	USD	(18.451)	(8.363)	10.088
(4.715.000)	Put auf Wechselkurs USD/ILS Ausübungskurs 3,65 Verfallstermin 06. Jun. 2023	Citi Bank	USD	(102.009)	(145.907)	(43.898)
(5.740.000)	Put auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 80,62 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(22.616)	(2.646)	19.970
(1.901.000)	Put auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 80,85 Verfallstermin 27. Apr. 2023	UBS	USD	(7.224)	(1.260)	5.964
1.053.000	Put auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 82,15 Verfallstermin 26. Apr. 2023	J.P. Morgan	USD	11.604	4.545	(7.059)
1.023.000	Put auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 82,57 Verfallstermin 12. Jun. 2023	Barclays Bank	USD	11.294	9.722	(1.572)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (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.)						
785.000	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 115,00 Verfallstermin 06. Okt. 2023	Morgan Stanley	USD	53.773	37.021	(16.752)
(2.588.000)	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 120,00 Verfallstermin 17. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	(23.603)	(178)	23.425
1.302.000	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 120,00 Verfallstermin 01. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	112.163	60.447	(51.716)
(6.013.000)	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 126,65 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Goldman Sachs	USD	(31.075)	(15.290)	15.785
296.000	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 127,00 Verfallstermin 11. Mai 2023	HSBC	USD	25.160	27.369	2.209
518.000	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 127,00 Verfallstermin 11. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	39.627	47.896	8.269
1.320.000	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 130,02 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	19.668	9.297	(10.371)
875.000	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 130,75 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Goldman Sachs	USD	12.409	7.600	(4.809)
(1.933.000)	Put auf Wechselkurs USD/KRW Ausübungskurs 1.311,00 Verfallstermin 31. Mai 2023	Bank of America	USD	(40.235)	(43.842)	(3.607)
(1.320.000)	Put auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 18,63 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(22.546)	(44.674)	(22.128)
(1.229.000)	Put auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 18,94 Verfallstermin 19. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(24.961)	(61.077)	(36.116)
1.028.000	Put auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 19,18 Verfallstermin 09. Mai 2023	Bank of America	USD	22.541	61.818	39.277
1.229.000	Put auf Wechselkurs USD/NOK Ausübungskurs 10,75 Verfallstermin 19. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	22.872	5.486	(17.386)
1.035.000	Put auf Wechselkurs USD/PHP Ausübungskurs 54,71 Verfallstermin 24. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	15.090	12.936	(2.154)
1.023.000	Put auf Wechselkurs USD/PHP Ausübungskurs 55,30 Verfallstermin 13. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	16.130	25.505	9.375
1.913.000	Put auf Wechselkurs USD/PLN Ausübungskurs 4,20 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Bank of America	USD	14.291	3.536	(10.755)
1.056.000	Put auf Wechselkurs USD/SGD Ausübungskurs 1,31 Verfallstermin 27. Apr. 2023	HSBC	USD	11.843	1.392	(10.451)
978.000	Put auf Wechselkurs USD/SGD Ausübungskurs 1,34 Verfallstermin 14. Jun. 2023	HSBC	USD	11.629	6.345	(5.284)
(3.800.000)	Put auf Wechselkurs USD/THB Ausübungskurs 33,45 Verfallstermin 27. Sep. 2023	J.P. Morgan	USD	(93.423)	(89.279)	4.144
(5.701.000)	Put auf Wechselkurs USD/THB Ausübungskurs 34,10 Verfallstermin 15. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(108.690)	(79.332)	29.358
(3.736.000)	Put auf Wechselkurs USD/ZAR Ausübungskurs 17,45 Verfallstermin 06. Jun. 2023	Bank of America	USD	(41.451)	(53.495)	(12.044)
1.320.000	Put auf Wechselkurs USD/ZAR Ausübungskurs 18,55 Verfallstermin 20. Apr. 2023	HSBC	USD	25.905	57.405	31.500

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (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.)							
(575)	Put auf MSCI Brazil 25/50 Index Ausübungskurs 5.360,00 Verfallstermin 19. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(59.225)	(48.477)	10.748	
47	Put auf Russell 2000 Index Ausübungskurs 1.680,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	64.076	33.135	(30.941)	
(20)	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.550,00 Verfallstermin 31. Mrz. 2023	Morgan Stanley	USD	(23.214)	(100)	23.114	
43	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.750,00 Verfallstermin 31. Mrz. 2023	Morgan Stanley	USD	208.445	215	(208.230)	
(3.162)	Put auf XPeng Inc. Ausübungskurs 28,91 Verfallstermin 29. Jun. 2023	BNP Paribas	HKD	(642)	(513)	129	
					USD	196.026	(408.789)

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 31. März 2023 wiesen die folgenden Teilfonds offene Swaptions auf Finanzindizes und international notierte Aktien auf:

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennwert	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf	IRS "Zahlt Festzinssatz 7,69 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2026", Put; 7,69%; 13. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	384.124	157.510.000	222.610	(161.514)
Kauf	IRS "Zahlt Festzinssatz 8,50 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028", Put; 8,50 %; 06. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	43.660	(52.265)
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 6,80 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Feb. 2025", Call; 6,80 %; 07. Feb. 2025	J.P. Morgan	MXN	541.676	228.495.000	118.920	(422.756)
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 7,29 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2026", Call; 7,29 %; 05. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	396.524	157.510.000	145.742	(250.782)
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 8,50 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Apr. 2028", Call; 8,50 %; 06. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	52.210	(43.715)
Kauf	SWP "Erhält Festzinssatz 7,95 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2024", Call; 7,95 %; 13. Mrz. 2024	J.P. Morgan	MXN	210.150	332.045.000	152.919	(57.231)
Verkauf	SWP "Erhält Festzinssatz 7,20 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2024", Call; 7,20 %; 13. Mrz. 2024	J.P. Morgan	MXN	(61.294)	332.045.000	(56.563)	4.731
					USD	679.498	(983.532)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte

Der Fonds darf Total Return Swaps abschließen. Ein Total Return Swap ist ein bilateraler finanzieller Vertrag, der es dem Fonds ermöglicht, von allen Cash-Flow-Vorteilen eines Vermögenswerts zu profitieren, ohne diesen Vermögenswert tatsächlich zu besitzen (die „Referenz-Vermögenswert“). Die Teilfonds müssen eine wiederkehrende Prämie (feste oder variable Zahlung) für ihre Rechte darauf bezahlen, die Gesamrendite des Basiswerts (Coupons und/oder Kapitalgewinne und/oder -verluste) zu erhalten. Beim Basiswert kann es sich um fast jeden beliebigen Investitionswert handeln, der eine für die Teilfonds zulässige Investition 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 Berichtszeitraums ist durch die Werte der auf Grundlage der Zinssätze der jeweiligen Swap-Kontrakte zu erhaltenden (oder zu zahlenden) Zinsen, abzüglich (bzw. zuzüglich) des Werts der zu zahlenden (bzw. zu erhaltenden) Leistung, welche auf dem Gesamtrenditewert 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-Swap-Kontrakten“ aufgeführt.

Zum 31. März 2023 waren folgende Teilfonds in Total-Return-Swap-Kontrakten engagiert:

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennwert	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	21.830.631	92.272	28. Feb. 2025	4.022.418
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	EUR	16.279.912	(177.726)	21. Mrz. 2024	74.220
Kauf Long	Bekleidung	Morgan Stanley	EUR	12.898.993	564.718	28. Feb. 2025	2.583.081
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	GBP	11.514.671	(1.280.537)	28. Feb. 2025	(1.263.258)
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	GBP	3.804.969	251.653	28. Feb. 2025	391.168
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	GBP	13.093.468	(2.468.530)	07. Aug. 2024	(2.564.289)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	CHF	7.466.055	1.195.140	18. Jun. 2024	1.637.677
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	2.338.731	43.242	20. Feb. 2024	34.057
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	USD	2.369.191	(169.856)	18. Sep. 2023	(188.163)
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	EUR	839.754	95.438	28. Feb. 2025	37.649
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	817.422	(12.915)	30. Apr. 2024	(12.915)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	441.358	(2.228)	28. Feb. 2025	(2.228)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	500.852	(5.569)	26. Apr. 2023	(124.891)
Verkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	USD	689.088	(43.514)	26. Feb. 2024	(43.514)
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	CHF	941.698	8.889	28. Jan. 2026	8.889
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	941.060	103.580	24. Jul. 2024	369.285
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.071.143	81.054	26. Aug. 2025	98.843
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	862.285	56.629	31. Okt. 2023	97.671
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	CHF	1.116.107	40.111	24. Jul. 2025	1.971
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	2.228.054	110.695	14. Jun. 2023	63.062
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	2.412.931	59.847	28. Feb. 2025	221.696
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	JPY	1.542.936	(10.003)	28. Feb. 2025	1.629
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	981.938	(39.778)	10. Dez. 2025	(36.832)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.220.823	(2.444)	27. Mrz. 2024	29.863
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley	USD	436.757	5.751	28. Feb. 2025	5.751
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	USD	1.660.099	(116.471)	08. Jan. 2024	(115.531)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	1.064.285	12.144	28. Feb. 2025	86.765
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	1.775.204	(46.260)	28. Feb. 2025	(253.468)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	2.444.688	260.151	16. Jan. 2024	280.978
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	1.174.071	386.008	17. Sep. 2024	510.807
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	1.551.897	51.062	31. Okt. 2023	(501)
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Morgan Stanley	HKD	1.458.485	(71.317)	26. Feb. 2025	(71.317)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	553.511	(116.893)	26. Apr. 2023	50.140
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	851.427	(92.015)	18. Sep. 2025	(107.942)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	1.143.201	(11.028)	23. Feb. 2024	(11.028)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	1.537.519	(66.528)	11. Mrz. 2024	(66.135)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	909.324	(47.687)	28. Feb. 2025	(52.086)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	1.896.518	81.674	28. Feb. 2025	11.486
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Goldman Sachs	USD	2.423.234	(399.929)	31. Jul. 2024	(128.505)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Merrill Lynch	USD	2.310.139	(16.910)	31. Mai 2023	27.995
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Merrill Lynch	USD	916.612	76.977	29. Feb. 2024	77.569
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	USD	522.858	(27.345)	28. Feb. 2025	(6.063)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennwert	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	752.282	48.236	27. Feb. 2025	(25.439)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	1.460.271	(19.517)	16. Apr. 2025	49.597
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	832.904	(141.885)	15. Apr. 2024	(141.885)
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	USD	1.455.774	5.781	15. Apr. 2024	6.219
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	SEK	2.001.219	(125.466)	09. Jul. 2025	(162.294)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	CHF	423.103	(19.926)	24. Jul. 2024	25.533
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	EUR	460.201	41.326	28. Feb. 2025	1.588
Verkauf Short	Büro- und Geschäftsausstattung	Morgan Stanley	JPY	1.938.907	114.106	28. Feb. 2025	(87.007)
Verkauf Short	Verpackung und Behälter	J.P. Morgan	USD	2.462.124	84.653	21. Mrz. 2024	387.002
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1.498.665	70.791	23. Feb. 2024	4.524
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2.324.051	(11.297)	28. Feb. 2025	118.489
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	1.812.676	176.169	30. Nov. 2023	169.076
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	1.439.082	369.880	28. Feb. 2025	478.318
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	EUR	686.537	(89.844)	21. Jan. 2026	(89.844)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	SEK	916.018	(220.944)	07. Mai 2025	(184.146)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	CAD	702.695	(120.751)	21. Nov. 2023	(115.556)
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	1.115.146	15.838	29. Dez. 2023	(37.315)
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	847.160	(12.405)	30. Apr. 2024	(12.405)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	2.632.795	(229.894)	30. Jun. 2023	122.722
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	706.236	(209.422)	28. Apr. 2023	(139.336)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	1.347.827	(47.281)	28. Mrz. 2024	(47.281)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	416.218	85.888	08. Okt. 2025	84.871
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	852.321	127.594	18. Dez. 2023	116.981
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	1.813.974	(20.820)	02. Jan. 2024	(9.785)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	1.264.272	4.956	08. Mrz. 2024	3.753
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	1.773.553	(51.644)	28. Apr. 2023	141.359
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	5.711.753	(150.357)	31. Okt. 2023	(78.351)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	2.735.066	200.825	28. Feb. 2025	51.193
Verkauf Short	Spielwaren/Spiele/Hobbys	Merrill Lynch	USD	2.647.660	220.733	30. Nov. 2023	294.119
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	USD	1.678.564	(171.861)	07. Nov. 2023	(231.042)
Verkauf Short	Diverse *	Morgan Stanley	EUR	1.920.397	(172.999)	28. Feb. 2025	(161.333)
Verkauf Short	Diverse *	Morgan Stanley	USD	18.574.393	(301.036)	28. Feb. 2025	(412.330)
EUR							5.795.999
Schroder GAIA Helix							
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	JPY	19.419.026	(679.844)	05. Sep. 2023	(679.844)
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	USD	24.737.830	(832.825)	05. Sep. 2023	(832.825)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	123.826.650	(839.326)	05. Sep. 2023	(839.326)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	EUR	15.822.163	(668.669)	05. Sep. 2023	(668.669)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	135.303.744	(6.558.985)	05. Sep. 2023	(6.558.985)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	JPY	82.963.135	(681.028)	05. Sep. 2023	(681.028)
USD							(10.260.677)
Schroder GAIA Sirius US Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	6.227.661	1.091.618	13. Dez. 2023	1.091.648
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	6.242.690	263.884	25. Mrz. 2024	263.884
Kauf Long	Getränke	Merrill Lynch	USD	3.397.564	286.994	21. Nov. 2023	286.994
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	13.328.796	1.034.382	25. Mrz. 2024	1.034.382
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	USD	3.750.667	26.260	28. Jun. 2023	26.347
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Barclays Bank	USD	1.936.950	(22.584)	05. Mai 2023	(34.111)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	1.629.164	24.246	11. Dez. 2023	24.246
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	1.845.181	29.762	08. Jan. 2024	29.762
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	360.889	65.107	13. Dez. 2023	79.758

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

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennwert	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	1.127.522	105.797	25. Mrz. 2024	105.797
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	361.055	35.198	15. Apr. 2024	35.198
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	2.445.790	673.341	16. Apr. 2024	673.341
Verkauf Short	Baustoffe	Merrill Lynch	USD	554.502	(73)	29. Sep. 2023	(73)
Verkauf Short	Chemie	Merrill Lynch	USD	232.636	6.737	02. Okt. 2023	6.737
Verkauf Short	Chemie	Merrill Lynch	USD	184.139	4.384	09. Apr. 2024	4.384
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	545.686	(25.040)	12. Jun. 2024	(25.040)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1.043.349	88.439	16. Okt. 2023	88.439
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	4.200.727	(242.990)	25. Mrz. 2024	(242.990)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	1.053.933	(51.976)	13. Sep. 2023	(51.976)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	369.954	(1.646)	26. Jun. 2023	(1.646)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	256.596	(23.313)	22. Apr. 2024	(23.313)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	560.865	(11.547)	29. Apr. 2024	(11.547)
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Merrill Lynch	USD	991.421	(57.553)	30. Mai 2023	(57.553)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	933.903	37.477	12. Mai 2023	37.477
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	915.638	(157.915)	13. Sep. 2023	(157.915)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1.530.288	160.846	24. Mai 2023	160.846
Verkauf Short	Umweltschutz	Goldman Sachs	USD	942.605	(148.601)	13. Dez. 2023	(131.915)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	8.589.952	(124.631)	12. Mai 2023	(124.631)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	1.967.727	125.055	13. Sep. 2023	125.055
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	8.983.427	1.105.638	13. Dez. 2023	1.105.638
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	10.180.131	(212.650)	12. Jun. 2024	(212.650)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	4.401.558	54.852	26. Mai 2023	54.852
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	358.400	(46.039)	12. Jun. 2023	(46.039)
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	266.885	(11.774)	24. Nov. 2023	(11.774)
Verkauf Short	Forstprodukte und Papier	Merrill Lynch	USD	168.876	1.990	18. Sep. 2023	1.990
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	1.272.159	56.771	30. Okt. 2023	56.771
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	345.569	(63.255)	24. Mai 2023	(63.255)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	1.058.942	(44.392)	11. Dez. 2023	(44.392)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	636.023	(21.992)	10. Apr. 2024	(21.992)
Verkauf Short	Versicherungen	Merrill Lynch	USD	426.990	22.976	15. Dez. 2023	22.976
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	865.152	(52.118)	13. Jul. 2023	(52.118)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	813.959	(302.726)	10. Nov. 2023	(302.915)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	313.418	(31.342)	24. Nov. 2023	(31.342)
Verkauf Short	Metallprodukte/Eisenwaren	Merrill Lynch	USD	1.489.906	7.183	09. Jan. 2024	7.183
Verkauf Short	Öl und Gas	Merrill Lynch	USD	420.935	(14.505)	04. Dez. 2023	(14.505)
Verkauf Short	Öl und Gas	Merrill Lynch	USD	1.209.410	164.986	11. Mrz. 2024	164.986
Verkauf Short	Öl und Gas	Merrill Lynch	USD	187.118	6.316	24. Apr. 2024	6.316
Verkauf Short	Verpackung und Behälter	Merrill Lynch	USD	431.500	(4.331)	04. Dez. 2023	(4.331)
Verkauf Short	Verpackung und Behälter	Merrill Lynch	USD	184.479	(10.067)	22. Apr. 2024	(10.067)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	1.192.549	14.209	13. Jun. 2023	14.209
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	671.439	(37.143)	25. Sep. 2023	(37.143)
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	1.093.159	27.926	24. Okt. 2023	27.926
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	186.104	26.557	26. Dez. 2023	26.557
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	560.937	(8.013)	12. Mai 2023	(8.013)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	1.150.899	11.944	10. Nov. 2023	11.944
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	610.884	(55.247)	18. Dez. 2023	(55.247)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	373.291	(41.103)	09. Feb. 2024	(41.103)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	803.365	(39.461)	25. Mrz. 2024	(39.461)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	188.390	(8.960)	29. Apr. 2024	(8.960)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennwert	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	271.869	(65.557)	13. Dez. 2023	(65.557)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	804.155	70.752	07. Aug. 2023	70.752
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	220.607	28.412	16. Okt. 2023	28.412
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	1.274.516	(35.111)	05. Feb. 2024	(35.111)
USD							3.706.122
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Kauf Long	Diverse *	Morgan Stanley	USD	478.995.521	2.191.713	23. Okt. 2023	2.191.713
USD							2.191.713
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	205.634	19.637	24. Mai 2033	19.637
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	147.874	17.834	18. Mai 2033	17.834
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	GBP	93.387	(887)	24. Mai 2033	(887)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	GBP	545.566	(22.434)	18. Mai 2033	(22.434)
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	USD	71.785	5.031	25. Mai 2033	5.031
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	J.P. Morgan	USD	17.713	13	08. Mai 2028	13
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	292.727	1.547	18. Mai 2033	1.547
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	112.332	5.846	19. Mai 2033	5.846
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	1.550.721	46.113	24. Mai 2033	46.113
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	JPY	227.761	6.185	24. Mai 2033	6.185
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	3.025.410	8.780	24. Mai 2033	8.780
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	CAD	200.278	(11.797)	05. Mai 2028	(11.797)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	1.593.623	(158.204)	05. Mai 2028	(158.204)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	1.466.431	(149.804)	08. Mai 2028	(149.804)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	USD	3.466.694	(299.356)	05. Mai 2028	(299.356)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	CAD	2.502.463	(25.179)	18. Mai 2033	(25.179)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	EUR	825.899	40.671	18. Mai 2033	40.671
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	JPY	1.194.823	278.754	18. Mai 2033	(20.140)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	571.183	14.155	18. Mai 2033	14.155
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	490.419	16.754	24. Mai 2033	16.754
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	187.981	(30.628)	24. Mai 2033	(30.628)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	3.204.166	(22.730)	24. Mai 2033	(22.730)
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	602.897	(5.105)	05. Mai 2028	(5.105)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	230.149	7.395	18. Mai 2033	7.395
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	5.432.035	18.313	18. Mai 2033	18.313
Kauf Long	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	384.728	19.221	18. Mai 2033	19.221
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	EUR	405.044	19.898	24. Mai 2033	19.898
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	HKD	67.301	4.095	24. Mai 2033	4.095
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	USD	66.687	1.665	25. Mai 2033	1.665
Kauf Long	Chemie	Morgan Stanley	USD	20.936	1.886	19. Mai 2033	1.886
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	788.706	(2.528)	24. Mai 2033	(2.528)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	364.273	(13.383)	18. Mai 2033	(13.383)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	246.498	(33.330)	19. Mai 2033	(33.330)
Kauf Long	Computer	Goldman Sachs	USD	560.376	(12.940)	24. Mai 2033	(12.940)
Kauf Long	Computer	J.P. Morgan	USD	101.876	16.993	05. Mai 2028	16.993
Kauf Long	Computer	Morgan Stanley	USD	2.691.176	393.040	18. Mai 2033	393.040
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	CHF	246.321	11.175	24. Mai 2033	11.175
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	124.572	620	24. Mai 2033	620
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	-	-	24. Mai 2033	-
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	537.011	19.703	24. Mai 2033	19.703

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

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennwert	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	891.049	(35.019)	05. Mai 2028	(35.019)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	CHF	466.929	84.496	18. Mai 2033	84.496
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	2.985.976	112.709	18. Mai 2033	112.709
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	EUR	20.368	746	24. Mai 2033	746
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	USD	557.454	9.116	24. Mai 2033	9.116
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	EUR	1.173.644	46.630	05. Mai 2028	46.630
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	HKD	77.545	(8.812)	05. Mai 2028	(8.812)
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	USD	933.401	33.203	05. Mai 2028	33.203
Kauf Long	Elektrik	Morgan Stanley	EUR	6.989	387	18. Mai 2033	387
Kauf Long	Elektrik	Morgan Stanley	USD	644.868	12.605	18. Mai 2033	12.605
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	SGD	64.237	5.274	24. Mai 2033	5.274
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	581.778	15.152	24. Mai 2033	15.152
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	385	-	25. Mai 2033	-
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	USD	603.792	(13.772)	05. Mai 2028	(13.772)
Kauf Long	Elektronik	Morgan Stanley	USD	256.459	30.377	18. Mai 2033	31.827
Kauf Long	Energie – Alternative Energieträger	Goldman Sachs	USD	110.429	(11.980)	24. Mai 2033	(11.980)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	70.106	2.223	24. Mai 2033	2.223
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	311.438	25.240	18. Mai 2033	25.240
Kauf Long	Aktienindex	Goldman Sachs	EUR	713.875	30.305	24. Mai 2033	30.305
Kauf Long	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	1.638.760	71.377	24. Mai 2033	73.477
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	802.342	41.536	18. Mai 2033	41.536
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	2.514.477	71.411	18. Mai 2033	71.860
Kauf Long	Gas	Morgan Stanley	USD	94.665	(801)	18. Mai 2033	(801)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	CHF	100.412	5.466	24. Mai 2033	5.466
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	EUR	1.962	(81)	24. Mai 2033	(81)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	GBP	36.093	(1.242)	24. Mai 2033	(1.242)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	HKD	3.055	44	24. Mai 2033	44
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	3.084.933	92.160	24. Mai 2033	92.160
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	108.427	4.517	25. Mai 2033	4.517
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	3.401.516	148.123	05. Mai 2028	148.123
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	CHF	138.232	6.072	18. Mai 2033	6.072
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	GBP	145.551	(7.167)	18. Mai 2033	(7.167)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	HKD	107.608	(1.145)	18. Mai 2033	(1.145)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	300.693	11.261	18. Mai 2033	11.261
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	3.096.256	(2.687)	24. Mai 2033	(2.687)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	CHF	47.977	(1.451)	05. Mai 2028	(1.451)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	2.107.867	(59.556)	05. Mai 2028	(59.556)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	CHF	234.815	13.252	18. Mai 2033	13.252
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	821.428	5.012	18. Mai 2033	5.012
Kauf Long	Wohngebäude-Bausträger	Goldman Sachs	USD	463.406	11.796	24. Mai 2033	11.796
Kauf Long	Wohngebäude-Bausträger	Morgan Stanley	USD	98.837	1.100	18. Mai 2033	1.100
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	JPY	122.907	4.289	24. Mai 2033	4.289
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	J.P. Morgan	JPY	119.723	2.328	20. Mai 2033	2.328
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	671.166	3.430	18. Mai 2033	3.430
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	EUR	206.072	(10.702)	05. Mai 2028	(10.702)
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	JPY	271.668	(50.011)	08. Mai 2028	(50.011)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	209.294	14.998	18. Mai 2033	14.998
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	JPY	499.224	(16.786)	18. Mai 2033	(16.786)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	221.227	5.672	18. Mai 2033	5.672

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennwert	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	USD	11.826	1.115	24. Mai 2033	1.115
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	HKD	372.905	17.189	18. Mai 2033	17.189
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	371.344	36.000	18. Mai 2033	36.000
Kauf Long	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	JPY	90.712	627	18. Mai 2033	627
Kauf Long	Maschinen – Bau und Bergbau	Morgan Stanley	USD	350.812	7.445	18. Mai 2033	7.445
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	GBP	546.301	31.609	24. Mai 2033	31.609
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	181.024	5.128	24. Mai 2033	5.128
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	EUR	558.740	52.338	18. Mai 2033	52.338
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	322.319	6.747	18. Mai 2033	6.747
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	GBP	167.383	3.346	24. Mai 2033	3.346
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	USD	291.988	2.978	24. Mai 2033	2.978
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	GBP	387.717	(34.834)	05. Mai 2028	(34.834)
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	CAD	673.758	76.884	18. Mai 2033	76.884
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	USD	282.879	17.639	18. Mai 2033	17.639
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	109.072	4.057	18. Mai 2033	4.057
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	3.254.407	(157.327)	05. Mai 2028	(157.327)
Kauf Long	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	70.587	3.535	18. Mai 2033	3.535
Kauf Long	Öl und Gas	Morgan Stanley	GBP	283.586	14.240	18. Mai 2033	14.240
Kauf Long	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	2.886.857	236.160	18. Mai 2033	236.160
Kauf Long	Öl- und Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	156.236	(63.301)	05. Mai 2028	(63.301)
Kauf Long	Öl- und Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	148.419	(18.463)	18. Mai 2033	(18.463)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	360.646	33.307	24. Mai 2033	33.307
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	1.476.135	76.930	24. Mai 2033	76.930
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	1.118.942	30.979	24. Mai 2033	30.979
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	1.752.694	90.537	24. Mai 2033	90.537
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	1.386.109	28.720	24. Mai 2033	28.720
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	144.381	8.505	05. Mai 2028	8.505
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	458.800	21.084	05. Mai 2028	21.084
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	HUF	111.034	(4.467)	05. Mai 2028	(4.467)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	16.196	1.472	08. Mai 2028	1.472
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1.583.627	(21.658)	05. Mai 2028	(21.658)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	202.360	10.923	18. Mai 2033	10.923
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	GBP	262.574	3.645	18. Mai 2033	3.645
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	194.431	7.175	18. Mai 2033	7.175
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1.236.107	15.295	18. Mai 2033	15.295
Kauf Long	Pipelines	Goldman Sachs	USD	152.421	8.069	24. Mai 2033	8.069
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	815.207	(18.075)	05. Mai 2028	(19.907)
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	658.226	33.574	18. Mai 2033	33.574
Kauf Long	Private Equity	J.P. Morgan	USD	1.156.228	(4.005)	05. Mai 2028	(4.005)
Kauf Long	Private Equity	Morgan Stanley	USD	83.650	8.969	18. Mai 2033	8.969
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	USD	558.168	(16.189)	05. Mai 2028	(16.189)
Kauf Long	REITS	Morgan Stanley	USD	100.815	814	18. Mai 2033	814
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	EUR	81.143	1.504	24. Mai 2033	1.504
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	JPY	3.152.587	42.198	24. Mai 2033	42.198
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	1.018.728	34.497	24. Mai 2033	34.497
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	482.306	58.055	24. Mai 2033	58.055
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	1.106.381	180.443	05. Mai 2028	180.443
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	1.664.116	93.243	18. Mai 2033	93.243
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	81.802	(8.503)	05. Mai 2028	(8.503)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennwert	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	1.085.798	62.259	18. Mai 2033	62.259
Kauf Long	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	386.037	44.237	24. Mai 2033	44.237
Kauf Long	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	171.411	27.888	05. Mai 2028	27.888
Kauf Long	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	25.995	4.250	18. Mai 2033	4.250
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	EUR	955.015	(53.826)	18. Mai 2033	(53.826)
Kauf Long	Diverse *	Morgan Stanley	USD	38.062.389	(283.408)	25. Mai 2033	(283.408)
Verkauf Short	Werbung	Goldman Sachs	GBP	184.707	(3.671)	24. Mai 2033	(3.671)
Verkauf Short	Werbung	Goldman Sachs	USD	567.764	(39.947)	24. Mai 2033	(39.947)
Verkauf Short	Werbung	J.P. Morgan	GBP	106.362	7.909	05. Mai 2028	7.909
Verkauf Short	Werbung	Morgan Stanley	USD	98.531	(11.923)	18. Mai 2033	(11.923)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	769.935	(28.802)	24. Mai 2033	(28.802)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	USD	64.418	(4.621)	18. Mai 2033	(4.621)
Verkauf Short	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	USD	594.151	(8.007)	18. Mai 2033	(8.007)
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	USD	143.502	2.711	24. Mai 2033	2.711
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	GBP	143.001	(14.095)	18. Mai 2033	(14.095)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	EUR	313.824	(13.253)	24. Mai 2033	(13.253)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	1.733.423	(177.388)	24. Mai 2033	(189.218)
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	EUR	2.365.505	88.745	05. Mai 2028	88.745
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	807.877	(73.906)	18. Mai 2033	(73.906)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CHF	490.284	(56.140)	24. Mai 2033	(56.140)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	DKK	71.895	(986)	24. Mai 2033	(986)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	8.210.997	63.921	24. Mai 2033	63.234
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	GBP	2.493.335	(66.174)	24. Mai 2033	(66.174)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	JPY	1.340.638	(36.197)	24. Mai 2033	(36.197)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SEK	2.423.602	67.764	24. Mai 2033	67.764
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	5.645.803	(107.985)	24. Mai 2033	(154.044)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	AUD	1.392.057	8.867	05. Mai 2028	8.867
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	CZK	581.249	29.738	05. Mai 2028	29.738
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	2.014.690	164.253	05. Mai 2028	194.717
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	GBP	515.701	(29.340)	05. Mai 2028	(29.340)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	JPY	543.774	26.235	08. Mai 2028	26.235
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	3.758.596	445.133	05. Mai 2028	445.133
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	354.414	320	05. Mai 2028	320
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CAD	5.565.953	(107.530)	18. Mai 2033	(107.530)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CZK	101.639	(6.857)	18. Mai 2033	(6.857)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	EUR	1.016.826	11.714	18. Mai 2033	11.714
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	2.214.863	14.994	18. Mai 2033	16.814
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	SEK	1.853.540	(9.069)	18. Mai 2033	(9.069)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	4.964.165	(246.286)	18. Mai 2033	(246.286)
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	HKD	700	(47)	24. Mai 2033	(47)
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	HKD	531	(15)	05. Mai 2028	(15)
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	HKD	8.686	(214)	18. Mai 2033	(214)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	AUD	117.112	(1.405)	24. Mai 2033	(1.405)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	CHF	448.207	42.549	24. Mai 2033	42.549
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	NOK	44.779	(292)	24. Mai 2033	(292)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	614.624	12.663	24. Mai 2033	12.663
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	AUD	21.791	464	05. Mai 2028	464
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	NOK	12.020	2.517	05. Mai 2028	2.517

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

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennwert	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	509.421	17.818	05. Mai 2028	17.818
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	34.635	(3.081)	08. Mai 2028	(3.081)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	AUD	397.780	(5.910)	18. Mai 2033	(5.910)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	NOK	111.153	3.464	19. Mai 2033	3.464
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	3.625.534	134.707	18. Mai 2033	135.193
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	945.414	(47.501)	24. Mai 2033	(47.501)
Verkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	USD	127.651	5.843	20. Mai 2033	5.843
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	536.957	(25.374)	18. Mai 2033	(25.374)
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	EUR	638.573	(15.895)	24. Mai 2033	(15.895)
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	USD	944.189	(22.545)	24. Mai 2033	(22.545)
Verkauf Short	Chemie	Morgan Stanley	USD	1.353.757	(72.398)	18. Mai 2033	(71.787)
Verkauf Short	Kohle	J.P. Morgan	USD	1.372.641	(13.298)	05. Mai 2028	(13.298)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.416.313	(65.287)	24. Mai 2033	(65.287)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	212.436	(1.778)	05. Mai 2028	(1.778)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	2.553.200	(86.060)	18. Mai 2033	(86.175)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	478.198	(37.908)	24. Mai 2033	(37.908)
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	NOK	90.485	(7.686)	19. Mai 2033	(7.686)
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	2.922.241	(225.797)	18. Mai 2033	(225.797)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	EUR	156.703	(9.909)	24. Mai 2033	(9.909)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	54.791	(6.045)	18. Mai 2033	(6.045)
Verkauf Short	Rentenfonds	Goldman Sachs	USD	146.414	(3.761)	24. Mai 2033	(3.761)
Verkauf Short	Rentenfonds	Morgan Stanley	USD	2.112.980	(59.364)	18. Mai 2033	(59.364)
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Goldman Sachs	EUR	677.063	(25.574)	24. Mai 2033	(23.040)
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Goldman Sachs	USD	598.684	(16.957)	24. Mai 2033	(16.957)
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Morgan Stanley	USD	1.033.186	(27.847)	18. Mai 2033	(27.847)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	1.698.375	(27.655)	24. Mai 2033	(27.655)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	548.929	3.884	24. Mai 2033	3.884
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	SEK	86.094	909	24. Mai 2033	909
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	6.338.363	(228.801)	24. Mai 2033	(228.801)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	593.833	72.231	05. Mai 2028	72.231
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	667.590	57.257	05. Mai 2028	60.439
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	SEK	554.384	74.990	05. Mai 2028	74.990
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	SGD	2.956	(155)	05. Mai 2028	(155)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.089.685	81.905	05. Mai 2028	81.905
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	1.057.439	(60.789)	18. Mai 2033	(60.789)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	SEK	287.154	(4.618)	18. Mai 2033	(4.618)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	SGD	319	(30)	18. Mai 2033	(30)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	8.606.714	(273.534)	18. Mai 2033	(269.710)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	5.934.150	(40.554)	24. Mai 2033	(40.554)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	JPY	693.165	(25.076)	05. Mai 2028	(25.144)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	1.572.490	(42.966)	05. Mai 2028	(42.966)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	138.665	(5.155)	16. Mai 2033	(5.155)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	295.233	(649)	20. Mai 2033	(649)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	3.048.415	(34.555)	18. Mai 2033	(34.555)
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	48.957	(3.612)	11. Dez. 2023	(3.612)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	JPY	956.055	(5.786)	24. Mai 2033	(5.786)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	93.328	(4.744)	24. Mai 2033	(4.744)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	JPY	987.836	(25.869)	08. Mai 2028	(14.167)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	USD	440.123	14.425	05. Mai 2028	14.425

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennwert	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	EUR	56.183	7.176	18. Mai 2033	7.176
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	846.464	(18.431)	18. Mai 2033	(18.431)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	SEK	791.344	(20.788)	18. Mai 2033	(20.788)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	822.778	(32.981)	18. Mai 2033	(32.981)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Goldman Sachs	DKK	914.060	(18.870)	24. Mai 2033	(18.870)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Goldman Sachs	NOK	141.471	2.566	24. Mai 2033	2.566
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Goldman Sachs	SEK	12.477	(134)	24. Mai 2033	(134)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Goldman Sachs	USD	257.720	(77.680)	24. Mai 2033	(77.680)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	J.P. Morgan	EUR	54.599	(3.244)	05. Mai 2028	(3.244)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	J.P. Morgan	JPY	115.326	(3.034)	15. Mai 2033	(3.034)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	J.P. Morgan	SEK	82.522	15.334	05. Mai 2028	15.334
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	J.P. Morgan	USD	1.422.060	128.281	05. Mai 2028	128.281
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	J.P. Morgan	USD	54.602	(2.372)	16. Mai 2033	560
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Morgan Stanley	JPY	169.595	1.567	18. Mai 2033	1.567
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Morgan Stanley	NOK	33.047	108	19. Mai 2033	108
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Morgan Stanley	SEK	39.304	943	18. Mai 2033	943
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Morgan Stanley	USD	461.291	(32.172)	18. Mai 2033	(31.210)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	810.204	(30.468)	24. Mai 2033	(30.468)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	963.256	(77.028)	24. Mai 2033	(77.028)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	340.649	(19.173)	18. Mai 2033	(19.173)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	206.590	(20.699)	18. Mai 2033	(20.699)
Verkauf Short	Unterhaltung	Goldman Sachs	USD	477.595	(27.008)	24. Mai 2033	(27.008)
Verkauf Short	Umweltschutz	Morgan Stanley	USD	747.007	(55.313)	18. Mai 2033	(55.313)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	1.710.823	(34.062)	01. Apr. 2024	(34.062)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	3.992.137	(90.720)	24. Mai 2033	(90.720)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	4.329.736	73.389	05. Mai 2028	226
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	1.469.636	(49.270)	18. Mai 2033	(51.812)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	26.743.343	(1.621.186)	18. Mai 2033	(1.643.935)
Verkauf Short	ETC-Fonds	Morgan Stanley	USD	283.371	34.175	18. Mai 2033	34.175
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	EUR	68.191	(361)	24. Mai 2033	(361)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	GBP	437.504	(29.071)	24. Mai 2033	(29.071)
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	45.953	(330)	05. Mai 2028	(330)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	252.007	(5.612)	18. Mai 2033	(5.612)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	GBP	39.331	(10.369)	18. Mai 2033	(10.369)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	61.423	69.569	18. Mai 2033	(835)
Verkauf Short	Forstprodukte und Papier	Goldman Sachs	EUR	562.445	6.333	24. Mai 2033	6.333
Verkauf Short	Gas	J.P. Morgan	USD	324.791	2.992	05. Mai 2028	2.992
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	USD	197.408	2.464	18. Mai 2033	2.464
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Goldman Sachs	USD	30.589	(1.122)	24. Mai 2033	(1.122)
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	J.P. Morgan	USD	143.478	728	05. Mai 2028	728
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	CHF	278.674	(29.256)	24. Mai 2033	(29.256)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	DKK	352.325	(1.386)	24. Mai 2033	(1.386)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	EUR	1.101.324	52.414	24. Mai 2033	52.414
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	HKD	45.574	(222)	24. Mai 2033	(222)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	645.276	(9.855)	24. Mai 2033	(9.855)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	1.291.033	(91.983)	24. Mai 2033	(91.983)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	DKK	235.800	24.102	05. Mai 2028	24.102
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	HKD	52.851	236	05. Mai 2028	236
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	SEK	236.821	9.074	05. Mai 2028	9.074

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennwert	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	174.789	(47.454)	05. Mai 2028	(47.454)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	HKD	164.149	(2.691)	18. Mai 2033	(2.691)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	SEK	228.693	875	18. Mai 2033	875
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	2.073.374	(161.479)	18. Mai 2033	(161.479)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	1.437.426	(45.434)	24. Mai 2033	(45.434)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.967.821	(100.291)	24. Mai 2033	(100.291)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	254.907	(7.757)	05. Mai 2028	(7.757)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	145.169	(7.804)	05. Mai 2028	(7.804)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	972.994	(23.057)	18. Mai 2033	(23.057)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	659.006	(45.261)	18. Mai 2033	(45.261)
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	401.727	(10.895)	24. Mai 2033	(10.895)
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	1.708.065	(33.664)	18. Mai 2033	(33.664)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	USD	136.350	(3.591)	18. Mai 2033	(3.591)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	EUR	1.679.500	(84.759)	24. Mai 2033	(84.759)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	GBP	656.990	(24.551)	24. Mai 2033	(24.349)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	307.113	(4.315)	24. Mai 2033	(4.315)
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	EUR	820.062	(2)	05. Mai 2028	(2)
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	JPY	1.139	177	08. Mai 2028	177
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	CHF	490.473	(22.470)	18. Mai 2033	(22.470)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	1.435.470	(102.310)	18. Mai 2033	(102.310)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	JPY	796.719	32.079	18. Mai 2033	32.079
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	1.783.756	3.426	18. Mai 2033	11.150
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	264.521	50.461	24. Mai 2033	(33.424)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	1.391.038	(47.752)	18. Mai 2033	(51.815)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Goldman Sachs	USD	655.224	(38.399)	24. Mai 2033	(38.399)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	J.P. Morgan	USD	300.241	(10.900)	05. Mai 2028	(10.900)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	AUD	6.372	(256)	18. Mai 2033	(256)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	USD	233.046	(9.957)	18. Mai 2033	(13.256)
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	JPY	144.574	(14.931)	24. Mai 2033	(14.931)
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	USD	43.327	(1.257)	24. Mai 2033	(1.257)
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	USD	235.798	18.812	05. Mai 2028	18.812
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	JPY	3.055	(198)	18. Mai 2033	(198)
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	97.967	(2.928)	18. Mai 2033	(2.928)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	EUR	75.989	(5.163)	24. Mai 2033	(5.163)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	403.022	(21.894)	24. Mai 2033	(21.894)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	EUR	689.442	74.694	05. Mai 2028	74.694
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	JPY	307.738	(2.852)	08. Mai 2028	(2.852)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	JPY	447.115	(4.077)	18. Mai 2033	(4.077)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	728.245	(61.382)	18. Mai 2033	(61.382)
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	SEK	118.480	801	24. Mai 2033	801
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	USD	20.292	(824)	24. Mai 2033	(824)
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	346.824	(14.001)	18. Mai 2033	(14.001)
Verkauf Short	Metallprodukte/Eisenwaren	Goldman Sachs	EUR	67.708	(2.126)	24. Mai 2033	(2.126)
Verkauf Short	Bergbau	Goldman Sachs	GBP	379.661	(14.229)	24. Mai 2033	(14.229)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	1.362.558	(86.069)	24. Mai 2033	(86.069)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	54.310	5.807	05. Mai 2028	5.807
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	HKD	342.034	(35.376)	18. Mai 2033	(35.376)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	895.996	(38.383)	18. Mai 2033	(38.383)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	AUD	184.552	(4.403)	24. Mai 2033	(4.403)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennwert	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	CAD	70.198	(2.876)	25. Mai 2033	(2.876)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	EUR	1.500.241	(96.093)	24. Mai 2033	(96.093)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	GBP	109.579	(3.630)	24. Mai 2033	(3.630)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	NOK	133.788	343	24. Mai 2033	343
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	USD	858.213	(30.415)	24. Mai 2033	(30.415)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	AUD	42.531	240	05. Mai 2028	240
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	CAD	871.447	11.351	05. Mai 2028	11.351
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	EUR	8.442	436	05. Mai 2028	436
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	7.499.335	273.011	05. Mai 2028	327.938
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	AUD	102.655	3.885	18. Mai 2033	3.885
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	1.880.015	(48.052)	18. Mai 2033	(48.052)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	NOK	133.146	(213)	19. Mai 2033	(213)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	3.455.472	(215.135)	18. Mai 2033	(216.523)
Verkauf Short	Öl- und Gasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.467.336	(39.741)	24. Mai 2033	(39.741)
Verkauf Short	Öl- und Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.373.029	189.382	05. Mai 2028	191.632
Verkauf Short	Öl- und Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	332.941	(11.698)	18. Mai 2033	(11.698)
Verkauf Short	Verpackung und Behälter	Goldman Sachs	USD	58.533	(2.808)	24. Mai 2033	(2.808)
Verkauf Short	Verpackung und Behälter	Morgan Stanley	USD	121.738	(7.443)	18. Mai 2033	(7.443)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	165.829	(6.679)	24. Mai 2033	(6.679)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	DKK	393.941	(38.848)	24. Mai 2033	(38.848)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	1.423.755	12.808	24. Mai 2033	12.808
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	47.400	(1.841)	24. Mai 2033	(1.841)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	134.801	(9.769)	24. Mai 2033	(9.769)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	296.854	(12.834)	24. Mai 2033	(12.834)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	58.819	2.666	24. Mai 2033	2.666
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	738.770	(34.946)	24. Mai 2033	(34.946)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	DKK	24.374	(1.925)	05. Mai 2028	(1.925)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	45.672	3.339	05. Mai 2028	3.339
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	150.800	6.135	05. Mai 2028	6.135
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	21.651	(1.549)	09. Mai 2023	(1.549)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	1.457	(116)	08. Mai 2028	(116)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	5.015	67	09. Mai 2023	67
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	380.702	(6.053)	05. Mai 2028	(6.053)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	DKK	354.999	(33.868)	18. Mai 2033	(33.868)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	1.220.557	(75.622)	18. Mai 2033	(75.622)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	281.518	(20.243)	18. Mai 2033	(20.243)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	3.862.909	(44.430)	18. Mai 2033	(44.430)
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	244.732	(13.900)	24. Mai 2033	(13.900)
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	1.604.056	24.508	05. Mai 2028	54.601
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	USD	1.688.078	(103.907)	18. Mai 2033	(103.907)
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	USD	1.451.533	(77.051)	24. Mai 2033	(77.051)
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	USD	396.641	46.750	05. Mai 2028	46.750
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	USD	3.687.832	(114.406)	18. Mai 2033	(114.406)
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	USD	108.371	631	24. Mai 2033	631
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	SEK	41.990	3.988	05. Mai 2028	3.988
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	EUR	247.400	300	18. Mai 2033	300
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	SEK	176.288	1.032	18. Mai 2033	1.032
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	EUR	10.389	714	24. Mai 2033	714
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	GBP	121.113	(2.342)	24. Mai 2033	(2.342)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennwert	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	167.332	5.514	24. Mai 2033	5.514
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	EUR	733.994	(11.152)	05. Mai 2028	(11.152)
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	945.289	15.366	18. Mai 2033	15.285
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	EUR	24.970	(3.697)	24. Mai 2033	(3.697)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	2.545.439	(149.118)	24. Mai 2033	(149.118)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	1.180.067	23.055	05. Mai 2028	23.055
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	206.788	(25.619)	18. Mai 2033	(25.619)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	2.124.071	(173.707)	18. Mai 2033	(170.515)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	1.435.249	(62.119)	24. Mai 2033	(62.119)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	37.877	(7.445)	09. Mai 2023	(7.381)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	110.825	679	05. Mai 2028	679
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	3.566.113	(158.979)	18. Mai 2033	(160.454)
Verkauf Short	Schiffbau	Morgan Stanley	USD	133.581	(4.761)	18. Mai 2033	(4.761)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	PLN	82.632	12.432	24. Mai 2033	12.432
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	287.438	13.290	24. Mai 2033	13.290
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	928.079	(63.099)	24. Mai 2033	(63.099)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	AUD	194.902	(6.711)	05. Mai 2028	(6.711)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	407.779	(7.403)	05. Mai 2028	(7.403)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	3.489.623	(129.257)	18. Mai 2033	(129.614)
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	912.806	(58.359)	24. Mai 2033	(58.359)
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	JPY	1.049.741	(27.549)	08. Mai 2028	(27.549)
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	184.024	30.991	05. Mai 2028	30.991
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	4.667	(225)	20. Mai 2033	(225)
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	698.356	(30.193)	18. Mai 2033	(27.293)
Verkauf Short	Spielwaren/Spiele/Hobbys	J.P. Morgan	JPY	467.742	(3.775)	08. Mai 2028	(1.327)
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	JPY	687.418	20.305	24. Mai 2033	20.305
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	USD	125.657	(3.917)	24. Mai 2033	(3.917)
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	USD	171.783	(4.474)	24. Mai 2033	(4.474)
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	HKD	5.631	(747)	05. Mai 2028	(761)
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	JPY	236.988	27.014	08. Mai 2028	27.014
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	JPY	81.131	6.551	18. Mai 2033	6.551
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	USD	446.757	(37.103)	18. Mai 2033	(37.103)
Verkauf Short	Wasser	Goldman Sachs	USD	25.338	(503)	24. Mai 2033	(503)
Verkauf Short	Wasser	Morgan Stanley	USD	319.623	(2.732)	18. Mai 2033	(2.732)
USD							(4.192.718)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Differenzkontrakte

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

Zum 31. März 2023 wiesen die folgenden Teilfonds Differenzkontrakte auf Finanzindizes und Futures-Kontrakte auf:

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *				
CFD auf australische Aktien	UBS	237.596	(2.077)	(1.122)
CFD auf chinesische Aktien	UBS	198.250	160.564	160.564
CFD auf Aktien aus Hongkong	UBS	49.684	6.632	6.632
CFD auf italienische Aktien	UBS	30.500	(2.137)	(2.137)
CFD auf Aktien aus Macau	UBS	23.000	440	440
CFD auf neuseeländische Aktien	UBS	50.794	3.335	3.335
CFD auf Aktien aus Singapur	UBS	134.977	50.715	50.715
CFD auf südkoreanische Aktien	UBS	(7.851)	(50.882)	(50.882)
CFD auf US-Aktien	UBS	69.410	28.467	28.467
CFD auf MSCI AC Pacific ex Japan Index	UBS	(7.318)	(352.127)	(352.171)
			USD	(157.070)
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD auf Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Bank of America	1.242	833.007	61.176
CFD auf Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Bank of America	2.716	429.808	(10.878)
CFD auf Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Bank of America	309	199.217	(161.181)
CFD auf Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Bank of America	363	479.553	1.152
CFD auf Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Bank of America	1.033	656.713	(7.825)
CFD auf Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Bank of America	(1.310)	(850.982)	13.230
CFD auf Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Bank of America	190	164.216	(115.855)
CFD auf Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Bank of America	83	92.764	(185)
CFD auf Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Index	Bank of America	1.271	984.591	(28.281)
CFD auf Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Bank of America	430	149.969	(358.405)
CFD auf Stoxx Europe 600 Media Price Index	Bank of America	2.908	1.156.692	58.912
CFD auf Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Bank of America	(601)	(219.534)	(2.506)
CFD auf Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Bank of America	763	907.639	37.139
CFD auf Stoxx Europe 600 Retail Price Index	Bank of America	1.533	606.511	7.290
CFD auf Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Bank of America	1.054	796.223	18.180
CFD auf Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Bank of America	(2.083)	(489.235)	66.074
CFD auf Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Bank of America	3.044	781.893	17.847
CFD auf Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Bank of America	4.918	2.050.171	73.651
CFD auf S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	(1.680)	(1.955.488)	(117.828)
CFD auf S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	498	388.630	603
CFD auf S&P 500 Energy Sector Index	Goldman Sachs	(1.891)	(1.200.598)	(24.438)
CFD auf S&P 500 Financials Sector Index	Goldman Sachs	(3.136)	(1.678.626)	(423.522)
CFD auf S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	(1.728)	(2.610.543)	(409.903)
CFD auf S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	769	658.719	(739.651)
CFD auf S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	254	670.300	(26.900)
CFD auf S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	(2.412)	(1.225.098)	(715.425)
CFD auf S&P 500 Utilities Sector Index	Goldman Sachs	(5.030)	(1.730.363)	(200.481)
			USD	46.149
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
CFD auf australische Aktien	Morgan Stanley	(47.582)	(360.379)	(360.379)
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	(84.978)	(25.805)	(25.805)
CFD auf kanadische Aktien	Morgan Stanley	(18.689)	(915)	(915)

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)				
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	(14.256)	14.440	14.440
CFD auf deutsche Aktien	Morgan Stanley	208.000	991.819	991.819
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	(9.477)	(94.062)	(94.062)
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	(91.942)	(204.135)	(204.135)
CFD auf neuseeländische Aktien	Morgan Stanley	(29.950)	(18.634)	(18.634)
CFD auf norwegische Aktien	Morgan Stanley	346.337	148.858	148.858
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(579.632)	(2.736.996)	(2.737.190)
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(1.214.384)	(4.152.263)	(4.152.407)
			USD (6.438.072)	(6.438.410)
Schroder GAIA Helix				
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	495.440	121.191	121.191
CFD auf australische Aktien	J.P. Morgan	11.620.760	529.693	529.693
CFD auf österreichische Aktien	Goldman Sachs	22.718	(151.300)	(151.300)
CFD auf österreichische Aktien	J.P. Morgan	10.273	5.469	5.469
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	(4.249)	(96.864)	(96.864)
CFD auf brasilianische Aktien	Goldman Sachs	147	13.424	13.424
CFD auf brasilianische Aktien	J.P. Morgan	1.322	178.880	178.880
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	8.951.972	92.393	92.393
CFD auf britische Aktien	J.P. Morgan	590.187	417.494	417.494
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	40.690	(72.024)	(72.024)
CFD auf kanadische Aktien	J.P. Morgan	17.598	40.711	40.711
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	5.600.951	683.844	683.844
CFD auf chinesische Aktien	J.P. Morgan	6.296.510	2.788.968	2.788.968
CFD auf tschechische Aktien	Goldman Sachs	(30.732)	(43.579)	(43.579)
CFD auf dänische Aktien	Goldman Sachs	13.703	10.755	10.755
CFD auf dänische Aktien	J.P. Morgan	46.412	201.696	201.696
CFD auf niederländische Aktien	Goldman Sachs	376.504	31.656	31.656
CFD auf niederländische Aktien	J.P. Morgan	76.882	147.709	147.709
CFD auf finnische Aktien	Goldman Sachs	(29.123)	34.014	34.014
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	87.429	(169.431)	(169.431)
CFD auf französische Aktien	J.P. Morgan	126.408	152.242	152.242
CFD auf georgische Aktien	Goldman Sachs	(39.116)	89.475	89.475
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	100.736	126.894	126.894
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	91.717	348.613	348.613
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	1.936.882	(133.635)	(221.296)
CFD auf Aktien aus Hongkong	J.P. Morgan	870.837	717.879	717.879
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	7.987	(8.386)	(8.386)
CFD auf indische Aktien	J.P. Morgan	57.534	168.575	168.575
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	(5.272)	(16.516)	(16.516)
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	1.367	21.216	21.216
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	77.468	6.861	6.861
CFD auf italienische Aktien	J.P. Morgan	251.084	112.225	112.225
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	1.351.749	(892.189)	(892.189)
CFD auf japanische Aktien	J.P. Morgan	7.626.900	5.058.403	5.058.403
CFD auf Aktien aus Macau	Goldman Sachs	108.000	(6.705)	(6.705)
CFD auf Aktien aus Macau	J.P. Morgan	137.000	40.140	40.140
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	40.686	(4.316)	(4.316)
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P. Morgan	299.761	30.007	30.007
CFD auf norwegische Aktien	Goldman Sachs	120.746	(93.351)	(93.351)
CFD auf norwegische Aktien	J.P. Morgan	129.582	56.620	56.620

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
CFD auf peruanische Aktien	J.P. Morgan	13.918	111.901	111.901	
CFD auf polnische Aktien	Goldman Sachs	(211)	(10.741)	(10.741)	
CFD auf polnische Aktien	J.P. Morgan	(30.723)	122.355	122.355	
CFD auf portugiesische Aktien	J.P. Morgan	83.830	48.453	48.453	
CFD auf russische Aktien	Goldman Sachs	6.978	-	-	
CFD auf saudi-arabische Aktien	J.P. Morgan	229.160	376.972	376.972	
CFD auf Aktien aus Singapur	Goldman Sachs	782.178	(33.133)	(33.133)	
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	832.696	468.398	468.398	
CFD auf südafrikanische Aktien	Goldman Sachs	(91.064)	(1.970)	(1.970)	
CFD auf südkoreanische Aktien	Goldman Sachs	(48.780)	(28.472)	(28.472)	
CFD auf südkoreanische Aktien	J.P. Morgan	(2.164)	(73.244)	(73.244)	
CFD auf spanische Aktien	Goldman Sachs	131.625	(135.920)	(135.920)	
Schroder GAIA Helix (Forts.)					
CFD auf spanische Aktien	J.P. Morgan	136.082	158.023	158.023	
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	(293.739)	(96.886)	(96.886)	
CFD auf schwedische Aktien	J.P. Morgan	251.583	157.926	157.926	
CFD auf Aktien aus der Schweiz	Goldman Sachs	2.696	(42.707)	(42.707)	
CFD auf Aktien aus der Schweiz	J.P. Morgan	69.893	460.640	460.640	
CFD auf taiwanische Aktien	Goldman Sachs	7.198	23.250	23.250	
CFD auf türkische Aktien	Goldman Sachs	1.706.898	(213.126)	(213.126)	
CFD auf Aktien aus den Vereinigten Arabischen Emiraten	J.P. Morgan	(125.380)	32.329	32.329	
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	583.456	1.178.283	1.242.175	
CFD auf US-Aktien	J.P. Morgan	552.955	1.293.392	1.293.392	
CFD auf FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(454)	(243.159)	(243.159)	
CFD auf GS UK Custom Index	Goldman Sachs	(36.338)	(173.880)	(173.880)	
CFD auf HXE High Vol Reversal Index	Goldman Sachs	(33.288)	207.051	207.051	
CFD auf HXE Pharma Index	Goldman Sachs	67.611	105.351	105.351	
CFD auf HXE Semis Index	Goldman Sachs	(59.640)	(364.278)	(364.278)	
CFD auf HXE Staples Index	Goldman Sachs	165.998	836.514	836.514	
CFD auf MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(43.001)	(407.649)	(407.649)	
CFD auf MSCI EM Europe 10/40 Index	Goldman Sachs	(1.251)	98.566	98.566	
CFD auf MSCI EM Latin America 10/40 Gross Total Return Index	Goldman Sachs	(11.682)	37.247	36.316	
CFD auf JPHEUKT3 Index	J.P. Morgan	122.578	418.977	418.977	
CFD auf MSCI PROV Saudi Arabia Gross Total Return Index	J.P. Morgan	(802)	(54.139)	(54.139)	
			USD	14.795.075	14.770.375
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *					
CFD auf britische Aktien	Bank of America	(6.802)	(1.819)	(1.819)	
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	492.745	159.054	165.670	
CFD auf niederländische Aktien	Morgan Stanley	27.157	5.118	5.572	
CFD auf irische Aktien	Morgan Stanley	(7.635)	(8.653)	(8.653)	
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(29.467)	(56.033)	(56.033)	
CFD auf FTSE UK Mid Cap Tradable Plus Index	Bank of America	(1.394)	(161.328)	(161.009)	
CFD auf MSBEUK01 Index	Morgan Stanley	(18.670)	(54.330)	(65.438)	
			GBP	(117.991)	(121.710)

Credit Default Index-Swapkontrakte

Ein Credit Default Index Swap ermöglicht die Übertragung von Ausfallrisiken. Dadurch kann der Fonds einen effektiven Versicherungsschutz in Bezug auf eine von ihm gehaltene Referenzindexanleihe (Absicherung der Investition) oder einen Schutz in Bezug auf eine Referenzindexanleihe erwerben, die er nicht physisch besitzt, in der Erwartung, dass die Qualität des Kredits abnimmt. Eine Vertragspartei, der Sicherungsnehmer, leistet regelmäßige Zahlungen an den Sicherungsgeber und erhält dafür bei Eintritt eines Kreditereignisses (ein Rückgang der Kreditqualität, der zuvor von den Parteien vertraglich 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 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.

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Credit Default Index-Swapkontrakte (Forts.)

Credit Default Indizes wurden zu ihrem inneren Wert bewertet. Die Bewertungsmethode beinhaltet den aktuellen Wert der Zinsserie und den aktuellen Wert des Credit-Spread, der zum Schlusstermin 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-Swapkontrakte“ aufgeführt.

Am 31. März 2023 waren die folgenden Teilfonds an Credit Default Indizes-Kontrakte auf Finanzindizes gebunden:

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten %	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 39 20/06/2028	J.P. Morgan	EUR	8.000.000	5,00	20. Jun. 2028	193.574
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 39 20/06/2028	J.P. Morgan	EUR	30.000.000	1,00	20. Jun. 2028	199.472
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Verkauf	CDX North America High Yield Series 40 20/06/2028	J.P. Morgan	USD	5.000.000	5,00	20. Jun. 2028	68.832
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 40 20/06/2028	J.P. Morgan	USD	43.000.000	1,00	20. Jun. 2028	405.517
USD							867.395
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 39 20/06/2028	Citi Bank	EUR	10.000.000	1,00	20. Jun. 2028	(184.644)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 39 20/06/2028	Citi Bank	EUR	16.000.000	1,00	20. Jun. 2028	192.882
Verkauf	CDX North America High Yield Series 40 20/06/2028	Citi Bank	USD	20.000.000	5,00	20. Jun. 2028	252.329
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 40 20/06/2028	Citi Bank	USD	20.000.000	1,00	20. Jun. 2028	(155.599)
USD							104.968
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	2.065.000	5,00	20. Dez. 2027	35.657
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	6.980.000	1,00	20. Dez. 2027	34.022
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 39 20/06/2028	Morgan Stanley	EUR	17.234.000	1,00	20. Jun. 2028	(123.981)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	24.000.000	1,00	20. Dez. 2027	(245.247)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 39 20/06/2028	Morgan Stanley	EUR	155.000	1,00	20. Jun. 2028	689
Verkauf	CDX iTraxx Europe Subordinated Financial Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	3.970.000	1,00	20. Dez. 2027	(122.352)
Verkauf	CDX North America High Yield Series 40 20/06/2028	Morgan Stanley	USD	260.000	5,00	20. Jun. 2028	(3.644)
USD							(424.856)

Credit-Default-Swap-Kontrakte

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

Credit Default Swaps wurden zu ihrem inneren Wert bewertet. Die Bewertungsmethode beinhaltet den aktuellen Wert der Zinsserie und den aktuellen Wert des Credit-Spread, der zum 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-Swap-Kontrakte“ aufgeführt.

Zum 31. März 2023 war der folgende Teilfonds an Credit Default Swap-Kontrakte gebunden:

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	Österreich	Telekommunikation	Morgan Stanley	EUR	6.720.000	20. Jun. 2028	(31.073)
Verkauf	Belgien	Chemie	Morgan Stanley	EUR	1.990.000	20. Jun. 2028	(3.384)
Verkauf	Kanada	Pipelines	Morgan Stanley	USD	795.000	20. Jun. 2028	(3.906)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Credit-Default-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf	China	Banken	Goldman Sachs	USD	2.390.000	20. Jun. 2028	7.291
Verkauf	China	Banken	Morgan Stanley	USD	6.330.000	20. Jun. 2028	20.664
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	8.630.000	20. Jun. 2028	(7.339)
Verkauf	Finnland	Verpackung und Behälter	Morgan Stanley	EUR	5.190.000	20. Jun. 2028	(11.895)
Verkauf	Frankreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1.380.000	20. Jun. 2028	(154)
Verkauf	Frankreich	Baustoffe	Morgan Stanley	EUR	2.850.000	20. Jun. 2028	2.526
Verkauf	Frankreich	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	2.325.000	20. Jun. 2028	(33.294)
Verkauf	Frankreich	Vertrieb/Großhandel	Morgan Stanley	EUR	2.140.000	20. Jun. 2028	(10.358)
Verkauf	Frankreich	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	3.970.000	20. Jun. 2028	(2.995)
Verkauf	Frankreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	8.440.000	20. Jun. 2028	(57.313)
Verkauf	Frankreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	4.060.000	20. Jun. 2028	2.957
Verkauf	Frankreich	REITS	Morgan Stanley	EUR	4.480.000	20. Jun. 2028	72.086
Verkauf	Deutschland	Fluggesellschaften	Morgan Stanley	EUR	2.150.000	20. Jun. 2028	(34.190)
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Barclays Bank	EUR	1.440.000	20. Jun. 2027	36.071
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1.440.000	20. Jun. 2027	(13.003)
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	7.550.000	20. Jun. 2028	(27.770)
Verkauf	Deutschland	Chemie	Morgan Stanley	EUR	2.290.000	20. Jun. 2028	7.698
Verkauf	Deutschland	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	EUR	4.390.000	20. Jun. 2028	(4.011)
Kauf	Italien	Banken	BNP Paribas	EUR	1.530.000	20. Jun. 2028	5.608
Verkauf	Luxemburg	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	EUR	3.610.000	20. Jun. 2028	(44.053)
Verkauf	Malaysia	Banken	Morgan Stanley	EUR	4.785.000	20. Jun. 2028	(126.454)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1.560.000	20. Jun. 2028	(2.059)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	2.000.000	20. Jun. 2028	(18.960)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	410.000	20. Dez. 2025	(4.021)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	805.000	20. Jun. 2027	(28.788)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	950.000	20. Dez. 2027	(21.730)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Banken	Goldman Sachs	EUR	4.130.000	20. Jun. 2028	(45.409)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	2.950.000	20. Jun. 2028	(12.763)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	6.360.000	20. Jun. 2028	8.720
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Unterhaltung	Morgan Stanley	EUR	400.000	20. Jun. 2028	5.041
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	780.000	20. Dez. 2024	1.623
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Gastronomie	Morgan Stanley	EUR	2.170.000	20. Jun. 2028	(5.131)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	9.230.000	20. Jun. 2028	(32.650)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	3.730.000	20. Jun. 2028	(33.281)
Verkauf	USA	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1.720.000	20. Jun. 2028	(13.248)
Verkauf	USA	Kraftfahrzeuge	Morgan Stanley	USD	1.590.000	20. Jun. 2028	(30.891)
Verkauf	USA	Banken	Goldman Sachs	USD	1.035.000	20. Jun. 2028	(292)
Verkauf	USA	Banken	J.P. Morgan	USD	1.035.000	20. Jun. 2028	8.218
Verkauf	USA	Banken	Morgan Stanley	USD	3.070.000	20. Jun. 2028	32.372
Verkauf	USA	Kabel-Satellit	Morgan Stanley	USD	1.885.000	20. Jun. 2028	2.286
Verkauf	USA	Chemie	Morgan Stanley	USD	795.000	20. Jun. 2028	(1.218)
Kauf	USA	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	500.000	20. Dez. 2024	26.339
Verkauf	USA	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	2.950.000	20. Jun. 2028	(7.355)
Verkauf	USA	Elektronik	Morgan Stanley	USD	1.590.000	20. Jun. 2028	3.214
Kauf	USA	Lebensmittel	J.P. Morgan	USD	215.000	20. Jun. 2028	(2.144)
Verkauf	USA	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	910.000	20. Jun. 2025	(38.910)
Verkauf	USA	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.885.000	20. Jun. 2028	2.682
Verkauf	USA	Medien	Morgan Stanley	USD	1.155.000	20. Dez. 2024	141.405

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Credit-Default-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf	USA	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	795.000	20. Jun. 2028	(2.927)
Verkauf	USA	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	795.000	20. Jun. 2028	3.140
Kauf	USA	Immobilien	J.P. Morgan	USD	705.000	20. Jun. 2024	(14.825)
Verkauf	USA	Immobilien	Morgan Stanley	USD	355.000	20. Jun. 2028	(12.741)
Verkauf	USA	REITS	Morgan Stanley	USD	795.000	20. Jun. 2028	(17.409)
Kauf	USA	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	630.000	20. Dez. 2027	(17.586)
Verkauf	USA	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	960.000	20. Dez. 2027	(26.797)
Verkauf	USA	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	2.680.000	20. Jun. 2028	(4.278)
USD							(416.664)

Cross-Currency-Swap-Kontrakte

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-Swap-Kontrakte“ aufgeführt. Ein Cross-Currency Swap ist ein Vertrag, mit dem sich zwei Parteien dazu verpflichten, in einer bestimmten Periode auf zwei verschiedene Währungen lautende Zinszahlungen auszutauschen.

Zum 31. März 2023 war der folgende Teilfonds in Cross-Currency-Swap-Kontrakte 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	14.096.000	USD	2.060.638	20. Sep. 2025	2,92 %	USD SOFR 1 Tag	(12.451)
Morgan Stanley	USD	25.589.564	AUD	35.059.000	20. Sep. 2028	USD SOFR 1 Tag	AUD BBR 3 Monate	(4.391)
Morgan Stanley	USD	23.695.077	CAD	32.249.000	20. Sep. 2028	USD SOFR 1 Tag	CAD BA 3 Monate	347.708
Morgan Stanley	USD	27.950.187	NOK	247.334.000	20. Sep. 2028	USD SOFR 1 Tag	NOK NIBOR 3 Monate	(6.052)
Morgan Stanley	USD	25.690.740	NZD	37.825.000	20. Sep. 2028	USD SOFR 1 Tag	NZD BBR 3 Monate	485
Morgan Stanley	USD	25.668.137	SEK	248.465.000	20. Sep. 2028	USD SOFR 1 Tag	SEK STIBOR 3 Monate	21.609
USD								346.908

Inflations-Swap-Kontrakten

Ein Inflations-Swap ermöglicht die Übertragung von Inflationsrisiken. Eine Vertragspartei versucht, ihr Risiko zu reduzieren (durch Absicherung), die andere Vertragspartei hingegen setzt sich einem höheren Risiko aus (durch Spekulation). Die Partei, die ihr Inflationsrisiko absichern möchte, zahlt die an einen Inflationsindex gebundene variable Prämie und erhält ihrerseits festgelegte Cashflows. Durch den Austausch von „variabel“ gegen „fest“ verringert sich für die absichernde Partei das Inflationsrisiko und erhöht sich die Sicherheit bezüglich zukünftiger Cashflows. Inflations-Swaps wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Inflations-Swap-Kontrakten“ aufgeführt.

Zum 31. März 2023 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Inflationsraten engagiert:

Nennwert	Währung	Kontrahent	Wertpapierbeschreibung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
5.675.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,43 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	7.867
10.222.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,45 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	(9.990)
5.675.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,46 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	(9.635)
5.675.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,49 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	(9.882)
10.222.000	EUR	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,48 %, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	10.864

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Inflations-Swap-Kontrakten (Forts.)

Nennwert	Währung	Kontrahent	Wertpapierbeschreibung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
5.675.000	EUR	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,53 %, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	21.445
6.155.000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,32 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	71.760
6.157.000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,35 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	58.300
6.464.000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,38 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	38.766
6.463.000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,40 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	28.840
12.312.000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,31 %, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	(94.489)
6.463.000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,40 %, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	(18.386)
6.464.000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,41 %, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	(17.717)
USD					77.743

Zins-Swap-Kontrakte

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

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

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

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

Zum 31. März 2023 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Zinssätze engagiert:

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Zahlt Festzinssatz 3,68 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	8.475.467	USD	21. Jun. 2043	(711.662)
Erhält Festzinssatz 0,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	339.794.661	JPY	21. Jun. 2043	(64.367)
Erhält Festzinssatz 2,91 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	6.475.467	USD	21. Jun. 2043	(186.777)
Zahlt Festzinssatz 3,46 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	8.169.036	USD	21. Jun. 2048	(629.681)
Erhält Festzinssatz 2,82 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	6.369.036	USD	21. Jun. 2048	(209.928)
Erhält Festzinssatz 3,42 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	23.148.633	USD	21. Jun. 2025	(189.535)
Zahlt Festzinssatz 4,59 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	31.148.633	USD	21. Jun. 2025	(440.124)
Zahlt Festzinssatz 2,16 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	11.639.448	CHF	21. Jun. 2033	(261.686)
Zahlt Festzinssatz 3,84 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	16.375.118	USD	21. Jun. 2030	(676.387)
Zahlt Festzinssatz 2,05 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	14.919.292	CHF	21. Jun. 2028	(111.070)
Erhält Festzinssatz 2,89 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	12.375.118	USD	21. Jun. 2030	(216.690)
Erhält Festzinssatz 1,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	8.439.448	CHF	21. Jun. 2033	(490.530)
Erhält Festzinssatz 1,18 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	5.919.292	CHF	21. Jun. 2028	(228.865)
Zahlt Festzinssatz 4,19 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	19.882.593	USD	21. Jun. 2027	(606.677)
Erhält Festzinssatz 2,86 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	15.882.593	USD	21. Jun. 2027	(286.080)
Zahlt Festzinssatz 1,36 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	819.794.661	JPY	21. Jun. 2043	(399.821)
Erhält Festzinssatz 11,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	26.277.260	BRL	01. Feb. 2026	25.768
Zahlt Festzinssatz 13,60 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	117.690.479	BRL	02. Jan. 2025	(463.025)
Erhält Festzinssatz 11,42 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	27.690.479	BRL	02. Jan. 2025	16.223
Zahlt Festzinssatz 13,48 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	66.277.260	BRL	01. Feb. 2026	(452.693)
Erhält Festzinssatz 11,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	90.000.000	BRL	02. Jan. 2025	3.740
Erhält Festzinssatz 2,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	4.828.387	SEK	21. Jun. 2033	(23.777)
Zahlt Festzinssatz 4,64 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	14.000.000	NZD	21. Jun. 2025	45.598
Erhält Festzinssatz 2,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	92.808.063	SEK	21. Jun. 2025	(127.349)
Zahlt Festzinssatz 3,98 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	264.808.063	SEK	21. Jun. 2025	(257.778)
Erhält Festzinssatz 7,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	316.445.744	ZAR	21. Jun. 2025	(183.372)
Zahlt Festzinssatz 8,27 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	316.445.744	ZAR	21. Jun. 2025	(132.488)
Zahlt Festzinssatz 4,69 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	6.000.000	NZD	21. Jun. 2028	(54.923)
Zahlt Festzinssatz 8,56 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	105.347.088	ZAR	21. Jun. 2028	(85.457)
Zahlt Festzinssatz 3,55 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	161.536.290	SEK	21. Jun. 2028	(395.066)
Erhält Festzinssatz 7,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	175.347.088	ZAR	21. Jun. 2028	(204.831)
Zahlt Festzinssatz 9,57 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	88.834.086	ZAR	21. Jun. 2033	(147.164)
Erhält Festzinssatz 8,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	48.834.086	ZAR	21. Jun. 2033	(82.156)
Erhält Festzinssatz 2,40 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	89.536.290	SEK	21. Jun. 2028	(230.045)
Zahlt Festzinssatz 3,91 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	64.828.387	SEK	21. Jun. 2033	(566.006)
Erhält Festzinssatz 3,99 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	161.569	NZD	21. Jun. 2033	(2.269)
Zahlt Festzinssatz 4,74 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	3.161.569	NZD	21. Jun. 2033	(74.988)
Erhält Festzinssatz 3,98 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	1.618.940	EUR	21. Jun. 2025	19.717
Zahlt Festzinssatz 2,74 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	9.618.940	EUR	21. Jun. 2025	128.699
Erhält Festzinssatz 1,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	120.000.000	JPY	21. Jun. 2043	1.874
Zahlt Festzinssatz 9,14 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	114.374.536	MXN	14. Jun. 2028	(195.175)
Zahlt Festzinssatz 8,98 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	99.713.590	MXN	08. Jun. 2033	(258.418)
Zahlt Festzinssatz 8,88 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	435.992.481	MXN	18. Jun. 2025	296.415
Erhält Festzinssatz 8,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	49.713.590	MXN	08. Jun. 2033	187
Erhält Festzinssatz 10,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	265.992.481	MXN	18. Jun. 2025	116.191
Erhält Festzinssatz 7,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	34.374.536	MXN	14. Jun. 2028	(47.501)
Zahlt Festzinssatz 1,97 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	1.600.000	CHF	21. Jun. 2033	(6.152)
Zahlt Festzinssatz 1,96 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	3.000.000	CHF	21. Jun. 2028	(8.680)
				USD	(9.054.781)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Zahlt Festzinssatz 1,63 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	160.000	USD	06. Feb. 2028	7.816
Erhält Festzinssatz 2,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4.421.000	USD	15. Dez. 2032	10.561
Erhält Festzinssatz 2,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	2.549.000	GBP	20. Dez. 2024	(27.131)
Zahlt Festzinssatz 0,63 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	78.928.000	JPY	15. Dez. 2032	1.178
Zahlt Festzinssatz 5,78 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	50.952.000	PLN	20. Mrz. 2025	(18.448)
Zahlt Festzinssatz 3,16 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	5.173.000	USD	20. Mrz. 2025	12.439
Erhält Festzinssatz 3,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	5.290.000	CAD	19. Mrz. 2028	87.309
Zahlt Festzinssatz 11,08 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	67.306.000	ZAR	15. Mrz. 2033	(55.153)
Zahlt Festzinssatz 11,14 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	40.091.000	ZAR	15. Mrz. 2033	(36.067)
Erhält Festzinssatz 2,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	23.599.000	CNY	19. Mrz. 2028	(30.415)
Erhält Festzinssatz 4,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	10.714.000	NZD	21. Dez. 2032	166.498
Zahlt Festzinssatz 4,67 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.670.000	NZD	15. Mrz. 2033	(20.310)
Erhält Festzinssatz 8,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	32.474.000	MXN	09. Mrz. 2033	36.920
Erhält Festzinssatz 8,82 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	63.806.000	MXN	09. Mrz. 2033	67.790
Erhält Festzinssatz 8,83 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	63.235.000	MXN	09. Mrz. 2033	68.731
Erhält Festzinssatz 4,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	8.209.000	GBP	21. Jun. 2025	(20.412)
Erhält Festzinssatz 3,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	7.500.000	GBP	21. Jun. 2028	(1.624)
Erhält Festzinssatz 2,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	13.073.000	USD	18. Jun. 2028	(4.877)
Erhält Festzinssatz 2,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	5.337.000	SGD	20. Mrz. 2025	(2.006)
Erhält Festzinssatz 13,01 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	6.112.355	BRL	01. Apr. 2027	39.693
Erhält Festzinssatz 4,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.318.049.000	CLP	21. Jun. 2033	18.361
Erhält Festzinssatz 9,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	84.235.000	MXN	18. Dez. 2024	(50.905)
Erhält Festzinssatz 13,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Citi Bank	5.569.384	BRL	04. Jan. 2027	43.951
Erhält Festzinssatz 13,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	BNP Paribas	5.570.364	BRL	04. Jan. 2027	43.740
Zahlt Festzinssatz 10,45 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	12.555.000	ZAR	21. Jun. 2033	2.637
Erhält Festzinssatz 12,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	HSBC	7.203.973	BRL	04. Jan. 2027	44.170
Zahlt Festzinssatz 10,51 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	37.771.000	ZAR	21. Jun. 2033	4.878
Erhält Festzinssatz 12,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	5.075.163	BRL	04. Jan. 2027	21.087
Zahlt Festzinssatz 9,93 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.982.902.000	COP	21. Jun. 2028	(23.411)
Zahlt Festzinssatz 9,93 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.799.941.000	COP	21. Jun. 2028	(33.086)
Erhält Festzinssatz 12,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	4.089.595	BRL	04. Jan. 2027	(1.789)
Erhält Festzinssatz 12,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	3.351.325	BRL	04. Jan. 2027	(2.858)
Zahlt Festzinssatz 5,02 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 9,38 %	Morgan Stanley	2.660.000	PLN	21. Jun. 2033	17.107
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Erhält Festzinssatz 11,98 %	Morgan Stanley	2.753.195.000	COP	21. Jun. 2033	(33.627)
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day Erhält Festzinssatz 3,03 %	Barclays Bank	2.370.494	BRL	01. Apr. 2027	(4.326)
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 8,26 %	Morgan Stanley	3.750.000	USD	21. Jun. 2033	13.143
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 12,89 %	Morgan Stanley	20.091.000	MXN	25. Jan. 2033	(9.281)
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day Zahlt Festzinssatz 7,64 %	Bank of America	2.331.023	BRL	04. Jan. 2027	13.005
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 3,74 %	Morgan Stanley	142.861.000	HUF	21. Jun. 2033	10.504
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 3,07 %	Morgan Stanley	772.288	ILS	21. Jun. 2033	(424)
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day Zahlt Festzinssatz 3,91 %	Morgan Stanley	770.000	SGD	21. Jun. 2033	11.793
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Zahlt Festzinssatz 5,92 %	Morgan Stanley	10.270.000	USD	21. Jun. 2028	(190.173)
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 5,42 %	Morgan Stanley	2.598.820.000	CLP	22. Jun. 2028	(95.030)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 5,88 %	Morgan Stanley	4.950.625.000	CLP	22. Jun. 2033	221.101
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 7,40 %	Morgan Stanley	9.334.545.000	CLP	22. Jun. 2028	(323.983)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 9,50 %	Morgan Stanley	10.853.200.000	CLP	22. Jun. 2025	168.013
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Erhält Festzinssatz 9,74 %	Morgan Stanley	18.246.985.000	COP	21. Jun. 2033	(253.633)
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 3,47 %	Morgan Stanley	11.031.120.000	COP	21. Jun. 2028	112.392
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day Erhält Festzinssatz 3,22 %	Morgan Stanley	5.705.000	SGD	20. Sep. 2028	(127.773)
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day Erhält Festzinssatz 3,76 %	Morgan Stanley	8.342.000	SGD	17. Sep. 2028	83.712
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day Zahlt Festzinssatz 3,00 %	Morgan Stanley	20.978.000	SGD	20. Sep. 2025	247.379
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Zahlt Festzinssatz 5,19 %	Morgan Stanley	67.328.000	CNY	20. Sep. 2028	(30.541)
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 3,97 %	Morgan Stanley	4.108.350.000	CLP	20. Sep. 2033	(160.912)
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 3,53 %	Standard Chartered Bank	6.467.000	MYR	17. Sep. 2028	(6.674)
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day Erhält Festzinssatz 4,48 %	Morgan Stanley	6.074.000	GBP	20. Sep. 2033	(154.078)
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 4,50 %	Morgan Stanley	13.945.000	USD	21. Jun. 2025	194.274

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	13.950.000	USD	21. Jun. 2025	199.602
Erhält Festzinssatz 3,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	149.000	GBP	20. Sep. 2033	1.350
Zahlt Festzinssatz 3,50 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	16.446.000	USD	20. Sep. 2028	(55.281)
Erhält Festzinssatz 12,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	29.269.294	BRL	02. Jan. 2025	16.509
Erhält Festzinssatz 4,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	7.551.000	USD	20. Sep. 2025	(16.935)
Erhält Festzinssatz 3,62 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6.725.000	USD	21. Jun. 2025	(20.568)
Erhält Festzinssatz 6,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	64.904.000	INR	21. Jun. 2028	(2.488)
Zahlt Festzinssatz 3,97 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	5.176.000	USD	20. Sep. 2024	4.884
Erhält Festzinssatz 3,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	7.166.000	USD	20. Sep. 2033	50.723
Erhält Festzinssatz 0,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	52.054.000	JPY	20. Sep. 2033	262
Erhält Festzinssatz 12,30 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	HSBC	10.584.726	BRL	02. Jan. 2025	9.546
Zahlt Festzinssatz 1,36 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	13.095.000	ILS	19. Jun. 2027	191.445
Erhält Festzinssatz 2,89 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	22.406.000	CZK	16. Jun. 2032	(41.776)
Erhält Festzinssatz 2,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.311.000	NZD	16. Mrz. 2032	(39.523)
Zahlt Festzinssatz 4,16 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.720.000	PLN	18. Sep. 2027	24.581
Erhält Festzinssatz 2,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	9.385.000	ILS	15. Sep. 2032	(153.934)
Zahlt Festzinssatz 8,33 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	10.028.000	MXN	09. Jun. 2032	(5.511)
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18.257.000	MXN	09. Jun. 2032	(9.637)
Zahlt Festzinssatz 8,33 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27.621.000	MXN	09. Jun. 2032	(15.269)
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27.469.000	MXN	09. Jun. 2032	(14.665)
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18.353.000	MXN	09. Jun. 2032	(9.741)
Zahlt Festzinssatz 8,28 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27.374.000	MXN	09. Jun. 2032	(12.988)
Zahlt Festzinssatz 8,23 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	36.569.000	MXN	09. Jun. 2032	(14.301)
Zahlt Festzinssatz 8,29 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27.417.000	MXN	09. Jun. 2032	(13.120)
Zahlt Festzinssatz 8,28 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,28 %	Morgan Stanley	18.270.000	MXN	09. Jun. 2032	(8.674)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,25 %	Morgan Stanley	27.475.000	MXN	09. Jun. 2032	(12.700)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,20 %	Morgan Stanley	18.286.000	MXN	09. Jun. 2032	(7.706)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,32 %	Morgan Stanley	18.286.000	MXN	09. Jun. 2032	(6.119)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,32 %	Morgan Stanley	19.666.000	MXN	08. Sep. 2032	(8.859)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,45 %	Morgan Stanley	19.708.000	MXN	08. Sep. 2032	(8.878)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,47 %	Morgan Stanley	29.921.000	MXN	08. Sep. 2032	(19.561)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,11 %	Morgan Stanley	29.778.000	MXN	08. Sep. 2032	(20.564)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,79 %	Morgan Stanley	60.639.000	MXN	08. Sep. 2032	(7.322)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 9,61 %	Morgan Stanley	195.604.000	MXN	18. Sep. 2024	141.262
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 3,62 %	Morgan Stanley	3.555.000	ZAR	15. Sep. 2032	4.008
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 9,76 %	Morgan Stanley	43.933.000	CZK	15. Sep. 2032	(24.138)
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,65 %	Morgan Stanley	8.530.000	ZAR	15. Sep. 2032	7.720
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,52 %	Morgan Stanley	62.816.000	MXN	09. Jun. 2032	(67.016)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,52 %	Morgan Stanley	35.149.500	MXN	08. Sep. 2032	(27.165)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 9,97 %	Morgan Stanley	46.924.500	MXN	08. Sep. 2032	(35.785)
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,58 %	Morgan Stanley	41.861.000	ZAR	15. Sep. 2032	24.410
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,82 %	Morgan Stanley	45.850.500	MXN	08. Sep. 2032	(39.406)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 3,05 %	Morgan Stanley	29.081.000	MXN	08. Sep. 2032	(36.528)
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 5,78 %	Morgan Stanley	9.821.000	ILS	15. Sep. 2032	(68.568)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 5,84 %	Morgan Stanley	2.159.043.000	CLP	15. Dez. 2032	119.144
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 2,38 %	Morgan Stanley	2.338.964.000	CLP	15. Dez. 2032	134.682
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 2,91 %	Morgan Stanley	4.117.000	EUR	15. Dez. 2032	(45.562)
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 3,22 %	Morgan Stanley	160.101.000	SEK	18. Dez. 2027	178.487

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	272.504.000	NOK	18. Dez. 2027	(315.540)
Erhält Festzinssatz 9,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	77.665.000	MXN	17. Sep. 2025	7.532
Zahlt Festzinssatz 10,27 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	42.554.000	ZAR	15. Sep. 2032	4.883
Erhält Festzinssatz 9,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	28.500.000	MXN	25. Jun. 2025	(13.659)
Erhält Festzinssatz 6,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.423.000	PLN	15. Dez. 2032	75.789
Zahlt Festzinssatz 8,76 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	155.183.000	MXN	08. Dez. 2032	(165.263)
Zahlt Festzinssatz 8,55 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	16.045.000	MXN	21. Jul. 2027	4.474
Zahlt Festzinssatz 8,16 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	59.280.000	MXN	06. Aug. 2027	61.418
Erhält Festzinssatz 8,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	16.125.000	MXN	08. Aug. 2025	(21.286)
Erhält Festzinssatz 8,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	103.955.000	MXN	08. Aug. 2025	(143.290)
Zahlt Festzinssatz 10,42 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	12.224.000	ZAR	15. Dez. 2032	372
Zahlt Festzinssatz 3,18 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	23.830.000	ILS	20. Dez. 2024	53.397
Zahlt Festzinssatz 3,18 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	22.315.000	ILS	20. Dez. 2024	50.003
Zahlt Festzinssatz 8,17 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	95.281.000	ZAR	20. Dez. 2024	(20.094)
Zahlt Festzinssatz 10,63 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	44.722.000	ZAR	15. Dez. 2032	(12.815)
Zahlt Festzinssatz 4,36 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	25.208.000	CZK	19. Mrz. 2028	(9.859)
Zahlt Festzinssatz 3,96 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Bank of America	6.565.000	MYR	19. Mrz. 2028	(8.819)
Erhält Festzinssatz 3,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	17.861.000	ILS	15. Mrz. 2033	(80.907)
Erhält Festzinssatz 3,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.141.138.000	KRW	19. Mrz. 2028	9.660
Zahlt Festzinssatz 3,26 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.489.107.000	KRW	15. Mrz. 2033	(9.519)
Erhält Festzinssatz 3,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	6.804.000	CAD	20. Mrz. 2025	111.661
Erhält Festzinssatz 3,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.926.000	NZD	20. Mrz. 2025	(29.341)
Zahlt Festzinssatz 4,16 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5.086.000	NZD	15. Mrz. 2033	(5.347)
Zahlt Festzinssatz 9,17 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	96.402.000	MXN	17. Sep. 2027	(102.283)
Zahlt Festzinssatz 3,64 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.004.580.000	KRW	15. Mrz. 2033	(18.023)
Erhält Festzinssatz 6,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10.775.000	PLN	15. Mrz. 2033	125.536
Zahlt Festzinssatz 4,34 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4.640.000	NZD	15. Mrz. 2033	(29.862)
Zahlt Festzinssatz 10,93 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	50.672.000	ZAR	15. Mrz. 2033	(30.624)
Zahlt Festzinssatz 10,91 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	24.365.000	ZAR	15. Mrz. 2033	(13.748)
Zahlt Festzinssatz 3,69 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	631.437.000	KRW	15. Mrz. 2033	(12.249)
Erhält Festzinssatz 2,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	15.732.000	CNY	19. Mrz. 2028	(19.961)
Zahlt Festzinssatz 3,68 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.465.000	ILS	19. Mrz. 2028	(9.834)
Zahlt Festzinssatz 3,92 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2.432.274.000	KRW	15. Mrz. 2033	(64.184)
Zahlt Festzinssatz 10,96 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	47.018.000	ZAR	15. Mrz. 2033	(30.096)
Zahlt Festzinssatz 10,94 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13.838.000	ZAR	15. Mrz. 2033	(8.595)
Zahlt Festzinssatz 11,09 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13.963.000	ZAR	15. Mrz. 2033	(11.645)
Erhält Festzinssatz 4,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	560.542.000	CLP	19. Mrz. 2028	2.842
Erhält Festzinssatz 4,43 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.163.627.000	CLP	19. Mrz. 2028	11.138
Erhält Festzinssatz 8,99 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	43.689.000	MXN	09. Mrz. 2033	58.189
Erhält Festzinssatz 8,86 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29.526.000	MXN	09. Mrz. 2033	33.119
Erhält Festzinssatz 8,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	14.673.000	MXN	09. Mrz. 2033	17.084
Erhält Festzinssatz 8,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29.400.000	MXN	09. Mrz. 2033	33.855
Erhält Festzinssatz 8,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29.434.000	MXN	09. Mrz. 2033	33.464
Erhält Festzinssatz 6,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14.044.000	PLN	15. Mrz. 2033	95.392
Erhält Festzinssatz 5,86 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.958.000	PLN	15. Mrz. 2033	10.863
Erhält Festzinssatz 4,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	16.203.000	CAD	21. Jun. 2024	(16.242)
Zahlt Festzinssatz 3,94 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	7.728.000	CAD	21. Jun. 2025	3.185
Zahlt Festzinssatz 3,34 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	23.986.000	CAD	21. Jun. 2028	(77.730)
Erhält Festzinssatz 3,41 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	6.769.000	CAD	21. Jun. 2033	55.262
Erhält Festzinssatz 3,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	12.431.000	CAD	21. Jun. 2033	20.953
Erhält Festzinssatz 4,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	13.801.000	CZK	21. Jun. 2025	(9.897)
Erhält Festzinssatz 3,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	37.329.000	ILS	21. Jun. 2028	(228.427)
Erhält Festzinssatz 8,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	611.701.000	MXN	18. Jun. 2025	(562.674)
Zahlt Festzinssatz 8,09 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	15.159.000	MXN	14. Jun. 2028	9.123
Zahlt Festzinssatz 5,57 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	49.004.000	PLN	21. Jun. 2033	(141.191)
Erhält Festzinssatz 6,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	59.023.000	PLN	21. Jun. 2024	825
Zahlt Festzinssatz 5,16 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	75.043.000	PLN	19. Jun. 2025	10.669
Erhält Festzinssatz 5,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	57.366.000	PLN	21. Jun. 2028	45.195
Erhält Festzinssatz 9,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	170.257.000	ZAR	21. Jun. 2033	147.300
Erhält Festzinssatz 9,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	114.432.000	ZAR	21. Jun. 2033	106.154
Zahlt Festzinssatz 7,95 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	101.449.000	ZAR	21. Jun. 2025	(9.622)
Zahlt Festzinssatz 8,56 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	90.475.000	ZAR	21. Jun. 2028	(73.801)
Zahlt Festzinssatz 8,56 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	186.206.000	ZAR	21. Jun. 2028	(151.049)
Erhält Festzinssatz 2,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	52.228.000	CNY	21. Jun. 2025	15.900
Zahlt Festzinssatz 10,13 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6.059.356.000	COP	21. Jun. 2025	(13.850)
Zahlt Festzinssatz 8,80 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.305.356.000	COP	18. Jun. 2028	(16.702)
Erhält Festzinssatz 6,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	66.811.000	PLN	21. Jun. 2025	7.188
Zahlt Festzinssatz 7,94 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	163.036.000	MXN	19. Mrz. 2025	56.315
Zahlt Festzinssatz 7,86 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	84.467.000	MXN	19. Mrz. 2025	32.395
Zahlt Festzinssatz 7,83 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	88.913.000	MXN	19. Mrz. 2025	35.341
Zahlt Festzinssatz 8,39 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	46.958.000	MXN	09. Mrz. 2033	(18.863)
Zahlt Festzinssatz 8,50 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	162.505.000	MXN	30. Nov. 2027	38.487
Zahlt Festzinssatz 4,22 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,41 %	Morgan Stanley	4.997.432	NZD	21. Jun. 2028	21.102
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 4,67 %	Morgan Stanley	39.113.000	MXN	09. Mrz. 2033	(16.780)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 4,67 %	Morgan Stanley	2.322.717.000	CLP	21. Jun. 2033	6.872
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 2,53 %	Morgan Stanley	376.657.000	CLP	21. Jun. 2033	1.034
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 2,56 %	Morgan Stanley	2.471.000	EUR	21. Jun. 2033	68.096
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 6,31 %	Morgan Stanley	7.170.000	EUR	21. Jun. 2028	(150.099)
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day Erhält Festzinssatz 3,68 %	Morgan Stanley	394.768.000	INR	21. Jun. 2028	4.212
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 2,66 %	Goldman Sachs	13.799.000	MYR	21. Jun. 2028	(1.593)
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 2,90 %	Morgan Stanley	245.239.000	SEK	21. Jun. 2028	(300.825)
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months Erhält Festzinssatz 3,00 %	Morgan Stanley	612.806.000	KRW	15. Mrz. 2033	2.824
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Zahlt Festzinssatz 10,54 %	Morgan Stanley	17.563.000	CNY	18. Jun. 2028	(7.330)
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 11,23 %	Morgan Stanley	21.600.000	ZAR	21. Jun. 2033	1.869
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 11,12 %	Morgan Stanley	7.938.312.000	COP	21. Jun. 2025	(51.261)
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 10,07 %	Morgan Stanley	10.699.338.000	COP	21. Jun. 2025	(64.749)
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 9,88 %	Morgan Stanley	970.317.000	COP	21. Jun. 2033	(21.259)
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 9,89 %	Morgan Stanley	946.758.000	COP	21. Jun. 2033	(18.215)
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Erhält Festzinssatz 7,39 %	Morgan Stanley	2.840.273.000	COP	21. Jun. 2033	(55.046)
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 4,78 %	Morgan Stanley	73.869.000	ZAR	21. Jun. 2024	(26.135)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 4,75 %	Morgan Stanley	373.929.000	CLP	21. Jun. 2028	(9.044)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 4,76 %	Morgan Stanley	1.246.757.000	CLP	21. Jun. 2028	(31.810)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 8,64 %	Morgan Stanley	890.541.000	CLP	21. Jun. 2028	(22.343)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 4,56 %	Morgan Stanley	47.868.000	MXN	18. Jun. 2025	(44.031)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 10,16 %	Morgan Stanley	356.244.000	CLP	21. Jun. 2028	(12.722)
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Erhält Festzinssatz 4,53 %	Morgan Stanley	3.005.662.000	COP	21. Jun. 2028	(41.369)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	361.533.000	CLP	21. Jun. 2028	(13.544)
Erhält Festzinssatz 5,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	203.000	PLN	21. Jun. 2028	(796)
Zahlt Festzinssatz 3,89 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.094.000	CZK	21. Jun. 2033	21.746
Zahlt Festzinssatz 3,87 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.050.000	CZK	21. Jun. 2033	11.451
Zahlt Festzinssatz 3,15 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.594.000	ILS	21. Jun. 2033	20.138
Zahlt Festzinssatz 9,24 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	992.668.000	COP	21. Jun. 2033	(10.171)
Zahlt Festzinssatz 4,96 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.998.000	PLN	21. Jun. 2033	15.048
Zahlt Festzinssatz 5,00 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.960.000	PLN	21. Jun. 2033	13.202
Erhält Festzinssatz 6,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	26.026.000	INR	21. Jun. 2028	(2.352)
Erhält Festzinssatz 6,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	33.125.000	INR	21. Jun. 2028	(2.993)
Zahlt Festzinssatz 3,07 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	4.390.000	ILS	21. Jun. 2033	63.388
Zahlt Festzinssatz 2,94 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2.053.260.000	KRW	21. Jun. 2033	6.500
Erhält Festzinssatz 4,29 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.245.000	NZD	15. Mrz. 2028	(7.803)
Erhält Festzinssatz 4,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.245.000	NZD	15. Mrz. 2028	(6.103)
Zahlt Festzinssatz 5,28 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.105.000	PLN	21. Jun. 2033	8.329
Zahlt Festzinssatz 5,30 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.170.000	PLN	21. Jun. 2033	3.668
Zahlt Festzinssatz 5,30 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.190.000	PLN	21. Jun. 2033	3.702
Zahlt Festzinssatz 10,39 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	184.897.000	MXN	19. Jun. 2024	53.025
Zahlt Festzinssatz 5,32 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.320.000	PLN	21. Jun. 2033	3.136
Erhält Festzinssatz 4,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.350.000	NZD	15. Mrz. 2028	(10.206)
Erhält Festzinssatz 4,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.245.000	NZD	15. Mrz. 2028	(12.594)
Erhält Festzinssatz 4,07 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.245.000	NZD	15. Mrz. 2028	(21.866)
Erhält Festzinssatz 3,98 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	348.000	NZD	21. Jun. 2033	(5.027)
Erhält Festzinssatz 4,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	350.000	NZD	21. Jun. 2033	(4.397)
Erhält Festzinssatz 4,22 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.245.000	NZD	15. Mrz. 2028	(12.594)
Zahlt Festzinssatz 7,99 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10.100.000	ZAR	21. Jun. 2028	4.682
Zahlt Festzinssatz 7,98 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	12.626.000	ZAR	21. Jun. 2028	6.138
Erhält Festzinssatz 4,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.240.000	NZD	15. Mrz. 2028	(10.253)
Erhält Festzinssatz 4,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.245.000	NZD	15. Mrz. 2028	(10.276)
Zahlt Festzinssatz 6,33 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	333.021.000	INR	21. Jun. 2025	(1.950)
Erhält Festzinssatz 4,52 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.150.000	NZD	15. Mrz. 2028	3.127
Zahlt Festzinssatz 6,74 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.314.453.000	CLP	21. Jun. 2025	(501)
Zahlt Festzinssatz 6,78 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.263.223.000	CLP	21. Jun. 2025	(1.630)
Zahlt Festzinssatz 7,67 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	146.284.000	HUF	21. Jun. 2033	10.078
Zahlt Festzinssatz 6,46 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	108.873.000	INR	21. Jun. 2025	(3.807)
Erhält Festzinssatz 9,18 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	4.969.000	ZAR	21. Jun. 2033	1.093
Erhält Festzinssatz 9,18 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	11.183.000	ZAR	21. Jun. 2033	2.317
Zahlt Festzinssatz 7,64 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	80.362.000	ZAR	21. Jun. 2025	17.832
Erhält Festzinssatz 9,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20.823.964	ZAR	21. Jun. 2033	2.859
Erhält Festzinssatz 9,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16.438.056	ZAR	21. Jun. 2033	8.904
Zahlt Festzinssatz 8,48 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16.368.031	ZAR	21. Jun. 2028	(10.545)
Zahlt Festzinssatz 8,18 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32.533.692	ZAR	21. Jun. 2028	1.428
Zahlt Festzinssatz 8,30 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	27.111.787	ZAR	21. Jun. 2028	(6.395)
Zahlt Festzinssatz 8,30 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	27.247.954	ZAR	21. Jun. 2028	(6.273)
Erhält Festzinssatz 9,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16.933.206	ZAR	21. Jun. 2033	7.927
Zahlt Festzinssatz 8,35 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32.909.840	ZAR	21. Jun. 2028	(11.104)
Erhält Festzinssatz 9,30 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20.663.996	ZAR	21. Jun. 2033	13.092
Zahlt Festzinssatz 8,36 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	22.914.644	ZAR	21. Jun. 2028	(8.507)
Erhält Festzinssatz 9,31 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	15.196.204	ZAR	21. Jun. 2033	10.187
Zahlt Festzinssatz 6,49 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	216.346.000	INR	18. Jun. 2028	(7.038)
Zahlt Festzinssatz 4,08 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.681.222	ILS	21. Jun. 2033	(13.939)
Zahlt Festzinssatz 3,71 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.637.452	ILS	21. Jun. 2033	25
Zahlt Festzinssatz 3,66 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	849.038	ILS	21. Jun. 2033	971
Zahlt Festzinssatz 9,10 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.682.023.000	HUF	20. Jun. 2025	(7.331)
Zahlt Festzinssatz 9,10 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.390.440.000	HUF	19. Jun. 2025	(9.932)
Zahlt Festzinssatz 11,85 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.579.575.000	HUF	21. Jun. 2025	(28.439)
Zahlt Festzinssatz 12,00 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.026.809.000	HUF	21. Jun. 2025	(36.946)
Zahlt Festzinssatz 3,89 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.125.000	ILS	21. Jun. 2033	(4.427)
Zahlt Festzinssatz 8,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	31.091.000	MXN	15. Jun. 2033	(13.175)
Zahlt Festzinssatz 8,47 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	24.215.000	MXN	15. Jun. 2033	(11.020)
Zahlt Festzinssatz 8,48 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	27.280.052	ZAR	21. Jun. 2028	(17.513)
Erhält Festzinssatz 9,42 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16.995.724	ZAR	21. Jun. 2033	18.765
Erhält Festzinssatz 9,42 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10.030.000	ZAR	21. Jun. 2033	10.964
Zahlt Festzinssatz 4,79 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	3.644.000	NZD	21. Jun. 2028	(42.698)
Zahlt Festzinssatz 4,68 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.429.000	NZD	21. Jun. 2028	(20.945)
Zahlt Festzinssatz 3,26 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	442.479.000	KRW	21. Jun. 2033	(2.815)
Zahlt Festzinssatz 3,23 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	884.281.000	KRW	21. Jun. 2033	(4.825)
Zahlt Festzinssatz 9,08 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	52.035.000	MXN	18. Feb. 2030	(99.050)
Erhält Festzinssatz 10,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	153.145.000	MXN	24. Feb. 2025	98.245
Zahlt Festzinssatz 3,61 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	12.231.000	MYR	21. Jun. 2025	(1.335)
Erhält Festzinssatz 5,85 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.030.000	PLN	21. Jun. 2033	45.859
Zahlt Festzinssatz 7,72 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	139.176.000	HUF	21. Jun. 2033	8.169
Zahlt Festzinssatz 3,03 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Erhält Festzinssatz 9,57 %	Morgan Stanley	41.160.000	CNY	21. Jun. 2028	(40.208)
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Erhält Festzinssatz 6,12 %	Morgan Stanley	29.081.325.000	COP	21. Jun. 2028	254.791
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 5,22 %	Morgan Stanley	391.745.000	CZK	21. Jun. 2025	119.971
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 5,00 %	Morgan Stanley	338.340.000	CZK	21. Jun. 2028	(339.234)
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 4,85 %	Morgan Stanley	52.870.000	CZK	21. Jun. 2030	72.289
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 3,44 %	Morgan Stanley	96.920.000	CZK	21. Jun. 2033	177.614
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 10,88 %	Morgan Stanley	9.470.000	EUR	21. Jun. 2028	(115.871)
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 8,90 %	Morgan Stanley	6.871.445.000	HUF	21. Jun. 2025	(292.805)
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 8,22 %	Morgan Stanley	5.956.405.000	HUF	21. Jun. 2028	104.728
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 4,23 %	Morgan Stanley	1.862.505.000	HUF	21. Jun. 2033	23.056
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 6,49 %	Morgan Stanley	10.925.000	ILS	21. Jun. 2033	(127.694)
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 5,92 %	Morgan Stanley	109.955.000	PLN	21. Jun. 2025	171.713
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 5,93 %	Morgan Stanley	94.010.000	PLN	21. Jun. 2028	(464.528)
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 7,91 %	Morgan Stanley	26.490.000	PLN	21. Jun. 2033	237.789
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,43 %	Morgan Stanley	95.170.000	ZAR	21. Jun. 2025	5.650
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 9,36 %	Morgan Stanley	236.340.000	ZAR	21. Jun. 2028	(122.665)
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 10,82 %	Morgan Stanley	138.965.000	ZAR	21. Jun. 2033	123.293
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 4,72 %	Morgan Stanley	30.515.000	ZAR	21. Jun. 2033	9.608
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 3,63 %	Morgan Stanley	14.780.000	USD	21. Jun. 2025	148.892
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 6,68 %	Morgan Stanley	4.450.000	USD	21. Jun. 2033	140.238
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day Zahlt Festzinssatz 2,52 %	Morgan Stanley	283.795.000	INR	21. Jun. 2028	56.179
Erhält variablen Zinssatz THB THOR 1 Day Zahlt Festzinssatz 9,33 %	Morgan Stanley	108.405.000	THB	21. Jun. 2028	(41.711)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 10,84 %	Morgan Stanley	65.960.000	MXN	24. Feb. 2028	(110.940)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 9,01 %	Morgan Stanley	74.575.000	MXN	27. Feb. 2025	52.061

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19.725.000	MXN	17. Feb. 2033	46.458
Zahlt Festzinssatz 3,72 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	15.860.000	MYR	21. Jun. 2025	(9.510)
Zahlt Festzinssatz 8,59 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	21.490.000	ZAR	20. Sep. 2028	(15.622)
Erhält Festzinssatz 3,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.130.000	EUR	21. Jun. 2025	39.678
Erhält Festzinssatz 3,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.020.000	EUR	21. Jun. 2033	33.051
Zahlt Festzinssatz 5,60 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	912.457.000	CLP	22. Jun. 2033	(56.462)
Zahlt Festzinssatz 7,83 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	84.094.000	ZAR	20. Jun. 2025	(8.076)
Zahlt Festzinssatz 3,23 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.288.644.000	KRW	21. Jun. 2033	(7.109)
Zahlt Festzinssatz 5,91 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	7.513.600.000	CLP	22. Jun. 2028	(270.956)
Erhält Festzinssatz 6,55 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	5.227.920.000	CLP	22. Jun. 2026	112.974
Erhält Festzinssatz 7,96 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	142.555.000	ZAR	21. Jun. 2025	15.327
Erhält Festzinssatz 9,43 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	176.377.000	ZAR	20. Sep. 2033	151.086
Erhält Festzinssatz 9,61 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	74.516.000	ZAR	20. Sep. 2033	113.666
Zahlt Festzinssatz 7,93 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	114.985.000	ZAR	20. Sep. 2025	(15.568)
Zahlt Festzinssatz 8,50 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	92.712.000	ZAR	20. Sep. 2028	(48.235)
Zahlt Festzinssatz 4,03 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	7.736.000	ILS	20. Sep. 2033	(60.441)
Zahlt Festzinssatz 4,88 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	49.196.000	ILS	20. Sep. 2024	(61.542)
Erhält Festzinssatz 4,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.133.000	ILS	20. Sep. 2028	17.514
Erhält Festzinssatz 3,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.017.673.000	KRW	20. Sep. 2033	22.595
Zahlt Festzinssatz 5,64 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.377.000	PLN	20. Sep. 2033	(11.479)
Erhält Festzinssatz 5,99 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	99.871.000	PLN	20. Sep. 2025	70.116
Zahlt Festzinssatz 7,69 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	794.604.000	HUF	20. Sep. 2033	5.445
Erhält Festzinssatz 8,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	749.207.000	HUF	20. Sep. 2028	(18.420)
Erhält Festzinssatz 4,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	38.842.000	CZK	20. Sep. 2028	26.060
Zahlt Festzinssatz 9,45 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	4.288.795.000	COP	20. Sep. 2028	(41.564)
Erhält Festzinssatz 8,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	10.706.700.000	COP	20. Sep. 2033	26.621
Erhält Festzinssatz 9,99 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	127.571.000	MXN	17. Sep. 2025	114.445
Zahlt Festzinssatz 8,95 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	684.213.000	MXN	13. Sep. 2028	(1.201.529)
Erhält Festzinssatz 8,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	316.555.000	MXN	07. Sep. 2033	748.634
Erhält Festzinssatz 3,89 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	8.124.000	MYR	20. Sep. 2028	15.065
Zahlt Festzinssatz 6,35 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.498.386.000	CLP	20. Sep. 2025	(14.380)
Zahlt Festzinssatz 6,49 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.624.760.000	CLP	20. Sep. 2025	(33.124)
Zahlt Festzinssatz 6,54 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	6.674.904.000	CLP	20. Sep. 2025	(91.720)
Erhält Festzinssatz 4,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.495.436.000	CLP	20. Sep. 2033	2.971
Erhält Festzinssatz 12,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	20.269.742.000	COP	21. Jun. 2024	34.707
Erhält Festzinssatz 2,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	54.218.000	CNY	20. Sep. 2025	18.872
Erhält Festzinssatz 3,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	20.479.000	CNY	17. Sep. 2028	96
Erhält Festzinssatz 3,23 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	35.577.000	CNY	17. Sep. 2028	13.176
Zahlt Festzinssatz 3,03 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	19.988.000	CNY	20. Sep. 2028	(13.551)
Zahlt Festzinssatz 6,65 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	349.453.000	INR	20. Sep. 2025	(34.171)
Zahlt Festzinssatz 6,68 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	766.308.000	INR	17. Sep. 2028	(73.002)
Erhält Festzinssatz 6,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	254.864.000	INR	20. Sep. 2028	48.091
Zahlt Festzinssatz 5,27 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.243.979.000	CLP	20. Jun. 2025	(5.243)
Erhält Festzinssatz 5,46 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3.829.008.000	CLP	20. Sep. 2028	114.995
Zahlt Festzinssatz 3,16 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	18.261.000	NOK	20. Sep. 2033	(15.923)
Erhält Festzinssatz 3,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	321.765.000	NOK	20. Sep. 2028	435.232
Zahlt Festzinssatz 3,69 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.993.000	AUD	18. Sep. 2025	(25.233)
Zahlt Festzinssatz 3,94 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	58.566.000	AUD	20. Sep. 2025	(381.704)
Zahlt Festzinssatz 3,88 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months Zahlt Festzinssatz 4,06 %	Morgan Stanley	16.675.000	AUD	17. Sep. 2028	(101.765)
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months Zahlt Festzinssatz 4,59 %	Morgan Stanley	23.278.000	AUD	20. Sep. 2028	(331.221)
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months Zahlt Festzinssatz 4,41 %	Morgan Stanley	21.575.000	AUD	20. Sep. 2033	(121.230)
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 4,31 %	Morgan Stanley	4.402.000	EUR	20. Sep. 2024	(25.856)
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months Zahlt Festzinssatz 4,42 %	Morgan Stanley	36.572.000	AUD	20. Sep. 2033	657.553
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 3,78 %	Morgan Stanley	38.433.000	ILS	20. Sep. 2025	(96.691)
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 5,59 %	Morgan Stanley	13.923.000	EUR	20. Sep. 2025	(100.559)
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 4,45 %	Morgan Stanley	456.346.000	CZK	20. Sep. 2025	88.760
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 8,30 %	Morgan Stanley	83.965.000	CZK	20. Sep. 2033	(56.517)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,29 %	Morgan Stanley	25.169.000	MXN	15. Jun. 2033	4.694
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,29 %	Morgan Stanley	33.866.000	MXN	15. Jun. 2033	5.918
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,33 %	Morgan Stanley	34.268.000	MXN	15. Jun. 2033	5.875
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,50 %	Morgan Stanley	41.378.000	MXN	15. Jun. 2033	9.724
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,36 %	Morgan Stanley	11.511.000	MXN	08. Jun. 2033	9.334
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,38 %	Morgan Stanley	14.364.000	MXN	08. Jun. 2033	4.196
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,33 %	Morgan Stanley	14.220.000	MXN	08. Jun. 2033	5.207
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 5,44 %	Morgan Stanley	24.950.000	MXN	15. Jun. 2033	5.781
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 5,44 %	Morgan Stanley	1.664.000	PLN	21. Jun. 2028	527
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 5,44 %	Morgan Stanley	1.669.000	PLN	21. Jun. 2028	529
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 9,23 %	Morgan Stanley	835.000	PLN	21. Jun. 2028	264
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 9,23 %	Morgan Stanley	16.700.000	ZAR	21. Jun. 2033	6.345
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 9,23 %	Morgan Stanley	13.889.000	ZAR	21. Jun. 2033	5.609
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 3,03 %	Morgan Stanley	14.281.000	ZAR	21. Jun. 2033	5.373
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months Zahlt Festzinssatz 3,78 %	Morgan Stanley	906.764.000	KRW	21. Jun. 2033	520

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	6.325.000	MYR	18. Jun. 2028	(382)
Erhält Festzinssatz 3,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	15.180.000	AUD	20. Sep. 2026	5.417
Erhält Festzinssatz 4,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	3.100.000	NZD	21. Jun. 2028	2.406
Zahlt Festzinssatz 3,13 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.919.879.000	KRW	21. Jun. 2033	(5.107)
Zahlt Festzinssatz 3,14 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.266.673.000	KRW	21. Jun. 2033	(3.782)
Erhält Festzinssatz 3,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.603.459.000	KRW	21. Jun. 2028	3.725
Erhält Festzinssatz 3,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	8.745.497.000	KRW	21. Jun. 2025	9.432
Zahlt Festzinssatz 3,03 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.053.077.000	KRW	21. Jun. 2033	4.411
Erhält Festzinssatz 8,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	9.271.000	MXN	08. Jun. 2033	5.872
Erhält Festzinssatz 8,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	25.936.000	MXN	08. Jun. 2033	21.186
Erhält Festzinssatz 8,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	13.149.000	MXN	08. Jun. 2033	13.586
Erhält Festzinssatz 8,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	16.483.000	MXN	08. Jun. 2033	10.440
Erhält Festzinssatz 7,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	68.948.000	ZAR	21. Jun. 2024	(14.756)
Erhält Festzinssatz 9,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	62.486.000	ZAR	21. Jun. 2033	8.580
Erhält Festzinssatz 4,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	47.133.000	CZK	21. Jun. 2028	(30.654)
Erhält Festzinssatz 5,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	15.805.000	PLN	21. Jun. 2028	(39.973)
Zahlt Festzinssatz 4,07 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	415.000	NZD	21. Jun. 2033	816
Erhält Festzinssatz 6,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	139.198.000	INR	21. Jun. 2028	(1.273)
Zahlt Festzinssatz 4,06 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	410.000	NZD	21. Jun. 2033	867
Zahlt Festzinssatz 4,13 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	615.000	NZD	21. Jun. 2033	392
Erhält Festzinssatz 4,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	37.970.000	ILS	21. Jun. 2025	23.797
Erhält Festzinssatz 6,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	336.754.000	HUF	21. Jun. 2033	3.691
Zahlt Festzinssatz 10,61 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	65.897.000	ZAR	21. Jun. 2033	(1.502)
Erhält Festzinssatz 8,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	16.464.000	MXN	08. Jun. 2033	5.565
Erhält Festzinssatz 8,51 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	14.635.000	MXN	08. Jun. 2033	12.345
Erhält Festzinssatz 8,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27.440.000	MXN	08. Jun. 2033	11.574
Erhält Festzinssatz 6,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	243.524.000	HUF	21. Jun. 2033	(2.038)
Erhält Festzinssatz 8,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	5.223.000	MXN	15. Jun. 2033	1.792
Erhält Festzinssatz 8,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	8.383.000	MXN	15. Jun. 2033	2.687
Erhält Festzinssatz 8,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	6.511.000	MXN	08. Jun. 2033	1.436
Erhält Festzinssatz 8,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	6.511.000	MXN	08. Jun. 2033	1.190
Erhält Festzinssatz 5,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.095.000	PLN	21. Jun. 2033	(28.760)
Zahlt Festzinssatz 10,82 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32.368.000	ZAR	21. Jun. 2033	(10.366)
Zahlt Festzinssatz 10,77 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	54.142.000	ZAR	21. Jun. 2033	(13.380)
Zahlt Festzinssatz 9,18 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	11.964.000	ZAR	21. Jun. 2033	(2.390)
Zahlt Festzinssatz 9,17 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	29.846.000	ZAR	21. Jun. 2033	(4.647)
Zahlt Festzinssatz 9,12 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	15.519.000	ZAR	21. Jun. 2033	8
Erhält Festzinssatz 3,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	641.905.000	KRW	21. Jun. 2033	(3.066)
Erhält Festzinssatz 4,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5.662.000	NZD	20. Sep. 2033	(25.621)
Erhält Festzinssatz 4,17 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	675.000	NZD	20. Sep. 2033	(2.075)
Zahlt Festzinssatz 4,97 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	6.012.000	NZD	20. Sep. 2024	5.445
Erhält Festzinssatz 4,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.670.000	NZD	20. Sep. 2025	(13.613)
Zahlt Festzinssatz 2,78 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	85.086.000	SEK	20. Sep. 2033	(7.010)
Zahlt Festzinssatz 3,22 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	114.378.000	SEK	20. Sep. 2025	4.809
Erhält Festzinssatz 3,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7.012.000	NOK	20. Sep. 2033	3.725
Zahlt Festzinssatz 3,25 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	345.354.000	NOK	20. Sep. 2025	3.422
Erhält Festzinssatz 8,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	5.197.560.000	COP	20. Sep. 2028	2.693
Erhält Festzinssatz 8,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6.367.246.000	COP	20. Sep. 2028	3.431
Erhält Festzinssatz 2,72 %					

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swap-Kontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 3,01 %	Morgan Stanley	22.941.000	SEK	20. Sep. 2033	1.998
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months Erhält Festzinssatz 3,00 %	Morgan Stanley	994.271.000	KRW	20. Sep. 2033	(4.268)
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months Erhält Festzinssatz 3,01 %	Morgan Stanley	849.179.000	KRW	20. Sep. 2033	(4.057)
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months Erhält Festzinssatz 3,82 %	Morgan Stanley	853.594.000	KRW	20. Sep. 2033	(3.664)
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months Erhält Festzinssatz 3,81 %	Morgan Stanley	4.885.000	NZD	18. Jun. 2028	(10.127)
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months Zahlt Festzinssatz 2,87 %	Morgan Stanley	4.885.000	NZD	18. Jun. 2028	(11.096)
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Zahlt Festzinssatz 2,90 %	Morgan Stanley	5.711.000	CNY	20. Sep. 2028	2.150
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Zahlt Festzinssatz 4,82 %	Morgan Stanley	7.420.000	CNY	20. Sep. 2028	1.617
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 9,18 %	Morgan Stanley	261.118.000	CLP	20. Sep. 2033	(1.062)
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	18.030.000	ZAR	21. Jun. 2033	3.470
				USD	(1.931.885)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

Zum 31. März 2023 gestaltete sich die Exponierung bei in Bezug auf Derivatkontrakte zu erhaltenden Sicherheiten je Kontrahent wie folgt:

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA BlueTrend				
	HSBC	Barmittel	USD	2.810.000
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	1.394.973
	J.P. Morgan	Barmittel	MXN	131.065
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	20.869.049
	Merrill Lynch	Barmittel	EUR	1.460
			USD	25.200.754
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
	HSBC	Barmittel	USD	550.000
			USD	550.000
Schroder GAIA Egerton Equity				
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	3
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	11
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	18
			EUR	15
Schroder GAIA Helix				
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	2.854.448
	Goldman Sachs	Barmittel	GBP	4.810.245
	Goldman Sachs	Barmittel	HKD	413.044
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	1.235.925
	HSBC	Barmittel	USD	1.550.000
	J.P. Morgan	Barmittel	AUD	564
	J.P. Morgan	Barmittel	CAD	13.104
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	7.093.991
	J.P. Morgan	Barmittel	GBP	186.908

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
	J.P. Morgan	Barmittel	HKD	2.627.129
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	292.551.735
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	10.557.577
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	360.000
			USD	33.257.798
Schroder GAIA Oaktree Credit				
	HSBC	Barmittel	USD	110.000
	UBS	Barmittel	USD	10.552
			USD	120.552
Schroder GAIA Sirios US Equity				
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	2.380.000
	HSBC	Barmittel	USD	320.000
	Merrill Lynch	Barmittel	USD	2.280.000
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	80.000
			USD	5.060.000
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *				
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	543.615
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	10
			GBP	543.623
Schroder GAIA Two Sigma Diversified				
	Citi Bank	Barmittel	EUR	2.696.935
	HSBC	Barmittel	USD	1.970.000
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	9.933.654
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	319.000
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	310.597
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	202.483
	Societe Generale	Barmittel	AUD	443.200
	Societe Generale	Barmittel	CAD	53
	Societe Generale	Barmittel	CHF	15
	Societe Generale	Barmittel	CZK	2
	Societe Generale	Barmittel	EUR	46
	Societe Generale	Barmittel	GBP	741.103
	Societe Generale	Barmittel	JPY	351.874.345
	Societe Generale	Barmittel	MXN	1
	Societe Generale	Barmittel	SEK	378.302
	Societe Generale	Barmittel	USD	5.265.894
	Societe Generale	Barmittel	ZAR	1.623.818
			USD	25.751.551
Schroder GAIA Wellington Pagosa				
	BNP Paribas	Barmittel	USD	180.000
	Deutsche Bank	Barmittel	USD	60.000
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	814.484
	HSBC	Barmittel	USD	3.050.000
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	2.585.000
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	28.066
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	15.463
	Morgan Stanley	Barmittel	CZK	2.870
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	238.290
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	94.202
	Morgan Stanley	Barmittel	HKD	433.326
	Morgan Stanley	Barmittel	NOK	3.302.240
	Morgan Stanley	Barmittel	NZD	307.546

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)				
	Morgan Stanley	Barmittel	SEK	302.220
	Morgan Stanley	Barmittel	THB	95.588
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	3.080.866
	Morgan Stanley	Barmittel	ZAR	121
			USD	10.770.155

Ausweis von Transaktionskosten

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

Die Transaktionskosten für den Berichtszeitraum fielen wie folgt aus:

Teilfonds	Währung	Provisionen
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *	USD	6.585
Schroder GAIA BlueTrend	USD	85.450
Schroder GAIA Cat Bond	USD	21.080
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	342.385
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	181.492
Schroder GAIA Helix	USD	591.977
Schroder GAIA Oaktree Credit	USD	-
Schroder GAIA Sirios US Equity	USD	207.521
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *	GBP	29.450
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	83.508
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	770.478

Dividenden

Während des Berichtszeitraums haben die folgenden Teilfonds Dividendenausschüttungen vorgenommen:

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoausschüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
14. Okt. 2022	21. Okt. 2022	28. Okt. 2022	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	474,49	USD	2,934929
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD-abgesichert	995,43	SGD	3,892037
11. Nov. 2022	18. Nov. 2022	25. Nov. 2022	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.009,86	USD	6,246428
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD-abgesichert	2.069,24	SGD	8,089599
09. Dez. 2022	16. Dez. 2022	23. Dez. 2022	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	985,14	USD	6,093138
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD-abgesichert	2.056,68	SGD	8,038289
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF, Aussch.	206.175,84	USD	19,220378
29. Dez. 2022	30. Dez. 2022	09. Jan. 2023	Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch.	17,86	USD	1,172043
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in CHF-abgesichert	104,27	CHF	1,026639
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in EUR-abgesichert	109,72	EUR	1,087351
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in GBP-abgesichert	106,85	GBP	1,051469
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch.	19,71	USD	1,290452
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in CHF-abgesichert	115,77	CHF	1,137699
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in EUR-abgesichert	121,93	EUR	1,206733
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in GBP-abgesichert	118,69	GBP	1,165501
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch.	20,63	USD	1,348226

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Ausschüttungen (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoausschüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in CHF-abgesichert	119,12	CHF	1,169785
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in EUR-abgesichert	125,45	EUR	1,241205
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in GBP-abgesichert	122,20	GBP	1,199191
13. Jan. 2023	20. Jan. 2023	27. Jan. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.312,42	USD	8,116879
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD-abgesichert	2.711,64	SGD	10,595244
10. Feb. 2023	17. Feb. 2023	24. Feb. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.211,32	USD	7,491177
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD-abgesichert	2.578,76	SGD	10,072484
10. Mrz. 2023	17. Mrz. 2023	24. Mrz. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.145,61	USD	7,084338
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD-abgesichert	2.436,26	SGD	9,512930
30. Mrz. 2023	31. Mrz. 2023	11. Apr. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF, Aussch.	344.750,77	USD	28,503106
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch.	20,16	USD	1,307328
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in CHF-abgesichert	120,07	CHF	1,169563
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in EUR-abgesichert	126,00	EUR	1,235247
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in GBP-abgesichert	121,03	GBP	1,178142
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch.	21,99	USD	1,421332
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in CHF-abgesichert	132,51	CHF	1,286792
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in EUR-abgesichert	139,16	EUR	1,360962
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in GBP-abgesichert	133,68	GBP	1,296884
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch.	22,47	USD	1,448996
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in CHF-abgesichert	136,30	CHF	1,322120
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in EUR-abgesichert	143,13	EUR	1,399021
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in GBP-abgesichert	23.340,52	GBP	1,320451

Gegenseitige Investitionen der Teilfonds

Zum 31. März 2023 beliefen sich die gegenseitigen Investitionen der Teilfonds auf insgesamt 9.586.906 EUR, daher würde der kombinierte Gesamt-NIW am Ende des Berichtszeitraums ohne gegenseitige Investitionen 4.936.394.029 EUR betragen. Die Einzelheiten zu den gegenseitigen Investitionen der Teilfonds sind in der folgenden Tabelle angegeben:

Investition	Währung des Teilfonds	Marktwert	% Nettovermögen
Schroder GAIA Helix			
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *		10.397.000	3,48
	USD	10.397.000	3,48

Wechselkurs

Der folgende Wechselkurs wurde für die Berechnung des im Finanzbericht zum 31. März 2023 in EUR ausgewiesenen Gesamtbetrags verwendet:

1 Euro = 0,92208 US-Dollar

1 Euro = 1,13748 Pfund Sterling

Ukraine/Russland-Sanktionen

Die Invasion der Ukraine durch Russland seit 24. Februar 2022 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 ausgegeben wurden. Zum Zeitpunkt dieses Berichts sind die Lösung dieses Konflikts und die potenziellen Auswirkungen auf die Fonds weiterhin ungewiss. Das Board of Directors beobachtet die Situation in Bezug auf alle in unseren Fonds gehaltenen Wertpapiere sehr genau. Wertpapiere russischer Emittenten, die in unseren Fonds gehalten werden, werden weiterhin durch eine Reihe von Maßnahmen von Regierungen, Börsen und Kontrahenten, einschließlich Sanktionsmaßnahmen, beeinträchtigt, 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. Das Board of Directors 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

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Pro Anteilsklasse berechnete Performancegebühr

Teilfonds und Anteilsklassen	Pro Anteilsklasse berechnete Performancegebühr in Währung des Fonds	Prozentsatz der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *		
Klasse A Thes.	10	0,63 %
Klasse C Thes.	10	0,67 %
Klasse I Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse IZ Thes.	10	0,69 %

Schroder GAIA BlueTrend

Klasse A Thes.	20	0,00 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes.	99	0,00 %
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	114	0,00 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	23	0,00 %
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes.	0	0,00 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00 %
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	209	0,00 %

Schroder GAIA Cat Bond

Klasse A Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse C Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse F Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse F Aussch.	entfällt #	entfällt #
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse I Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse IF Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse IF Aussch.	entfällt #	entfällt #
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	8.984	0,02 %

Teilfonds und Anteilsklassen	Pro Anteilsklasse berechnete Performancegebühr in Währung des Fonds	Prozentsatz der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)		
Klasse PI Aussch.	100.254	0,19 %
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	14.748	0,17 %
Klasse Y Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse Y1 Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse Y2 Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	entfällt #	entfällt #

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Klasse A Thes.	0	0,00 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	0	0,00 %
Klasse A1 Thes.	0	0,00 %
Klasse C Thes.	0	0,00 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes.	0	0,00 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	0	0,00 %

Schroder GAIA Egerton Equity

Klasse A Thes.	0	0,00 %
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in USD abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Aussch. GBP	0	0,00 %
Klasse A1 Thes.	0	0,00 %
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes.	0	0,00 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in USD abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Aussch.	0	0,00 %
Klasse C Aussch. GBP	0	0,00 %
Klasse E Thes.	0	0,00 %
Klasse X Thes.	0	0,00 %

Performancegebühr wird der Anteilsklasse nicht berechnet.

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Pro Anteilsklasse berechnete Performancegebühr (Forts.)

Teilfonds und Anteilsklassen	Pro Anteilsklasse berechnete Performancegebühr in Währung des Fonds	Prozentsatz der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW	Teilfonds und Anteilsklassen	Pro Anteilsklasse berechnete Performancegebühr in Währung des Fonds	Prozentsatz der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Helix			Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *		
Klasse A Thes.	0	0,00 %	Klasse C Thes.	0	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 USD 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., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse K Thes., in USD abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse R Thes.	0	0,00 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse R Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	0	0,00 %	Klasse R Thes., in USD abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	0	0,00 %			
Klasse C1 Thes.	0	0,00 %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
Klasse E Thes.	0	0,00 %	Klasse C Thes.	932.926	0,35 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	47	0,00 %
Klasse I Thes.	entfällt #	entfällt #	Klasse K Thes.	11.783	0,02 %
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	entfällt #	entfällt #	Klasse K Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse S Aussch.	0	0,00 %	Schroder GAIA Wellington Pagosa		
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse A Thes.	0	0,00 %
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	464	0,00 %
			Klasse A Thes., in SGD abgesichert	22	0,00 %
Schroder GAIA Sirius US Equity			Klasse C Thes.	14.550	0,00 %
Klasse A Thes.	1.038	0,00 %	Klasse C Thes., in BRL abgesichert	567	0,00 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	367	0,00 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	2.331	0,00 %
Klasse C Thes.	42.406	0,09 %	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	285	0,00 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	1	0,00 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	846	0,00 %	Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1.090	0,02 %	Klasse E Thes.	50	0,00 %
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes.	40	0,14 %	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	917	0,01 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse E Thes., in GBP abgesichert	219	0,00 %
Klasse X Thes.	2	0,15 %			
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %			

Für den Schroder GAIA Oaktree Credit wird keine Performancegebühr erhoben.

Performancegebühr wird der Anteilsklasse nicht berechnet.

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Gesamtkostenquote („TER“, Total Expense Ratio) für Berichtszeitraum zum 31. März 2023

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *	
Klasse A Thes.	2,20 %
Klasse C Thes.	1,48 %
Klasse I Thes.	0,15 %
Klasse IZ Thes.	1,24 %
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 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., in EUR abgesichert	1,43 %
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	1,43 %
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	1,43 %
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	1,42 %
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	1,47 %
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	1,42 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,43 %
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.	0,15 %
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	0,15 %
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	0,13 %
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,11 %
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	1,34 %
Klasse IF Aussch.	1,33 %
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	0,62 %
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	0,62 %
Klasse PI Aussch.	0,61 %
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	0,62 %
Klasse Y Thes.	1,10 %
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	1,11 %
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	1,13 %
Klasse Y1 Thes.	1,51 %

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)	
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	1,53 %
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	1,53 %
Klasse Y2 Thes.	0,01 %
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	0,01 %
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	0,01 %
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	0,01 %
Schroder GAIA Contour Tech Equity	
Klasse A Thes.	2,42 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,45 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,46 %
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 E Thes.	1,42 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,46 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,46 %
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	1,45 %
Schroder GAIA Egerton Equity	
Klasse A Thes.	2,42 %
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes., in USD abgesichert	2,45 %
Klasse A Aussch. GBP	2,43 %
Klasse A1 Thes.	2,92 %
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	2,96 %
Klasse C Thes.	1,67 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,70 %
Klasse C Thes., in USD abgesichert	1,70 %
Klasse C Aussch.	1,68 %
Klasse C Aussch. GBP	1,67 %
Klasse E Thes.	1,63 %
Klasse X Thes.	1,57 %
Schroder GAIA Helix	
Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,47 %
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	2,45 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,45 %
Klasse C Thes.	1,35 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,41 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,39 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,38 %
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	1,14 %
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	1,40 %
Klasse C1 Thes.	1,27 %
Klasse E Thes.	1,00 %

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen. Beachten Sie bitte, dass die Transaktionskosten – wie in den Anmerkungen zum Finanzbericht angegeben – sowie Transaktionskosten in Verbindung mit dem zugrundeliegenden Portfolio strukturierter Produkte nicht in der oben aufgeführten TER berücksichtigt werden.

Gesamtkostenquote („TER“, Total Expense Ratio) für Berichtszeitraum zum 31. März 2023 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Helix (Forts.)	
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,00 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0,99 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0,98 %
Klasse I Thes.	0,13 %
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,17 %
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	1,16 %
Klasse S Aussch.	0,59 %
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0,62 %
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0,63 %
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0,74 %

Schroder GAIA Oaktree Credit	
Klasse A2 Thes.	1,39 %
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	1,57 %
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	1,57 %
Klasse A2 Aussch.	1,35 %
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	1,58 %
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	1,59 %
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	1,58 %
Klasse C Thes.	1,06 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,09 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,08 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,08 %
Klasse C Aussch.	0,86 %
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	1,09 %
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	1,09 %
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,08 %
Klasse E Thes.	0,90 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0,89 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0,93 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0,93 %
Klasse E Aussch.	0,61 %
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	0,94 %
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	0,94 %
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	1,01 %
Klasse I Thes.	0,14 %

Schroder GAIA Sirius US Equity	
Klasse A Thes.	2,42 %
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	1,71 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,70 %
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,66 %
Klasse E Thes.	1,39 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,40 %
Klasse X Thes.	1,51 %
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	1,61 %

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *	
Klasse C Thes.	1,13 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,17 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,15 %
Klasse C Thes., in USD abgesichert	1,15 %
Klasse I Thes.	0,08 %
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	1,67 %
Klasse K Thes., in USD abgesichert	1,62 %
Klasse R Thes.	1,13 %
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	1,15 %
Klasse R Thes., in USD abgesichert	1,15 %

Schroder GAIA Two Sigma Diversified	
Klasse C Thes.	1,83 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,86 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,86 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,85 %
Klasse K Thes.	2,33 %
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	2,34 %
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	2,36 %

Schroder GAIA Wellington Pagosa	
Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,46 %
Klasse C Thes.	1,68 %
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,70 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,72 %
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	1,73 %
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 %

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen. Beachten Sie bitte, dass die Transaktionskosten – wie in den Anmerkungen zum Finanzbericht angegeben – sowie Transaktionskosten in Verbindung mit dem zugrundeliegenden Portfolio strukturierter Produkte nicht in der oben aufgeführten TER berücksichtigt werden.

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

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 den Berichtszeitraum zum 31. März 2023 nachfolgend detailliert aufgeführt:

Schroder GAIA Egerton Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen EUR	% verwaltetes Vermögen
6.030.576	1,36 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen EUR	% verwaltetes Vermögen
6.701.613	1,50 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt EUR	% verwaltetes Vermögen
12.732.189	2,86 %

Angaben zur Konzentration

Die zehn größten Emittenten von Sicherheiten (über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps hinweg)

Zum 31. März 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen EUR
Goldman Sachs	5.869.927
Morgan Stanley	3.908.579
J.P. Morgan	1.609.795
Merrill Lynch	1.343.888
	12.732.189

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil der Sicherheit

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Währung der Sicherheit

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil der Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen EUR	Short-Positionen EUR	Summe EUR
weniger als 1 Tag	–	–	–
1 bis 7 Tage	–	–	–
1 bis 4 Wochen	–	383.528	383.528
1 bis 3 Monate	–	357.499	357.499
3 bis 12 Monate	177.726	2.355.252	2.532.978
mehr als 1 Jahr	5.852.850	3.605.334	9.458.184
Unbegrenzte Laufzeit	–	–	–
	6.030.576	6.701.613	12.732.189

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

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.

Weiterverwendung von Sicherheiten

Auf Total Return Swaps gegebenenfalls erhaltene Sicherheiten werden vom Teilfonds nicht weiterverwendet oder reinvestiert.

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

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	20.618.397
Gepoolt	-
Sonstige	-
	20.618.397

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

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

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite EUR *
Nettozinsen auf Swaps **	2,06 %	1.053.543
Realisierter Nettogewinn	39,68 %	20.267.606
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	58,26 %	29.754.218
	100,00 %	51.075.367

* 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 „Nettogewinne aus Swaps“ und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ sowie unter „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps“ enthalten.

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Helix

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
-	-
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
10.780.223	3,61 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% verwaltetes Vermögen
10.780.223	3,61 %

Angaben zur Konzentration

Die zehn größten Emittenten von Sicherheiten (über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps hinweg)

Zum 31. März 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
J.P. Morgan	7.394.160
Barclays Bank	1.512.669
Goldman Sachs	1.192.366
Morgan Stanley	681.028
	10.780.223

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil der Sicherheit

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Währung der Sicherheit

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil der 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	-	10.780.223	10.780.223
mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	-	10.780.223	10.780.223

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Weiterverwendung von Sicherheiten

Auf Total Return Swaps gegebenenfalls erhaltene Sicherheiten werden vom Teilfonds nicht weiterverwendet oder reinvestiert.

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

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	10.100.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	10.100.000

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

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

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite USD *
Nettozinsen auf Swaps **	0,52 %	456.215
Realisierter Nettoverlust	47,62 %	42.031.176
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	51,86 %	45.768.004
	100,00 %	88.255.395

* 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 „Nettogewinne aus Swaps“ und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ sowie unter „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps“ enthalten.

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
2.703.138	1,42 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
5.156.572	2,72 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% verwaltetes Vermögen
7.859.710	4,14 %

Angaben zur Konzentration

Die zehn größten Emittenten von Sicherheiten (über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps hinweg)

Zum 31. März 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Merrill Lynch	4.310.720
Goldman Sachs	3.445.294
Morgan Stanley	81.112
Barclays Bank	22.584
	7.859.710

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	80.000
	80.000

Fälligkeitsprofil der Sicherheit

Fälligkeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	80.000
1 bis 7 Tage	–
1 bis 4 Wochen	–
1 bis 3 Monate	–
3 bis 12 Monate	–
mehr als 1 Jahr	–
Unbegrenzte Laufzeit	–
	80.000

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

Währung der Sicherheit

Währung	Marktwert USD
USD	80.000
	80.000

Fälligkeitsprofil der 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	26.260	817.121	843.381
3 bis 12 Monate	2.676.878	3.306.643	5.983.521
mehr als 1 Jahr	-	1.032.808	1.032.808
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	2.703.138	5.156.572	7.859.710

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Weiterverwendung von Sicherheiten

Auf Total Return Swaps gegebenenfalls erhaltene Sicherheiten werden vom Teilfonds nicht weiterverwendet oder reinvestiert.

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	80.000
	80.000

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	370.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	370.000

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

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 den Berichtszeitraum zum 31. März 2023 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite USD *
Nettozinsen auf Swaps **	9,90 %	507.028
Realisierter Nettogewinn	12,15 %	621.675
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	77,95 %	3.989.459
	100,00 %	5.118.162

* 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 „Nettogewinne aus Swaps“ und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ sowie unter „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps“ 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	% verwaltetes Vermögen
2.191.713	0,39 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
–	–
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% verwaltetes Vermögen
2.191.713	0,39 %

Angaben zur Konzentration

Die zehn größten Emittenten von Sicherheiten (über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps hinweg)

Zum 31. März 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	2.191.713
	2.191.713

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil der Sicherheit

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Währung der Sicherheit

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Fälligkeitsprofil der 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	2.191.713	-	2.191.713
mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	2.191.713	-	2.191.713

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.

Weiterverwendung von Sicherheiten

Auf Total Return Swaps gegebenenfalls erhaltene Sicherheiten werden vom Teilfonds nicht weiterverwendet oder reinvestiert.

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

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	1.600.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	1.600.000

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

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

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023 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	74,58 %	46.433.094
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	25,42 %	15.826.084
	100,00 %	62.259.178

* Absolut ausgedrückt.

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

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
5.922.963	0,88 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
12.883.384	1,92 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% verwaltetes Vermögen
18.806.347	2,80 %

Angaben zur Konzentration

Die zehn größten Emittenten von Sicherheiten (über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps hinweg)

Zum 31. März 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	9.199.793
Goldman Sachs	4.836.989
J.P. Morgan	4.769.565
	18.806.347

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	2.304.484
	2.304.484

Fälligkeitsprofil der Sicherheit

Fälligkeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	2.304.484
1 bis 7 Tage	–
1 bis 4 Wochen	–
1 bis 3 Monate	–
3 bis 12 Monate	–
mehr als 1 Jahr	–
Unbegrenzte Laufzeit	–
	2.304.484

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Währung der Sicherheit

Währung	Marktwert USD
USD	2.304.484
	2.304.484

Fälligkeitsprofil der 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	34.497	40.344	74.841
3 bis 12 Monate	-	3.612	3.612
mehr als 1 Jahr	5.888.466	12.839.428	18.727.894
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	5.922.963	12.883.384	18.806.347

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.

Weiterverwendung von Sicherheiten

Auf Total Return Swaps gegebenenfalls erhaltene Sicherheiten werden vom Teilfonds nicht weiterverwendet oder reinvestiert.

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
J.P. Morgan	2.150.000
Goldman Sachs	154.484
	2.304.484

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	1.812.401
Gepoolt	-
Sonstige	-
	1.812.401

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

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023 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	36,14 %	9.460.866
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	63,86 %	16.718.880
	100,00 %	26.179.746

* Absolut ausgedrückt.

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

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.



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 31. März 2023 DEDE