



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Halbjahresbericht

31. März 2022

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
Bericht des Verwaltungsrats	10
Bericht des Anlageverwalters	11
Nettovermögensaufstellung	13
Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Berichtszeitraum	19
Veränderung des Nettovermögens für den Berichtszeitraum	21
Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen	23
Anlageportfolio	27
Schroder GAIA BlueTrend	27
Schroder GAIA Cat Bond	27
Schroder GAIA Contour Tech Equity	32
Schroder GAIA Egerton Equity	32
Schroder GAIA Helix	33
Schroder GAIA Oaktree Credit	37
Schroder GAIA Sirius US Equity	41
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	42
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	43
Schroder GAIA Wellington Pagosa	44
Anmerkungen zum Abschluss	54
Gesamtkostenquote („TER“)	139
Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte	141

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 2021 bis zum 31. März 2022. Der Halbjahresabschluss wurde im Einklang mit den Luxemburger Verordnungen in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen erstellt. Der letzte Termin, an dem die Anteilsurse berechnet wurden, war der 31. März 2022, der letzte Arbeitstag im Berichtszeitraum. Zum Zeitpunkt dieses Berichts stehen zehn Teilfonds innerhalb der Gesellschaft für Investitionen zur Verfügung (die „Teilfonds“).

Die Anlageziele der Teilfonds sowie Angaben zu Anlagebeschränkungen finden Sie im aktuellen Verkaufsprospekt. Den Bericht des Anlageverwalters für den jeweiligen Teilfonds finden Sie in den vierteljährlichen Anlageberichten, die am Sitz der Gesellschaft und auf der Website von Schroder Investment Management (Europe) S.A. erhältlich sind (<http://www.schroders.lu>).

Schroders ist eine FATCA-konforme Organisation. Die FATCA-Klassifizierung dieser Gesellschaft und ihre GIIN lauten wie folgt: FATCA-Klassifizierung dieser Gesellschaft: FFI; Sponsoring-Gesellschaft: Schroder Investment Management (Europe) S.A.; GIIN der Sponsoring-Gesellschaft: 4R1MT7.00000.SP.442.

Corporate Governance

Die Gesellschaft unterliegt der Corporate Governance beruhend auf:

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

Interne Kontroll- und Risikomanagementsysteme

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

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

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

Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland

Zahl- und Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

UBS Europe SE
OpernTurm
Bockenheimer Landstraße 2-4
D-60306 Frankfurt am Main

Weitere Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

Schroder Investment Management GmbH
Taunustor 1
D-60310 Frankfurt am Main

Die am Geschäftssitz der Gesellschaft zur Einsichtnahme verfügbaren Unterlagen (der ausführliche Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung, die Jahres- und Halbjahresberichte) stehen auch bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle und der weiteren deutschen Informationsstelle kostenlos in Papierform zur Verfügung.

Wertpapierbestandsveränderungen

Eine Aufstellung der Wertpapierbestandsveränderungen im Berichtszeitraum kann kostenlos am Geschäftssitz der Gesellschaft sowie bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle und bei der weiteren deutschen Informationsstelle angefordert werden.

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsvorsitzender

- **Eric Bertrand**

Head of Schroders GAIA

Vaults 13-16
Valletta Waterfront
FRN 1914
Malta

Andere Verwaltungsratsmitglieder

- **Carla Bergareche**

Head of Iberian Business

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

- **Mike Champion¹**

Head of Product Development

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

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

Independent Director

12, rue de la Sapinière, 8150 Bridel
Großherzogtum Luxemburg

- **Bernard Herman**

Independent Director

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

- **Achim Küssner²**

Country Head Germany, Austria & CEE

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

- **Hugh Mullan**

Independent Director

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

- **Alexander Prawitz³**

Head of Central and Emerging Europe Distribution

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

- **Neil Walton**

Head of Investment Solutions

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

¹ Das Verwaltungsratsmandat von Mike Champion endete im Berichtszeitraum am 28. Februar 2022.

² Das Verwaltungsratsmandat von Achim Küssner endete im Berichtszeitraum am 18. Oktober 2021.

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

Verwaltung

Eingetragener Sitz

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft, Register- und Domizilstelle

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptzahlstelle und Transferstelle

HSBC Continental Europe, Luxembourg

16, boulevard d'Avranches, 1160 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Verwahrstelle und Verwaltungsstelle

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

80, route d'Esch, 1470 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptrechtsberater

Arendt & Medernach S.A.

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

Unabhängiger Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative

2, rue Gerhard Mercator, 2182 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter

BennBridge Ltd.

Windsor House, Station Court, Station Road, Great Shelford
Cambridgeshire CB22 5NE, Vereinigtes Königreich
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund

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 Unteranlageverwalter für den Schroder GAIA Egerton Equity bestellt:

- Egerton Capital (US), LP.

Oaktree Capital Management, L.P.

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

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

- Oaktree Capital Management (UK) LLP

Schroder Investment Management Limited

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

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

- BennBridge Ltd.

- Schroder Investment Management North America Ltd.

- Schroder Investment Management (Singapore) Ltd.

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

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

Sirios Capital Management LP

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

Systematica Investments Limited

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

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

- Systematica Investments UK LLP,

- Systematica Investments Jersey Limited,

- Systematica Investments GP Limited, Niederlassung Genf, und

- Systematica Investments Singapore PTE.

Two Sigma Advisers LP

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

Verwaltungsstelle (Forts.)

Anlageverwalter (Fortsetzung)

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
Unteranlageverwalter für den Schroder GAIA Wellington Pagosa bestellt:

- Wellington Management Company LLP.

Bericht des Verwaltungsrats

Einleitung

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft legt hiermit seinen Bericht und den Abschluss für den Berichtszeitraum zum 31. März 2022 vor.

Aktivitäten während des Berichtszeitraums

Zum 31. März 2022 belief sich das Nettovermögen der Gesellschaft insgesamt auf 5.584.312.809 EUR, was im Vergleich zu 5.674.359.712 EUR zum 30. September 2021 einem Rückgang um 1,59 % entspricht.

1. Neue Anteilsklassen

Während des Berichtszeitraums wurden die folgenden Anteilsklassen neu aufgelegt:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Cat Bond			
Klasse A Thes. In EUR abgesichert	EUR	USD	10. Dezember 2021
Schroder GAIA Helix			
Klasse A Thes. In SEK abgesichert	SEK	USD	11. November 2021
Klasse C Thes. In SEK abgesichert	SEK	USD	11. November 2021
Klasse IZ Thes. In GBP abgesichert	GBP	USD	3. März 2022
Klasse S Aussch.	USD	USD	3. März 2022
Klasse S Aussch. In EUR abgesichert	EUR	USD	3. März 2022
Klasse S Aussch. In GBP abgesichert	GBP	USD	3. März 2022

2. Auflösungen von Anteilsklassen

Während des Berichtszeitraums wurden die folgenden Anteilsklassen aufgelöst:

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

Der Verwaltungsrat

Schroder GAIA
31. März 2022

Bericht des Anlageverwalters

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

Wirtschaftlicher Rückblick

Der Sechsmonatszeitraum stand ganz im Zeichen einer stark steigenden Inflation. Im Laufe des Berichtszeitraums schnellten die Erdgaspreise in Europa aufgrund von Engpässen in die Höhe, was wiederum die Strompreise ansteigen ließ. Das Auftauchen der Omicron-Variante von Covid-19 im November führte zu neuen Einschränkungen der Aktivitäten und erneuten Störungen auf der Angebotsseite, was den Inflationsdruck ebenfalls weiter verstärkte.

Im Februar 2022 erfolgte dann der schockierende Einmarsch Russlands in die Ukraine. Der Krieg hat verheerende Auswirkungen auf die Menschen in der Ukraine. In gewissem Maße verschärft er auch den bestehenden wirtschaftlichen Druck, da die westlichen Staaten Sanktionen gegen russische Einzelpersonen und Finanzunternehmen verhängt haben. Zum Zeitpunkt der Erstellung dieses Textes hat Europa keine Sanktionen gegen Öl- und Gasimporte aus Russland verhängt, aber Deutschland hat die Genehmigung für die lang erwartete Nord Stream 2-Gaspipeline ausgesetzt. Der Krieg wird voraussichtlich auch Auswirkungen auf die Versorgung mit landwirtschaftlichen Rohstoffen wie Weizen haben, da die Ukraine und Russland große Lieferanten sind.

Aufgrund der höheren Inflation hob die Bank of England (BoE) als erste große Zentralbank die Zinssätze an, und zwar um 0,15 Prozentpunkte im Dezember 2021 und um weitere 0,5 Prozentpunkte im Jahr 2022, sodass die Zinssätze bis Ende März auf 0,75 % gestiegen sind. Die jährliche Inflation im Vereinigten Königreich (gemessen am Verbraucherpreisindex) erreichte im Februar 2022 6,2 % und lag damit deutlich über dem Ziel der BoE von 2 %.

Die US-Notenbank folgte im März und hob die Zinsen um 0,25 Prozentpunkte auf eine Spanne von 0,25 bis 0,50 % an. Die US-Inflation erreichte im Februar 2022 mit 7,9 % den höchsten Wert seit 1982. In der Eurozone erreichte die Inflation im Februar ein Rekordhoch. Infolgedessen fuhr die Europäische Zentralbank ihr Anleihenkaufprogramm zurück und deutete an, dass sie die Zinsen im weiteren Verlauf des Jahres anheben könnte.

Die Beschränkungen, die aufgrund der Welle der Omikron-Variante von Covid-19 in den westlichen Ländern eingeführt worden waren, wurden in den ersten Monaten des Jahres 2022 weitgehend aufgehoben. Bestimmte asiatische Länder – einschließlich China – waren jedoch stärker von dem Ausbruch betroffen. China hielt an seiner „Null-Covid“-Politik fest, was strenge Lockdowns in mehreren Großstädten, darunter Shenzhen und Shanghai, nach sich zog. Auch Hongkong verhängte angesichts steigender Fallzahlen und einer niedrigen Impfrate unter der älteren Bevölkerung strenge Restriktionen.

Überblick über die Entwicklung am Aktienmarkt

In den letzten sechs Monaten des Berichtszeitraums verzeichneten die Aktien der Industrieländer, gemessen am MSCI World Index, einen Anstieg von 2,2 % (Quelle: FactSet, US-Dollar). Die Performance unterschied sich jedoch erheblich nach Region, Sektor und Anlagestil.

Der MSCI World Value Index entwickelte sich deutlich besser als der Growth Index. Dies war zum Teil auf die steigenden Rohstoffpreise zurückzuführen, die den Value-Bereichen, wie etwa Energie, zugutekamen. Darüber hinaus belastete das Umfeld steigender Anleiherenditen die Wachstumswerte. Dies liegt daran, dass die erwarteten Cashflows von Wachstumswerten weiter in die Zukunft reichen und daher anfälliger für Änderungen des Diskontsatzes sind, der für die Berechnung ihres Barwerts verwendet wird.

Auf Sektorebene entwickelten sich die Sektoren Energie und Grundstoffe dank höherer Rohstoffpreise sehr gut. Zu den Sektoren, die sich unterdurchschnittlich entwickelten, gehörten Kommunikationsdienstleistungen und Industrierwerte. Während der US-Aktienmarkt im Allgemeinen besser abschnitt als andere Regionen, entwickelten sich einige der wachstumsstarken Aktien aus dem Bereich der Kommunikationsdienstleistungen – wie Netflix und Meta (Facebook) – aufgrund von Bedenken hinsichtlich der Bewertungen und der zukünftigen Wachstumsaussichten schlechter. Im Industriesektor waren viele Unternehmen von den steigenden Beschaffungspreisen und den unterbrochenen Lieferketten betroffen.

Während die USA insgesamt solide Gewinne verbuchten, verzeichneten die europäischen Aktien Rückgänge. Dies war zum Teil auf die Nähe der Region zum Krieg in der Ukraine und die Abhängigkeit von russischem Gas zurückzuführen. Außerdem belasteten die Sorgen über die Auswirkungen der steigenden Kraftstoff- und Strompreise auf die Verbraucherausgaben die Stimmung. Britische Aktien legten zu, vor allem dank des hohen Engagements in den Sektoren Energie und Grundstoffe, zu denen auch Metalle und Bergbau gehören.

Der MSCI Emerging Markets Index war unterdessen rückläufig und entwickelte sich schlechter als der MSCI World. Im Vorfeld des Einmarsches in die Ukraine am 24. Februar und in der Folgezeit fielen die russischen Aktien stark. Der lokale Markt wurde am 25. Februar geschlossen und Russland wurde am 9. März aus dem MSCI Emerging Markets Index genommen – und zwar zu einem Kurs, der praktisch bei Null lag.

China hinkte dem Index der Schwellenländer (EM) weit hinterher, da täglich neue Corona-Fälle auftraten und in mehreren Städten Lockdowns verhängt wurden. Regulatorische Bedenken bezüglich der in den USA notierten chinesischen Aktien trugen ebenfalls zur Marktschwäche bei. Südkorea und Taiwan schnitten schlechter ab, da sich die Aussichten für das globale Wachstum verschlechterten.

Die lateinamerikanischen Märkte erzielten hingegen allesamt starke Gewinne, die durch die Stärke der Währungen weitere Unterstützung erhielten. Die Aufwärtsbewegung der Rohstoffpreise erwies sich für alle regionalen Märkte als förderlich. Andere Nettoexporteure von Rohstoffen aus den Schwellenländern verzeichneten beträchtliche Gewinne, darunter die VAE, Katar, Kuwait, Südafrika und Saudi-Arabien.

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

Nach dem starken wirtschaftlichen Aufschwung im Anschluss an die Pandemie, als die Länder ihre Lockdownmaßnahmen zurückführen, richtete sich die Aufmerksamkeit auf den immer stärker werdenden Inflationsdruck.

Über weite Strecken des Jahres 2021 behielten die Zentralbanken eine lockere Geldpolitik bei und neigten dazu, die Inflation zu ignorieren. Aufgrund der wieder erstarkten Nachfrage, des Energiepreisdruks und der Unterbrechung der Lieferketten erwiesen sich die Preissteigerungen jedoch als hartnäckig.

Infolgedessen zogen die Zentralbanken im weiteren Verlauf des Jahr 2021 die Zügel an. Dies war auch Ausdruck der guten Wirtschaftslage, die mit besonders angespannten Arbeitsmärkten einherging.

Die Anleiherenditen stiegen im ersten Quartal 2022 stark an. Die Federal Reserve (Fed) begann im März mit der Drosselung der Wertpapierkäufe und erhöhte die Zinsen. Die Tonlage wurde deutlich restriktiver, was die Anleger dazu veranlasste, für 2022 eine schnelle Folge weiterer Erhöhungen einzupreisen.

Die Bank of England (BoE) hob trotz der Besorgnis über den Druck steigender Lebenshaltungskosten auf die Verbraucher die Zinsen im Dezember und erneut im Februar und März an. Am selben Tag der Zinserhöhung durch die BoE im Februar schien auch die Europäische Zentralbank (EZB) zu einer restriktiveren Haltung überzugehen und schloss Zinserhöhungen im Jahr 2022 nicht mehr aus. Die EZB bestätigte zudem, dass sie ihr Anleihekaufprogramm schneller zurückfahren wird.

Die Renditen auf zehnjährige US-Staatsanleihen stiegen von 1,49 % auf 2,35 %. Die Verschiebung der Erwartungen in Bezug auf die Geldpolitik führte zu einem erheblich größeren Abverkauf bei Staatsanleihen mit kürzeren Laufzeiten. Die Renditen auf zweijährige US-Staatsanleihen stieg von 0,28 % auf 2,33 %.

Die Rendite auf zehnjährige britische Staatsanleihen stieg von 1,02 % auf 1,61 % und die auf zweijährige Anleihen von 0,41 % auf 1,36 %.

Die Renditen auf zehnjährige deutsche Staatsanleihen stieg von -0,19 % auf 0,55 %. Die Renditen auf zweijährige deutsche Staatsanleihen stieg von -0,69 % auf -0,07 %. Die Renditen der italienischen Staatsanleihen wurden durch die Besorgnis über eine Straffung der Geldpolitik belastet, wobei die Renditen der zehnjährigen Staatsanleihen von 0,86 % auf 2,04 % stiegen.

Globale Unternehmensanleihen erzielten negative Gesamtrenditen (in Lokalwährung) und blieben hinter Staatsanleihen zurück (Quelle: ICE Data Indices). Hochverzinsliche Anleihen übertrafen aufgrund des Beitrags von Renditenerträgen Anleihen mit Investment-Grade-Rating.

Ausblick

Die Schroders Economics Group ist der Ansicht, dass in den USA nach einem rasanten BIP-Wachstum von 5,7 % im Jahr 2021 eine Abschwächung unvermeidlich ist. Die günstigen Bedingungen auf dem Arbeitsmarkt und ein weiterer Abbau des Sparüberschusses dürften jedoch immer noch dafür sorgen, dass die US-Wirtschaft ein robustes Wachstum von 3,5 % in diesem Jahr und von 2,1 % im Jahr 2023 verzeichnet. Die Inflation ist weiter über die Erwartungen hinausgeschossen und die Federal Reserve (Fed) hat begonnen, die Zinssätze zu erhöhen. Wir gehen davon aus, dass die Fed die Zinsen in diesem Jahr noch mehrmals bis auf 2,25 % Ende 2022 anheben wird.

In der Eurozone wird sich das Wachstum unserer Meinung nach verlangsamen, aber mit 3,3 % für 2022 und 2,6 % im Jahr 2023 solide bleiben. Es wird erwartet, dass die Haushalte ihre Sparquote auf ein normaleres Niveau senken werden und dass die Wirtschaftstätigkeit durch die Staatsausgaben angekurbelt wird, wenn der Konjunkturfonds der Europäischen Union anläuft. Die jährliche Inflation wird voraussichtlich von 2,6 % im Jahr 2021 auf 4,2 % im Jahr 2022 steigen, bevor sie 2023 wieder auf 2,1 % zurückgeht. Die Europäische Zentralbank verfolgt jedoch weiterhin einen gemäßigten Kurs. Sie beendete ihr Pandemie-Notkaufprogramm (Pandemic Emergency Purchase Programme, PEPP) im März 2022, wird ihr quantitatives Lockerungsprogramm aus der Zeit vor der Pandemie aber wahrscheinlich bis zum ersten Quartal 2023 beibehalten und die Zinsen erst in der zweiten Hälfte des Jahres 2023 anheben.

Im Vereinigten Königreich dürfte sich das Wachstum 2022 von 7,5 % auf 4,3 % abschwächen, da der Impuls der Wiederaufnahme der wirtschaftlichen Aktivitäten allmählich nachlässt. Die Ausgaben der privaten Haushalte bleiben hoch, da der Sparüberschuss abgebaut wird. Die Kaufkraft wird jedoch durch die Inflation aufgezehrt. Die steigende Inflation wird vor allem durch die höheren Energiepreise getrieben. Ein Rückgang der Inflation wird für 2023 erwartet. Ein starker Arbeitsmarkt dürfte die Bank of England indes bestärken, die Zinsen weiter anzuheben und den Leitzins bis Ende des Jahres auf 1,25 % zu erhöhen.

In den Schwellenmärkten (EM) haben die meisten Länder den geldpolitischen Kurswechsel bisher gut verkraftet. Solide Auslandspositionen in Verbindung mit relativ hohen Zinssätzen sollten weiterhin einen gewissen Puffer bieten, wenn die Fed die Zinsschraube anzieht. Obwohl diese soliden Fundamentaldaten eine Krise in den Schwellenmärkten abwenden sollten, dürfte sich das Wachstum dennoch verlangsamen, da die Impulse aus den Exporten in die Industrieländer nachlassen und die höheren inländischen Zinssätze sich bemerkbar machen.

Insgesamt tendiert die Risikobilanz in Richtung Stagflation. Eine höhere Inflation auf der Angebotsseite bleibt ein zentrales Risiko. Dazu kommt die Möglichkeit einer anhaltenden russischen Aggression in der Ukraine.

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 2022

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
VERMÖGENSWERTE					
Anlagen					
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	173.348.809	2.245.238.212	334.263.199	611.002.916	607.772.828
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	8.006.784	(33.047.093)	(42.272.030)	140.651.199	(9.049.718)
Wertpapiere zum Marktwert	181.355.593	2.212.191.119	291.991.169	751.654.115	598.723.110
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)					
aus Devisenterminkontrakten	2.566.277	8.745.692	624.161	7.600.803	(4.253.826)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	4.719.362	-	-	(2.904.188)	(4.189.323)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Kontrakten	(330.381)	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Inflationsswaps	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	5.495.340	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	20.575.644	(11.815.965)
aus Differenzkontrakten	141.114	-	(22.058.179)	-	12.559.674
	12.591.712	8.745.692	(21.434.018)	25.272.259	(7.699.440)
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	48.340	-	21.770.723	3.003.149	180.740.386
Bankguthaben	42.469.676	98.220.834	20.405.410	34.797.399	20.735.241
Termineinlagen	-	-	-	-	-
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	10.901.465	14.072.226
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	6.482.691	25.208.214	36.553.385	16.854.300	16.293.801
Forderungen aus Zeichnungen	3.574.713	51.849.984	1.376.194	2.998.599	1.669.238
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	-	320.822
Dividenden und Zinsforderungen	160.864	17.781.993	249.905	981.457	10.865.470
Erstattungsforderung des Fonds	59.470	-	-	-	4.335
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	4.970.000	-
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	1.620.000	37.210.000	2.740.000	360.000	5.840.000
Sonstige Forderungen	-	-	-	8.784.373	-
SUMME VERMÖGENSWERTE	248.363.059	2.451.207.836	353.652.768	860.577.116	841.565.189
VERBINDLICHKEITEN					
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	265.516	24.550.000	902.245	11.575.333	95.840.985
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	66.316	4.362.359	3.069.003	3.683.667	20.591.845
Fällige Managementgebühren	212.344	1.896.742	389.852	1.033.598	439.930
Fällige Performancegebühren	2.180.464	-	11.590	110.373	118
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	13.988	-	1.336.540	402.923	1.190.716
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	3.122.996	-	-	-	-
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	770.000	24.750.000	1.910.000	-	3.380.000
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	850.000	12.460.000	830.000	5.330.000	2.460.000
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	2.780.443	29.097.958	5.171.427	1.703.287	16.143.703
SUMME VERBINDLICHKEITEN	10.262.067	97.117.059	13.620.657	23.839.181	140.047.297
SUMME NETTOVERMÖGEN	238.100.992	2.354.090.777	340.032.111	836.737.935	701.517.892

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettvermögensaufstellung zum 31. März 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
VERMÖGENSWERTE						
Anlagen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	29.727.706	190.972.776	180.111.137	33.891.569	335.861.148	4.355.018.782
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	(1.897.510)	17.201.327	35.913	(29.983)	10.515.426	94.959.638
Wertpapiere zum Marktwert	27.830.196	208.174.103	180.147.050	33.861.586	346.376.574	4.449.978.420
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	238.352	(2.361)	(4.086.815)	127.508	804.161	11.942.627
aus Kassageschäften	-	-	8.318	-	-	7.519
aus Terminkontrakten	-	-	(5.652.385)	(113.810)	1.385.295	(6.417.460)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(322.486)	(291.513)
aus Credit Default Index-Kontrakten	-	-	147.694	-	(160.952)	(310.634)
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	1.301.720	1.176.696
aus Inflationsswaps	-	-	-	-	(9.030)	(8.163)
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(1.127.176)	3.948.623
aus Total Return Swaps	-	1.729.919	18.214.622	-	(1.449.821)	26.612.937
aus Differenzkontrakten	-	-	-	230.121	-	(8.185.395)
	238.352	1.727.558	8.631.434	243.819	421.711	28.475.237
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	3.056.020	35.591.821	-	62.897.626	277.900.253
Bankguthaben	6.190.187	19.661.523	565.884.235	2.008.486	6.936.116	742.722.085
Termineinlagen	-	-	161.691.500	-	-	146.161.811
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	-	38.535.162	-	23.936.473	80.093.657
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	88.947	4.003.490	29.947.126	981.136	60.900.007	180.259.076
Forderungen aus Zeichnungen	-	922.240	6.601.239	-	9.018.699	70.806.335
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	1.238.195	-	-	2.139.255	3.343.071
Dividenden und Zinsforderungen	347.659	128.319	39.446	58.905	2.162.745	29.739.678
Erstattungsforderung des Fonds	-	-	-	-	-	57.677
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	-	4.970.000
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	60.000	1.080.000	4.700.000	200.000	2.870.000	51.327.440
Sonstige Forderungen	-	-	-	54.552	-	8.849.153
SUMME VERMÖGENSWERTE	34.755.341	239.991.448	1.031.769.013	37.408.484	517.659.206	6.074.683.893
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	595.063	1.660.130	168.042.338	154.911	39.798.895	311.560.578
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	-	1.457.110	1.311.257	-	248.029	31.802.012
Fällige Managementgebühren	5.038	328.640	1.067.024	22.483	488.253	5.424.430
Fällige Performancegebühren	-	1.695.866	-	-	3.528.640	6.814.715
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	-	281.491	626.087	29.631	2.018.032	5.379.898
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	-	-	2.823.047
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	50.000	810.000	2.040.000	200.000	1.890.000	32.418.288
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	10.000	270.000	2.660.000	-	980.000	23.879.152
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	107.432	2.425.011	15.370.448	30.536	4.714.243	70.268.964
SUMME VERBINDLICHKEITEN	767.533	8.928.248	191.117.154	437.561	53.666.092	490.371.084
SUMME NETTOVERMÖGEN	33.987.808	231.063.200	840.651.859	36.970.923	463.993.114	5.584.312.809

* Für die in Euro angegebene Summe der Nettvermögensaufstellung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 31. März 2022 umgerechnet: 1 Euro = 1,10625 US-Dollar und 1 Euro = 0,84212 Pfund Sterling.

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert					
zum 31. März 2022	238.100.992	2.354.090.777	340.032.111	836.737.935	701.517.892
Im Umlauf befindliche Anteile*					
zum 31. März 2022					
Klasse A Thes.	48.538	2.264	209.517	438.245	12.197
Klasse A Thes. In CHF abgesichert	524	-	3.340	-	511
Klasse A Thes. In EUR abgesichert	289.160	2.639	47.347	-	126.396
Klasse A Thes. In GBP abgesichert	-	-	-	11.368	-
Klasse A Thes. In SEK abgesichert	-	100	-	-	143
Klasse A Thes. In SGD abgesichert	-	-	5.342	-	140
Klasse A Thes. In USD abgesichert	-	-	-	383.334	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	900	-
Klasse A1 Thes.	-	-	21.298	24.135	-
Klasse A1 Thes. In USD abgesichert	-	-	-	98.169	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. In CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	389.445	2.852	1.166.809	1.358.774	18.764
Klasse C Thes. In BRL abgesichert	202.325	-	-	-	-
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	6.671	1.367	28.431	-	369
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	229.659	7.015	812.968	-	409.751
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	429.486	100	215.903	280.371	182.030
Klasse C Thes. In SEK abgesichert	-	-	108.901	-	11
Klasse C Thes. In SGD abgesichert	-	-	-	-	140
Klasse C Thes. In USD abgesichert	-	-	-	816.043	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	6.706	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	10.163	-
Klasse C Aussch. In GBP abgesichert	101	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	1
Klasse C1 Thes. In CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	73.911	-	16.409	6	1.047.054
Klasse E Thes. In CHF abgesichert	-	-	2.509	-	56.699
Klasse E Thes. In EUR abgesichert	5.000	-	48.795	-	1.028.250
Klasse E Thes. In GBP abgesichert	-	-	25.297	-	80.354
Klasse E Thes. In SEK abgesichert	-	-	50.797	-	-
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	120.008	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	15.501	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	3.133	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	9.006	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	162	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	256	-	-	-
Klasse I Thes.	-	140.801	-	-	701.422
Klasse I Thes. In CHF abgesichert	-	27.132	-	-	-
Klasse I Thes. In EUR abgesichert	-	9	-	-	-
Klasse I Thes. In JPY abgesichert	-	120	-	-	103
Klasse IF Thes.	-	257.434	-	-	-
Klasse IF Thes. In CHF abgesichert	-	128.150	-	-	-
Klasse IF Thes. In EUR abgesichert	-	477.874	-	-	-
Klasse IF Thes. In SEK abgesichert	-	7.233.797	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	19.816	-	-	-
Klasse IZ Thes. In GBP abgesichert	-	-	-	-	92
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	42.000	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	1.250	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. In USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	110.514
Klasse S Aussch. In EUR abgesichert	-	-	-	-	27.521
Klasse S Aussch. In GBP abgesichert	-	-	-	-	1.264.491
Klasse X Thes.	-	-	-	328.358	-
Klasse X Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	656.234

* Informationen zu der für die Anteilsklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie im Abschnitt „Anteilsklassen“ der Anmerkungen zum Abschluss.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert					
zum 31. März 2022	33.987.808	231.063.200	840.651.859	36.970.923	463.993.114
Im Umlauf befindliche Anteile*					
zum 31. März 2022					
Klasse A Thes.	-	668.605	-	-	121.656
Klasse A Thes. In CHF abgesichert	-	5.035	-	-	2.328
Klasse A Thes. In EUR abgesichert	-	101.581	-	-	141.509
Klasse A Thes. In GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. In SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. In SGD abgesichert	-	-	-	-	17.350
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 C Thes.	10.131	344.329	2.310.364	85.986	1.766.489
Klasse C Thes. In BRL abgesichert	-	-	-	-	163.647
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	100	12.204	37.642	2.015	29.000
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	100	240.461	1.343.903	95.234	868.074
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	100	54.302	1.822.597	-	484.951
Klasse C Thes. In SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. In SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. In USD abgesichert	-	-	-	9.966	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. In GBP abgesichert	-	1.976	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes. In CHF abgesichert	-	-	-	-	5
Klasse C1 Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	330
Klasse E Thes.	103.235	170	-	-	51.374
Klasse E Thes. In CHF abgesichert	5.093	-	-	-	9.762
Klasse E Thes. In EUR abgesichert	20.174	11.132	-	-	134.264
Klasse E Thes. In GBP abgesichert	100	-	-	-	66.387
Klasse E Thes. In SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	200.015	-	-	15	-
Klasse I Thes. In CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. In JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. In CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. In SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes. In GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	608.093	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	2.734	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	82.329	87	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	77	-
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	109.325	-
Klasse R Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	26.826	-
Klasse R Thes. In USD abgesichert	-	-	-	4.574	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch. In EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch. In GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	15	-	-	-
Klasse X Thes. In EUR abgesichert	-	243	-	-	-

* Informationen zu der für die Anteilsklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie im Abschnitt „Anteilsklassen“ der Anmerkungen zum Abschluss.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil*					
zum 31. März 2022					
Klasse A Thes.	115,44	1.466,54	118,92	215,80	106,07
Klasse A Thes. In CHF abgesichert	101,14	-	108,94	-	99,75
Klasse A Thes. In EUR abgesichert	104,14	995,40	111,16	-	100,56
Klasse A Thes. In GBP abgesichert	-	-	-	202,82	-
Klasse A Thes. In SEK abgesichert	-	910,72	-	-	829,48
Klasse A Thes. In SGD abgesichert	-	-	163,17	-	105,35
Klasse A Thes. In USD abgesichert	-	-	-	215,08	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	201,99	-
Klasse A1 Thes.	-	-	118,46	201,86	-
Klasse A1 Thes. In USD abgesichert	-	-	-	206,74	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. In CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	118,89	1.478,64	123,29	233,30	109,41
Klasse C Thes. In BRL abgesichert	138,98	-	-	-	-
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	104,45	1.155,44	114,38	-	103,54
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	106,62	1.217,71	114,94	-	104,04
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	113,25	104,99	95,07	217,42	106,88
Klasse C Thes. In SEK abgesichert	-	-	955,32	-	833,72
Klasse C Thes. In SGD abgesichert	-	-	-	-	108,43
Klasse C Thes. In USD abgesichert	-	-	-	232,76	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	232,08	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	218,55	-
Klasse C Aussch. In GBP abgesichert	112,10	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5.403,70
Klasse C1 Thes. In CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	122,30	-	124,72	231,57	111,69
Klasse E Thes. In CHF abgesichert	-	-	114,97	-	105,09
Klasse E Thes. In EUR abgesichert	109,33	-	116,12	-	106,22
Klasse E Thes. In GBP abgesichert	-	-	95,12	-	108,93
Klasse E Thes. In SEK abgesichert	-	-	957,02	-	-
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	115,48	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	1.466,04	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	1.148,70	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	1.207,82	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	1.155,77	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	1.546,33	-	-	-
Klasse I Thes.	-	1.675,49	-	-	117,02
Klasse I Thes. In CHF abgesichert	-	1.410,32	-	-	-
Klasse I Thes. In EUR abgesichert	-	1.488,55	-	-	-
Klasse I Thes. In JPY abgesichert	-	10.666,48	-	-	11.961,93
Klasse IF Thes.	-	1.516,63	-	-	-
Klasse IF Thes. In CHF abgesichert	-	1.276,33	-	-	-
Klasse IF Thes. In EUR abgesichert	-	1.347,19	-	-	-
Klasse IF Thes. In SEK abgesichert	-	921,68	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	1.375,72	-	-	-
Klasse IZ Thes. In GBP abgesichert	-	-	-	-	106,94
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	105,72	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	116,64	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. In USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	111,72
Klasse S Aussch. In EUR abgesichert	-	-	-	-	106,28
Klasse S Aussch. In GBP abgesichert	-	-	-	-	109,07
Klasse X Thes.	-	-	-	232,00	-
Klasse X Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	105,63

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

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil*					
zum 31. März 2022					
Klasse A Thes.	-	155,48	-	-	114,70
Klasse A Thes. In CHF abgesichert	-	184,87	-	-	105,40
Klasse A Thes. In EUR abgesichert	-	139,17	-	-	106,51
Klasse A Thes. In GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. In SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. In SGD abgesichert	-	-	-	-	157,86
Klasse A Thes. In USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes. In USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	98,72	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. In CHF abgesichert	97,55	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. In EUR abgesichert	97,76	-	-	-	-
Klasse C Thes.	99,09	162,71	126,13	112,84	117,59
Klasse C Thes. In BRL abgesichert	-	-	-	-	144,42
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	97,98	191,18	112,81	141,22	108,09
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	98,20	145,41	115,22	126,65	109,21
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	98,86	151,89	120,31	-	90,21
Klasse C Thes. In SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. In SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. In USD abgesichert	-	-	-	150,48	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. In GBP abgesichert	-	151,79	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes. In CHF abgesichert	-	-	-	-	5.401,60
Klasse C1 Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	5.462,33
Klasse E Thes.	99,07	174,68	-	-	120,36
Klasse E Thes. In CHF abgesichert	98,06	-	-	-	110,42
Klasse E Thes. In EUR abgesichert	98,32	156,36	-	-	111,58
Klasse E Thes. In GBP abgesichert	98,99	-	-	-	92,34
Klasse E Thes. In SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	99,75	-	-	121,02	-
Klasse I Thes. In CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. In JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. In CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. In SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes. In GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	122,94	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	109,88	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	112,10	123,39	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	147,22	-
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	112,78	-
Klasse R Thes. In EUR abgesichert	-	-	-	126,68	-
Klasse R Thes. In USD abgesichert	-	-	-	150,53	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch. In EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch. In GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	107,76	-	-	-
Klasse X Thes. In EUR abgesichert	-	154,05	-	-	-

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

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Berichtszeitraum zum 31. März 2022

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
ERTRÄGE					
Nettodividenden [^]	5.659	-	-	1.549.764	13.652.296
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	620.666	60.049.870	-	-	417.892
Nettoertrag aus Swaps	1.083.550	-	-	-	-
Bankzinsen	1.748	-	8.841	-	-
Sonstige Erträge	-	40.642	-	25.585	3.985
Erträge insgesamt	1.711.623	60.090.512	8.841	1.575.349	14.074.173
AUFWAND					
Performancegebühren	2.180.464	-	11.590	854.334	118
Managementgebühren	1.260.991	11.450.174	2.633.470	6.596.634	2.521.290
Nettodividendenaufwand [^]	-	-	2.228.467	-	-
Nettoaufwand aus Swaps	-	14.075	1.207.980	1.035.678	435.467
Verwahrstellengebühren	86.329	296.706	52.163	121.823	107.883
Verwaltungsgebühren	347.410	1.814.488	630.590	1.447.868	491.222
Taxe d'abonnement	57.850	98.051	92.087	209.119	153.634
Vertriebsgebühren	-	-	8.831	62.023	-
Bank- und Zinskosten	35.978	37.433	636	280.232	78.439
Sonstige Aufwendungen	72.082	392.604	104.721	1.144.618	218.290
Aufwendungen insgesamt	4.041.104	14.103.531	6.970.535	11.752.329	4.006.343
Abzüglich: Kostenzuschüsse	(59.470)	-	-	-	(4.335)
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	(2.270.011)	45.986.981	(6.961.694)	(10.176.980)	10.072.165

[^] Einschließlich erhaltener/gezahlter Dividenden in Verbindung mit Derivaten mit zugrunde liegenden Aktien.

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Berichtszeitraum zum 31. März 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
ERTRÄGE						
Nettodividenden [^]	-	795.089	248	71.581	747.219	15.375.340
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	798.679	1.672	69.165	105.685	788.528	56.845.475
Nettoertrag aus Swaps	-	-	-	-	-	979.480
Bankzinsen	-	-	-	-	1.167	10.627
Sonstige Erträge	368	317	-	-	8.038	73.811
Erträge insgesamt	799.047	797.078	69.413	177.266	1.544.952	73.284.733
AUFWAND						
Performancegebühren	-	1.695.866	-	-	3.528.640	7.558.676
Managementgebühren	38.987	2.373.895	6.214.961	116.829	2.682.626	33.109.508
Nettodividendenaufwand [^]	-	-	-	-	-	2.014.433
Nettoaufwand aus Swaps	-	825.555	3.997.400	129.046	1.181.946	8.115.402
Verwahrstellengebühren	10.126	41.166	114.121	7.293	113.916	873.905
Verwaltungsgebühren	17.863	474.272	1.349.608	41.286	667.407	6.733.378
Taxe d'abonnement	3.934	70.176	211.254	8.378	110.253	939.736
Vertriebsgebühren	-	-	-	-	3	70.009
Bank- und Zinskosten	1.174	523	213.451	106	76.131	681.501
Sonstige Aufwendungen	5.668	71.725	235.587	8.454	112.129	2.250.979
Aufwendungen insgesamt	77.752	5.553.178	12.336.382	311.392	8.473.051	62.347.527
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	-	-	-	-	(57.677)
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	721.295	(4.756.100)	(12.266.969)	(134.126)	(6.928.099)	10.994.883

* 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 2022 umgerechnet: 1 Euro = 1,10625 US-Dollar und 1 Euro = 0,84212 Pfund Sterling.
[^] Einschließlich erhaltener/gezahlter Dividenden in Verbindung mit Derivaten mit zugrunde liegenden Aktien.

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Veränderung des Nettovermögens für den Berichtszeitraum zum 31. März 2022

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)**	(2.270.011)	45.986.981	(6.961.694)	(10.176.980)	10.072.165
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)					
aus verkauften Wertpapieren	19.608.225	(12.681.214)	(3.043.790)	41.779.165	(22.386.262)
aus Devisenterminkontrakten	(6.697.962)	(114.978.415)	(12.361.675)	(30.933.720)	(30.510.287)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	(1.803.662)	-	-	2.413.963	8.075.291
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Kontrakten	10.418.789	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	(1.821.128)	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	30.907.296	132.629.087
aus Differenzkontrakten	-	-	66.401.569	-	(103.489.940)
aus Optionen und Swaptions	804.257	-	(108.000)	-	(45.480)
aus Devisen	(615.640)	(1.231.578)	(25.188)	3.353.475	(16.938.126)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)	19.892.879	(128.891.207)	50.862.916	47.520.179	(32.665.717)
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)					
aus Anlagen	469.748	(30.983.155)	(62.440.644)	(38.992.030)	(49.664.910)
aus Devisenterminkontrakten	4.833.106	26.973.871	3.213.833	20.218.993	3.566.842
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	5.533.243	-	-	(6.294.437)	(7.368.137)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Kontrakten	(14.456.741)	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Inflationsswaps	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	7.756.334	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	(10.982.366)	(39.831.226)
aus Differenzkontrakten	601.933	-	(35.371.534)	-	31.967.569
aus Optionen und Swaptions	(2.119)	-	-	-	(903.791)
aus Devisen	173.309	497.577	(83.222)	8.753	411.332
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	4.908.813	(3.511.707)	(94.681.567)	(36.041.087)	(61.822.321)
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	22.531.681	(86.415.933)	(50.780.345)	1.302.112	(84.415.873)
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	44.773.000	238.498.699	60.781.645	87.884.358	432.578.358
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(35.294.029)	(160.570.673)	(111.672.549)	(201.913.552)	(378.177.494)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	(460.841)	-	-	-
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Berichtszeitraums	32.010.652	(8.948.748)	(101.671.249)	(112.727.082)	(30.015.009)
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	206.090.340	2.363.039.525	441.703.360	949.465.017	731.532.901
Nennwährungsanpassung***	-	-	-	-	-
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS	238.100.992	2.354.090.777	340.032.111	836.737.935	701.517.892

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

*** Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2021 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 31. März 2022.

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Veränderung des Nettovermögens für den Berichtszeitraum zum 31. März 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirius US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)**	721.295	(4.756.100)	(12.266.969)	(134.126)	(6.928.099)	10.994.883
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	(97.079)	21.441.380	191.517	(719.324)	10.134.213	52.827.346
aus Devisenterminkontrakten	196.179	(3.171.581)	(15.526.939)	(422.792)	6.084.965	(191.404.788)
aus Kassageschäften	-	-	(495.224)	-	-	(447.660)
aus Terminkontrakten	-	-	(878.145)	(145.559)	5.174.875	11.794.434
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	952.557	861.068
aus Credit Default Index-Kontrakten	-	-	(825.124)	-	491.779	9.116.786
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	5.369.989	4.854.227
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	5.205.571	3.059.384
aus Total Return Swaps	-	15.705.957	56.633.350	-	810.041	216.921.704
aus Differenzkontrakten	-	-	-	848.749	-	(32.518.339)
aus Optionen und Swaptions	-	(160.525)	-	(48.531)	(3.145.619)	(2.457.961)
aus Devisen	(61.761)	(1.802.560)	(21.519)	217	2.070.975	(13.482.785)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)	37.339	32.012.671	39.077.916	(487.240)	33.149.346	59.123.416
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)						
aus Anlagen	(1.610.282)	(18.435.132)	(75.123)	(621.669)	(6.416.009)	(192.639.185)
aus Devisenterminkontrakten	99.190	579.412	1.598.592	69.535	1.759.646	58.832.180
aus Kassageschäften	-	-	(3.784)	-	-	(3.421)
aus Terminkontrakten	-	-	6.643.094	(88.610)	570.538	(1.537.523)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(335.270)	(303.069)
aus Credit Default Index-Kontrakten	-	-	237.878	-	(167.277)	(13.004.421)
aus Cross-Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	2.296.641	2.076.060
aus Inflationsswaps	-	-	-	-	(9.030)	(8.163)
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(2.607.060)	4.654.711
aus Total Return Swaps	-	(4.919.030)	28.005.016	-	(964.522)	(26.991.191)
aus Differenzkontrakten	-	-	-	157.768	-	(2.345.564)
aus Optionen und Swaptions	-	(1.497.225)	-	5.889	(1.146.581)	(3.201.790)
aus Devisen	631	(14.554)	396.722	(179)	(7.192.867)	(5.244.406)
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	(1.510.461)	(24.286.529)	36.802.395	(477.266)	(14.211.791)	(179.715.782)
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	(751.827)	2.970.042	63.613.342	(1.098.632)	12.009.456	(109.597.483)
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	11.733.806	22.653.748	46.746.937	9.306.810	131.368.465	993.069.052
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(5.621.082)	(133.183.190)	(178.097.250)	(3.445.741)	(91.064.303)	(1.194.643.123)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	-	-	-	-	(416.580)
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Berichtszeitraums	5.360.897	(107.559.400)	(67.736.971)	4.762.437	52.313.618	(311.588.134)
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	28.626.911	338.622.600	908.388.830	32.208.486	411.679.496	5.674.359.712
Nennwährungsanpassung***	-	-	-	-	-	221.541.231
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS	33.987.808	231.063.200	840.651.859	36.970.923	463.993.114	5.584.312.809

* 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 2022 umgerechnet: 1 Euro = 1,10625 US-Dollar und 1 Euro = 0,84212 Pfund Sterling.

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

*** Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2021 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 31. März 2022.

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen

	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	76,17	91,22	-	-	37,15
Sonstige Wertpapiere					
Werbung	-	-	-	-	-
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	-
Fluggesellschaften	-	-	-	-	-
Bekleidung	-	-	-	0,63	-
Automobilhersteller	-	-	-	-	0,20
Autoteile und -zubehör	-	-	-	-	0,33
Banken	-	-	-	2,70	4,32
Getränke	-	-	-	-	0,49
Biotechnologie	-	-	-	-	0,22
Baustoffe	-	-	-	0,25	0,18
Chemie	-	-	-	3,87	0,92
Kohle	-	-	-	-	-
Gewerbliche Dienstleistungen	-	-	6,19	-	0,45
Computer	-	-	2,39	-	0,88
Vertrieb und Großhandel	-	-	-	-	0,12
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	-	12,14	1,94
Elektrik	-	-	-	-	-
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	1,12
Elektronik	-	-	-	-	1,84
Energie - Alternative Energiequellen	-	-	-	-	1,11
Bau- und Ingenieurwesen	-	-	-	-	-
Unterhaltung	-	-	-	-	-
Umweltschutz	-	-	-	-	0,08
Lebensmittel	-	-	-	-	1,55
Gas	-	-	-	-	-
Gesundheitswesen - Produkte	-	-	-	-	0,56
Gesundheitswesen - Dienstleistungen	-	-	-	4,07	0,62
Holdinggesellschaften - Diversifiziert	-	-	-	-	-
Wohngebäude-Bausträger	-	-	-	3,03	0,04
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	1,21
Haushaltswaren	-	-	-	-	0,47
Versicherungen	-	2,75	-	-	0,78
Internet	-	-	27,32	14,84	0,70
Investmentgesellschaften	-	-	-	1,66	5,58
Eisen und Stahl	-	-	-	-	-
Freizeit	-	-	-	-	0,42
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	0,03
Maschinen - Bau und Bergbau	-	-	-	-	0,14
Maschinen - Diversifiziert	-	-	-	-	0,31
Medien	-	-	6,79	3,17	0,08
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	-
Bergbau	-	-	-	3,17	0,48
Diverse Fertigungsbetriebe	-	-	-	-	0,09
Öl und Gas	-	-	-	-	1,20

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)					
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	-
Verpackung und Container	-	-	-	-	-
Pharmazeutika	-	-	-	-	0,63
Pipelines	-	-	-	-	-
Immobilien	-	-	8,38	0,39	0,70
Einzelhandel	-	-	-	6,60	2,55
Halbleiter	-	-	7,02	6,05	14,51
Software	-	-	27,78	6,80	0,29
Lagerung	-	-	-	-	-
Telekommunikation	-	-	-	-	0,72
Transport	-	-	-	20,46	0,34
Wasser	-	-	-	-	-
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	76,17	93,97	85,87	89,83	85,35
Termineinlagen	-	-	-	-	-
Sonstiges Nettovermögen	23,83	6,03	14,13	10,17	14,65
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	81,88	6,92	20,84	64,64	38,80
Sonstige Wertpapiere					
Werbung	-	-	-	-	0,08
Agrarwirtschaft	-	0,38	-	-	0,18
Fluggesellschaften	-	3,42	-	-	-
Bekleidung	-	-	-	-	-
Automobilhersteller	-	2,12	-	-	0,16
Autoteile und -zubehör	-	1,18	-	-	-
Banken	-	8,17	-	-	5,74
Getränke	-	2,27	-	0,99	-
Biotechnologie	-	-	-	-	2,04
Baustoffe	-	3,16	-	1,11	0,25
Chemie	-	0,46	-	-	0,13
Kohle	-	-	-	-	0,28
Gewerbliche Dienstleistungen	-	9,85	-	2,34	1,35
Computer	-	0,24	-	1,74	0,26
Vertrieb und Großhandel	-	-	-	-	-
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	1,34	-	1,60	1,75
Elektrik	-	-	-	-	1,52
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	0,34
Elektronik	-	1,02	-	2,18	-
Energie - Alternative Energiequellen	-	-	-	-	0,31
Bau- und Ingenieurwesen	-	0,24	-	-	0,67
Unterhaltung	-	-	-	1,60	-
Umweltschutz	-	1,09	-	-	0,12
Lebensmittel	-	-	-	1,34	-
Gas	-	-	-	-	0,16
Gesundheitswesen - Produkte	-	10,74	-	1,68	1,33
Gesundheitswesen - Dienstleistungen	-	0,27	-	-	0,84
Holdinggesellschaften - Diversifiziert	-	-	-	-	0,22
Wohngebäude-Bauträger	-	1,49	-	-	0,15
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	0,01
Haushaltswaren	-	-	-	-	-
Versicherungen	-	-	-	-	3,06
Internet	-	1,01	-	-	1,02
Investmentgesellschaften	-	-	0,59	1,46	0,37
Eisen und Stahl	-	-	-	-	0,18
Freizeit	-	2,76	-	-	0,04
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	0,06
Maschinen - Bau und Bergbau	-	-	-	-	0,12
Maschinen - Diversifiziert	-	-	-	-	0,44
Medien	-	-	-	0,72	-
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	0,08
Bergbau	-	-	-	-	1,11
Diverse Fertigungsbetriebe	-	0,75	-	2,66	0,32

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)					
Öl und Gas	-	-	-	-	5,77
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	2,95	-	-	0,76
Verpackung und Container	-	0,40	-	-	-
Pharmazeutika	-	4,38	-	-	2,38
Pipelines	-	-	-	-	0,58
Immobilien	-	0,17	-	2,39	0,41
Einzelhandel	-	4,34	-	2,83	0,10
Halbleiter	-	8,55	-	-	0,30
Software	-	7,29	-	-	0,10
Lagerung	-	-	-	2,31	-
Telekommunikation	-	2,23	-	-	0,34
Transport	-	0,90	-	-	0,21
Wasser	-	-	-	-	0,21
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	81,88	90,09	21,43	91,59	74,65
Termineinlagen	-	-	19,23	-	-
Sonstiges Nettovermögen	18,12	9,91	59,34	8,41	25,35
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Anlageportfolio zum 31. März 2022

Schroder GAIA BlueTrend

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Vereinigte Staaten				
3.500.000	USD	United States Treasury Note 15/07/22, 1.75%	3.510.989	1,47
8.000.000	USD	United States Treasury Note 15/10/22, 1.38%	8.010.527	3,36
9.000.000	USD	United States Treasury Note 15/11/22, 1.63%	9.020.669	3,79
9.000.000	USD	United States Treasury Note 15/12/22, 1.63%	9.018.246	3,79
6.700.000	USD	United States Treasury Note 15/01/23, 1.50%	6.700.524	2,81
4.300.000	USD	United States Treasury Note 15/02/23, 1.38%	4.292.795	1,80
9.500.000	USD	United States Treasury Note 15/03/23, 0.50%	9.398.022	3,95
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/04/23, 0.25%	9.849.335	4,14
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/05/23, 0.13%	9.814.844	4,12
6.000.000	USD	United States Treasury Note 15/06/23, 0.25%	5.886.211	2,47
9.500.000	USD	United States Treasury Note 15/07/23, 0.13%	9.278.272	3,90
17.500.000	USD	United States Treasury Note 15/08/23, 0.13%	17.051.220	7,16
13.000.000	USD	United States Treasury Note 15/10/23, 0.13%	12.608.223	5,30
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/11/23, 0.25%	9.697.461	4,07
14.500.000	USD	United States Treasury Note 15/12/23, 0.13%	13.999.580	5,88
15.000.000	USD	United States Treasury Note 15/01/24, 0.13%	14.444.824	6,07
10.500.000	USD	United States Treasury Note 15/02/24, 0.13%	10.091.689	4,24
Summe Anleihen			162.673.431	68,32
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			162.673.431	68,32
Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Irland				
110.939.205	USD	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	18.682.162	7,85
Summe Anleihen			18.682.162	7,85
Summe sonstige Wertpapiere			18.682.162	7,85
Summe Kapitalanlagen			181.355.593	76,17
Sonstiges Nettovermögen			56.745.399	23,83
Nettoinventarwert			238.100.992	100,00

Schroder GAIA Cat Bond

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Supranational				
550	USD	Voussoir Re SideCar	57.923.800	2,46
697	USD	Voussoir Re SideCar-Preference	6.921.210	0,29
Summe Aktien			64.845.010	2,75
Anleihen				
Bermuda				
14.963.000	USD	3264 Re 07/02/23, variabel	15.101.408	0,64
36.279.000	USD	Acorn Re 07/11/24, variabel	36.161.092	1,55
9.050.000	USD	Alamo Re 08/06/22, variabel	9.109.278	0,39
10.263.000	USD	Baldwin Re 07/07/25, variabel	10.278.395	0,44
2.667.000	USD	Blue Halo Re Series A 24/02/25, variabel	2.677.001	0,11
3.500.000	USD	Blue Halo Re Series A 24/02/25, variabel	3.481.275	0,15
24.400.000	USD	Bowline Re Series 2018-1 23/05/22, variabel	24.550.059	1,04
4.750.000	USD	Bowline Re Series 2019-1A 20/03/23, variabel	4.791.563	0,20
14.350.000	USD	Bowline Re Series 2019-1B 20/03/23, variabel	14.369.373	0,61
133	USD	Eden Re II 22/03/23, ZCP	2.811	-
1.800.000	USD	Eden Re II 22/03/24, ZCP	764.550	0,03
1.100.000	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	1.125.300	0,05
24.512.000	USD	Everglades Re II Series A1 14/05/24, variabel	24.489.938	1,04
28.750.000	USD	Everglades Re II Series A2 14/05/24, variabel	28.701.124	1,22
19.250.000	USD	Everglades Re II Series B1 14/05/24, variabel	19.147.975	0,81
6.500.000	USD	FloodSmart Re Series A 27/02/23, variabel	6.472.700	0,27
9.750.000	USD	FloodSmart Re Series B 27/02/23, variabel	9.544.275	0,41
7.917.000	USD	Four Lakes Re 07/01/25, variabel	7.883.353	0,33
4.700.000	USD	Galileo Re Series C 08/01/24, variabel	4.666.160	0,20
3.750.000	USD	Galileo Re Series D 08/01/24, variabel	3.750.375	0,16
2.400.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	2.468.640	0,10
5.000.000	USD	Integrity Re 12/06/23, variabel	5.032.250	0,21
7.750.000	USD	Integrity Re II 12/04/23, variabel	7.851.719	0,33
4.750.000	USD	Kilimanjaro II Re 21/04/22, variabel	4.764.013	0,20

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
5.350.000	USD	Kilimanjaro II Re Series * 21/04/22, variabel	5.365.248	0,23	8.884.000	USD	Phoenician Re 14/12/23, variabel	8.974.617	0,38
17.450.000	USD	Kilimanjaro II Re Series ** 21/04/22, variabel	17.499.733	0,74	23.029.000	USD	Phoenician Re Series A 14/12/23, variabel	23.268.501	0,99
12.000.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A1 19/12/23, variabel	11.635.800	0,49	5.000.000	USD	Power Protective Re 15/12/23, variabel	5.009.000	0,21
10.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/23, variabel	10.315.088	0,44	2.250.000	USD	Power Protective Re 09/10/24, variabel	2.254.838	0,10
5.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variabel	5.114.288	0,22	23.000.000	USD	Riverfront Re Series A 07/01/25, variabel	23.064.399	0,98
9.087.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variabel	9.193.772	0,39	5.750.000	USD	Riverfront Re Series B 07/01/25, variabel	5.761.500	0,24
3.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B1 21/04/25, variabel	3.727.500	0,16	2.800.000	USD	Sanders Re 07/04/22, variabel	2.716.000	0,12
4.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C1 21/04/25, variabel	4.767.100	0,20	9.632.224	USD	Sanders Re II 07/04/23, variabel	265.849	0,01
10.464.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A2 20/04/26, variabel	10.448.304	0,44	5.270.000	USD	Sanders Re II 07/06/23, variabel	5.359.854	0,23
4.000.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B2 20/04/26, variabel	4.024.400	0,17	9.625.000	USD	Sanders Re II 07/04/24, variabel	9.733.041	0,41
3.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C2 20/04/26, variabel	3.773.625	0,16	7.917.000	USD	Sanders Re II Series A 07/04/25, variabel	7.918.188	0,34
4.950.000	USD	Kilimanjaro Re Series A1 06/05/22, variabel	4.974.503	0,21	16.447.000	USD	Sanders Re II Series A1 07/04/25, variabel	16.348.318	0,69
19.850.000	USD	Kilimanjaro Re Series B1 06/05/22, variabel	19.946.273	0,85	11.050.000	USD	Sanders Re III Series A 07/04/26, variabel	11.050.000	0,47
6.000.000	USD	Kilimanjaro Re Series A2 05/05/23, variabel	5.813.100	0,25	8.750.000	USD	Sanders Re III Series B 07/04/26, variabel	8.750.000	0,37
17.600.000	USD	Kilimanjaro Re Series B2 05/05/23, variabel	17.437.200	0,74	6.500.000	USD	Sutter Re Series A 06/06/22, variabel	6.530.225	0,28
1.750.000	USD	Manatee Re III Series A 07/06/22, variabel	350.000	0,01	11.250.000	USD	Sutter Re Series A 23/05/23, variabel	11.283.188	0,48
1.750.000	USD	Manatee Re III Series B 07/06/22, variabel	6.563	-	7.000.000	USD	Sutter Re Series F 06/06/22, variabel	7.043.050	0,30
27.012.000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/22, variabel	27.084.931	1,15	10.800.000	USD	Sutter Re Series F 23/05/23, variabel	10.818.900	0,46
25.602.000	USD	Merna Reinsurance II 08/07/24, variabel	26.023.152	1,11	5.256.000	USD	Tailwind Re Series A 08/01/25, variabel	5.257.314	0,22
13.950.000	USD	Mona Lisa Re Series A 09/01/23, variabel	13.984.178	0,59	7.958.000	USD	Tailwind Re Series B 08/01/25, variabel	7.979.885	0,34
11.714.000	USD	Mona Lisa Re Series B 09/01/23, variabel	11.742.699	0,50	5.152.000	USD	Tailwind Re Series C 08/01/25, variabel	5.141.954	0,22
9.000.000	USD	Montoya Re 07/04/25, variabel	9.000.000	0,38	250.000	USD	Tailwind Re Series D 08/01/25, variabel	248.338	0,01
30.000.000	USD	Mystic Re IV 08/01/24, variabel	30.523.499	1,30	9.500.000	USD	Titania Re 21/06/24, variabel	9.516.625	0,40
15.690.000	USD	Nakama Re 14/01/25, variabel	15.774.726	0,67	9.857.000	USD	Titania Re 27/12/24, variabel	9.859.464	0,42
45.420.000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	45.494.942	1,94	3.750.000	USD	Tomoni Re 07/04/26, variabel	3.750.000	0,16
19.000.000	USD	Northshore Re II 08/07/22, variabel	19.151.050	0,81	1.384.000	USD	Voussoir Re 01/03/24, variabel	394.302	0,02
14.880.000	USD	Northshore Re II 07/07/23, variabel	15.172.392	0,64	1.460.000	USD	Voussoir Re perpetual, variabel	152.205	0,01
13.462.000	USD	Northshore Re II 08/01/24, variabel	13.670.661	0,58	3.500.000	USD	Wrigley Re 08/07/24, variabel	3.507.525	0,15

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens		
Hongkong					Anleihen						
3.000.000	USD	Greater Bay Re 15/10/22, ZCP	2.943.750	0,13	Bermuda						
					7.308.000	USD	2001 Cat Re 08/01/24, variabel	7.422.370	0,32		
					21.900.000	USD	Akibare Re Series A 07/04/22, variabel	21.889.050	0,93		
Irland					8.000.000	USD	Akibare Re Series B 07/04/22, variabel	8.024.000	0,34		
9.856.000	EUR	Azzurro Re II DAC 17/01/24, variabel	11.012.232	0,47	39.726.000	USD	Alamo Re 07/06/24, variabel	40.012.026	1,69		
10.966.000	EUR	Hexagon II Reinsurance DAC 17/01/24, variabel	12.191.793	0,52	9.250.000	USD	Armor Re II 08/06/22, variabel	9.329.088	0,40		
Singapur					2.450.000	USD	Artex 17/01/25, variabel	2.254.000	0,10		
17.250.000	USD	Alamo Re II 08/06/23, variabel	17.297.437	0,73	19.855.000	USD	Bonanza Re 20/02/24, variabel	19.953.282	0,85		
9.783.000	USD	Easton Re 08/01/24, variabel	9.795.229	0,42	18.246.000	USD	Bonanza Re 23/12/24, variabel	18.303.475	0,78		
6.750.000	USD	Kizuna Re III 07/04/26, variabel	6.753.375	0,29	12.250.000	USD	Bonanza Re 16/03/25, variabel	12.274.500	0,52		
4.012.000	USD	Phoenix 1 Re 04/01/27, ZCP	4.304.876	0,18	7.500.000	USD	Cape Lookout Re 09/05/22, variabel	7.551.375	0,32		
Supranational					24.917.000	USD	Cape Lookout Re 22/03/24, variabel	24.921.982	1,06		
3.450.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 02/12/22, variabel	3.480.360	0,15	10.000.000	USD	Cape Lookout Re 28/03/25, variabel	10.036.500	0,43		
9.620.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 02/12/22, variabel	9.379.500	0,40	816.477	USD	Citrus Re 20/03/23, variabel	236.084	0,01		
18.500.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 29/12/23, variabel	18.420.449	0,77	199	USD	Eden Re II 22/03/23, ZCP	1.755	-		
3.697.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 13/03/24, variabel	3.744.691	0,16	2.160.000	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP	1.840.320	0,08		
5.550.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 13/03/24, variabel	5.577.750	0,24	4.860.000	USD	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP	4.203.900	0,18		
6.700.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series C 13/03/24, variabel	6.753.098	0,29	16.300.000	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	16.642.300	0,71		
4.750.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series D 13/03/24, variabel	4.866.613	0,21	11.000.000	USD	Everglades Re II 04/05/23, variabel	10.700.250	0,45		
Vereinigtes Königreich					31.404.000	USD	FloodSmart Re Series A 01/03/24, variabel	31.137.065	1,31		
18.450.000	USD	Atlas Capital UK 2019 07/06/23, variabel	19.032.098	0,81	5.625.000	USD	FloodSmart Re Series B 01/03/24, variabel	5.371.031	0,23		
Summe Anleihen					20.020.000	USD	FloodSmart Re Series A 25/02/25, variabel	19.992.973	0,85		
					9.250.000	USD	FloodSmart Re Series B 25/02/25, variabel	9.231.038	0,39		
					2.250.000	USD	FloodSmart Re Series C 25/02/25, variabel	2.243.363	0,10		
					20.100.000	USD	Frontline Re Series A 06/07/22, variabel	17.386.500	0,74		
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind					956.709.685	40,64	555.282	USD	Frontline Re Series B 06/07/22, variabel	13.938	-
					2.500.000	USD	Herbie Re 06/01/23, variabel	2.530.625	0,11		
					7.000.000	USD	Herbie Re 08/07/24, variabel	7.000.000	0,30		

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
3.833.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	3.929.783	0,17	3.500.000	USD	Sierra Series B 31/01/24, variabel	3.475.150	0,15
5.114.000	USD	Hypatia Series A 07/06/23, variabel	5.269.977	0,22	4.750.000	USD	Tomoni Re 07/04/26, variabel	4.750.000	0,20
379.000	USD	Hypatia Series B 07/06/23, variabel	394.691	0,02	3.750.000	USD	Topanga Re 08/01/26, variabel	3.726.563	0,16
6.450.000	USD	Integrity Re 10/06/22, variabel	6.483.863	0,28	20.000.000	USD	Torrey Pines Re Series A 07/06/24, variabel	19.970.000	0,85
6.000.000	USD	Isosceles Insurance 10/07/23, variabel	5.970.000	0,25	19.250.000	USD	Torrey Pines Re Series B 07/06/24, variabel	19.323.150	0,82
7.857.000	USD	Kilimanjaro III Re 21/04/25, variabel	7.837.358	0,33	22.982.000	USD	Ursa Re 10/12/22, variabel	23.137.129	0,98
7.500.000	USD	Matterhorn Re 08/01/24, variabel	7.186.500	0,31	41.725.000	USD	Ursa Re II Series AA 07/12/23, variabel	41.683.274	1,76
13.118.000	USD	Matterhorn Re Series A 07/12/22, variabel	13.071.431	0,56	9.500.000	USD	Ursa Re II Series D 07/12/23, variabel	9.490.500	0,40
14.250.000	USD	Matterhorn Re Series B 07/12/22, variabel	14.173.763	0,60	21.366.000	USD	Ursa Re II 06/12/24, variabel	21.015.598	0,89
9.500.000	USD	Matterhorn Re Series A 24/03/25, variabel	9.519.000	0,40	Kaimaninseln			219.266.271	9,31
9.250.000	USD	Matterhorn Re Series B 24/03/25, variabel	9.268.500	0,39	1.092.500	USD	Caelus Re V Series B 05/06/24, variabel	823.472	0,03
14.250.000	USD	Matterhorn Re 08/12/25, variabel	14.205.113	0,60	6.600.000	USD	Caelus Re V Series C 05/06/24, variabel	957.000	0,04
19.000.000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/23, variabel	19.133.000	0,81	132.536	USD	Caelus Re V Series D 05/06/24, variabel	1.352	-
23.090.000	USD	Merna Reinsurance II 05/04/24, variabel	23.330.136	0,99	6.350.000	USD	Caelus Re VI 07/06/23, variabel	6.459.220	0,27
6.000.000	USD	MetroCat Re 08/05/23, variabel	6.034.800	0,26	13.050.000	USD	Caelus Re VI 07/06/24, variabel	13.425.839	0,57
20.000.000	USD	Mona Lisa Re 08/07/25, variabel	19.978.000	0,85	49.250.000	USD	Long Point Re III 01/06/22, variabel	49.410.062	2,11
16.952.000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	17.007.094	0,72	11.975.000	USD	Residential Reinsurance 2018 06/12/22, variabel	11.745.679	0,50
34.150.000	USD	Nakama Re Series 1 13/04/23, variabel	33.851.187	1,43	15.400.000	USD	Residential Reinsurance 2018 Series 13 06/06/22, variabel	15.322.229	0,65
12.200.000	USD	Nakama Re Series 2 13/04/23, variabel	12.254.290	0,52	7.062.000	USD	Residential Reinsurance 2019 06/12/23, variabel	6.919.701	0,29
7.500.000	USD	Pelican IV Re Series A 07/05/24, variabel	1.125.750	0,05	4.000.000	USD	Residential Reinsurance 2019 Series 12 06/06/23, variabel	3.860.000	0,16
4.750.000	USD	Pelican IV Re Series B 07/05/24, variabel	4.298.750	0,18	2.250.000	USD	Residential Reinsurance 2019 Series 13 06/06/23, variabel	2.236.613	0,10
23.250.000	USD	Phoenician Re 14/12/24, variabel	23.188.388	0,99	6.154.000	USD	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variabel	6.175.231	0,26
19.872.000	USD	Sakura Re Series A 07/04/25, variabel	19.909.757	0,85	5.484.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variabel	5.485.371	0,23
17.292.000	USD	Sakura Re Series B 07/04/25, variabel	17.603.256	0,75	5.000.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variabel	5.081.250	0,22
3.750.000	USD	Sierra Series A 28/12/22, variabel	3.732.188	0,16	4.250.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 11 06/06/25, variabel	4.203.250	0,18
2.750.000	USD	Sierra Series B 28/12/22, variabel	2.761.138	0,12					
14.500.000	USD	Sierra Series A 31/01/24, variabel	14.318.750	0,61					

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
5.535.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 12 06/06/25, variabel	5.479.650	0,23
4.642.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 13 06/06/25, variabel	4.597.901	0,20
6.500.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 14 06/06/25, variabel	6.418.750	0,27
14.416.667	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 2 06/12/25, variabel	14.335.212	0,61
3.810.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 3 06/12/25, variabel	3.805.238	0,16
5.250.000	USD	Vitality Re X Series A 10/01/23, variabel	5.222.963	0,22
4.750.000	USD	Vitality Re X Series B 10/01/23, variabel	4.679.938	0,20
9.117.000	USD	Vitality Re XI Series A 09/01/24, variabel	8.953.350	0,38
3.500.000	USD	Vitality Re XI Series B 09/01/24, variabel	3.443.125	0,15
12.044.000	USD	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variabel	12.055.442	0,51
6.000.000	USD	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variabel	5.993.100	0,25
8.148.000	USD	Vitality Re XIII Series A 06/01/26, variabel	8.166.333	0,35
4.000.000	USD	Vitality Re XIII Series B 06/01/26, variabel	4.009.000	0,17
Irland			65.688.603	2,80
16.000.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variabel	16.776.800	0,71
6.957.000	EUR	Hexagon III Re 15/01/26, variabel	7.734.662	0,33
5.000.000	EUR	Hexagon III Re Series CAT 15/01/26, variabel	5.572.734	0,24
20.000.000	EUR	Lion III Re DAC 16/07/25, variabel	22.219.031	0,95
4.250.000	EUR	Orange Capital Re DAC 17/01/25, variabel	4.466.484	0,19
8.269.000	EUR	Windmill II Re DAC 05/07/24, variabel	8.918.892	0,38
Singapur			33.304.656	1,41
4.000.000	USD	Astro Re 08/07/25, variabel	3.992.600	0,17
6.000.000	USD	Catahoula Re 09/05/23, variabel	22.500	-
6.315.000	USD	Cosaint Re 03/04/24, variabel	6.397.095	0,27
9.966.000	USD	First Coast Re III 07/04/25, variabel	9.942.579	0,42
3.000.000	USD	Phoenix 2 Re 04/01/28, ZCP	3.032.100	0,13

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
250.000	USD	Phoenix 2 Re Series 22-1 04/01/28, ZCP	261.450	0,01
5.000.000	USD	Umigame Re Series A1 07/04/25, variabel	5.006.750	0,21
2.750.000	USD	Umigame Re Series A2 07/04/25, variabel	2.763.613	0,12
1.875.000	USD	Umigame Re Series B1 07/04/25, variabel	1.885.969	0,08
Vereinigtes Königreich			51.957.806	2,21
28.725.000	USD	Atlas Capital UK 2018 07/06/22, variabel	28.803.993	1,23
22.750.000	USD	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variabel	23.153.813	0,98
Vereinigte Staaten			28.918.243	1,23
6.250.000	USD	Logistics Re 20/12/24, variabel	6.266.563	0,27
8.307.000	USD	Putnam Re 07/06/24, variabel	8.374.287	0,36
1.500.000	USD	Security First Managers 25/02/25, variabel	1.500.000	0,06
12.803.000	USD	Vista Re 21/05/24, variabel	12.777.393	0,54
Summe Anleihen			1.172.046.196	49,79
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			1.172.046.196	49,79

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Vereinigte Staaten			18.590.228	0,79
14.314.131	USD	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5.96%	15.159.560	0,64
2.400	USD	LionRock SideCar 2020- 1C perpetual, ZCP	-	-
4.342.618	USD	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP	3.430.668	0,15
Summe Anleihen			18.590.228	0,79
Summe sonstige Wertpapiere			18.590.228	0,79
Summe Kapitalanlagen			2.212.191.119	93,97
Sonstiges Nettovermögen			141.899.658	6,03
Nettoinventarwert			2.354.090.777	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Israel			2.237.183	0,66
148.256	USD	WalkMe	2.237.183	0,66
Vereinigte Staaten			289.753.986	85,21
1.146.000	USD	Avaya Holdings	14.519.820	4,27
5.794	USD	Booking Holdings	13.606.919	4,00
465.157	USD	Cargurus	19.750.566	5,81
1.189.000	USD	CCC Intelligent Solutions Holdings	13.126.560	3,86
66.926	USD	Coupa Software	6.801.689	2,00
161.598	USD	Dell Technologies	8.110.604	2,39
152.949	USD	Five9	16.885.570	4,97
275.200	USD	Green Dot	7.562.496	2,22
94.151	USD	Legalzoom.com	1.331.295	0,39
193.863	USD	Marvell Technology	13.901.916	4,09
526.392	USD	Momentive Global	8.559.134	2,52
9.000	USD	Netflix	3.371.310	0,99
326.000	USD	New Relic	21.802.880	6,41
1.042.523	USD	News	23.091.885	6,79
720.000	USD	Outfront Media	20.469.600	6,02
80.330	USD	Qorvo	9.968.953	2,93
444.503	USD	Redfin	8.018.834	2,36
192.471	USD	Smartsheet	10.543.561	3,10
559.145	USD	Toast	12.150.221	3,57
477.988	USD	TripAdvisor	12.963.035	3,81
326.348	USD	Twitter	12.626.404	3,71
97.260	USD	Zendesk	11.699.405	3,44
383.269	USD	Zillow Group	18.891.329	5,56
Summe Aktien			291.991.169	85,87
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			291.991.169	85,87
Summe Kapitalanlagen			291.991.169	85,87
Sonstiges Nettovermögen			48.040.942	14,13
Nettoinventarwert			340.032.111	100,00

Schroder GAIA Egerton Equity

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Kanada			136.379.283	16,30
414.071	CAD	Canadian National Railway	50.210.259	6,00
1.087.917	CAD	Canadian Pacific Railway	81.166.323	9,70
137.020	USD	Teck Resources	5.002.701	0,60
Norwegen			7.852.466	0,94
888.237	NOK	Norsk Hydro	7.852.466	0,94
Taiwan			13.674.463	1,63
726.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	13.674.463	1,63
Vereinigtes Königreich			32.382.189	3,87
112.146	USD	Linde	32.382.189	3,87
Vereinigte Staaten			561.365.714	67,09
167.699	USD	Alcoa	13.647.856	1,63
28.232	USD	Alphabet	71.278.368	8,52
14.377	USD	Amazon.com	42.366.826	5,06
171.843	USD	Analog Devices	25.658.781	3,07
94.881	USD	Applied Materials	11.304.240	1,35
575.316	USD	Bath & Body Works	24.858.852	2,97
113.265	USD	Blackstone Mortgage Trust	3.254.865	0,39
7.524	USD	Blackstone Secured Lending Fund	189.622	0,02
439.003	USD	Charles Schwab	33.457.485	4,00
53.828	USD	Charter Communications	26.543.955	3,17
1.175.229	USD	CSX	39.785.153	4,75
346.735	USD	DR Horton	23.353.876	2,79
37.504	USD	First Citizens BancShares	22.565.119	2,70
259.901	USD	KKR	13.736.869	1,64
161.860	USD	Lowe's	29.583.253	3,54
79.093	USD	LPL Financial Holdings	13.060.980	1,56
45.605	USD	Mastercard	14.732.940	1,76
204.282	USD	Microsoft	56.933.047	6,80
498	USD	NVR	2.011.029	0,24
75.775	USD	PVH	5.247.569	0,63
323.339	USD	Snap	10.519.295	1,26
3.879	USD	Tractor Supply	818.298	0,10
73.920	USD	UnitedHealth Group	34.076.368	4,07
201.017	USD	Visa	40.297.889	4,82
12.545	USD	Vulcan Materials	2.083.179	0,25
Summe Aktien			751.654.115	89,83
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			751.654.115	89,83
Summe Kapitalanlagen			751.654.115	89,83
Sonstiges Nettovermögen			85.083.820	10,17
Nettoinventarwert			836.737.935	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Helix

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Australien			325.866	0,05
1.624	AUD	CSL	325.866	0,05
Belgien			861.182	0,12
35.385	EUR	Azelis Group	861.182	0,12
Brasilien			15.524.980	2,21
516.800	BRL	B3 - Brasil Bolsa Balcao	1.705.281	0,24
63.242	BRL	Banco do Brasil	460.927	0,07
276.607	BRL	BR Malls Participacoes	539.149	0,08
46.094	USD	Itau Unibanco Holding	263.197	0,04
2.201.685	BRL	Itausa	4.971.196	0,71
400.283	BRL	Lojas Renner	2.312.049	0,33
1.048.700	BRL	Raia Drogasil	5.273.181	0,74
Kanada			1.752	-
730	CAD	Loop Energy	1.752	-
Chile			3.678.754	0,52
445.299	CLP	Empresas COPEC	3.678.754	0,52
China			48.126.052	6,86
13.629	CNH	Advanced Micro-Fabrication Equipment	249.738	0,04
204.200	HKD	Baozun	594.355	0,08
387.800	HKD	Budweiser Brewing	1.032.212	0,15
229.073	CNH	China Jushi	549.338	0,08
425.000	HKD	China Mengniu Dairy	2.289.584	0,33
81.000	CNH	China Tourism Group Duty Free	2.095.022	0,30
51.598	CNH	Contemporary Amperex Technology	4.159.472	0,59
76.900	CNH	Foshan Haitian Flavouring & Food	1.057.836	0,15
70.310	CNH	Gongniu Group	1.420.793	0,20
702.875	CNH	Huafon Chemical	1.007.575	0,14
6.552	USD	Huazhu Group	216.150	0,03
104	HKD	JD.com	3.107	-
254.420	CNH	Jiangsu Hengrui Medicine	1.474.063	0,21
43.061	USD	JinkoSolar Holding	2.079.416	0,30
8.900	CNH	Kweichow Moutai	2.407.393	0,34
504.680	CNH	LONGi Green Energy Technology	5.732.896	0,82
792.649	CNH	Midea Group	7.109.462	1,02
259.400	CNH	NARI Technology	1.285.357	0,18
75.385	CNH	Oppein Home Group	1.387.880	0,20
306.100	CNH	Ping An Insurance Group of China	2.333.663	0,33

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
350.100	CNH	Sany Heavy Industry	965.178	0,14
84.600	CNH	SF Holding	608.370	0,09
53.700	CNH	Shanghai Baolong Automotive	345.857	0,05
200.936	CNH	Shanghai Kelai Mechatronics Engineering	620.984	0,09
81.677	CNH	Shenzhen Kangtai Biological Products	1.198.477	0,17
2.200	HKD	Tencent Holdings	105.095	0,01
117.462	CNH	Thunder Software Technology	1.833.539	0,26
291.300	CNH	Toly Bread	922.252	0,13
55.900	CNH	WuXi AppTec	988.512	0,14
77.200	CNH	Yunnan Baiyao Group	993.935	0,14
115.890	CNH	Zhejiang Jiechang Linear Motion Technology	536.500	0,08
322.500	HKD	Zylox-Tonbridge Medical Technology	522.041	0,07
Ägypten			978.010	0,14
417.953	USD	Commercial International Bank Egypt	978.010	0,14
Griechenland			3.798.856	0,54
373.350	EUR	Alpha Services & Holdings	460.929	0,07
899.623	EUR	National Bank of Greece	3.337.927	0,47
Ungarn			2.222.861	0,32
6.737	HUF	OTP Bank	246.381	0,04
93.500	HUF	Richter Gedeon	1.976.480	0,28
Indonesien			9.458.087	1,35
5.404.000	IDR	Bank Central Asia	3.000.654	0,43
11.033.900	IDR	Bank Mandiri Persero	6.069.126	0,86
1.217.700	IDR	Telkom Indonesia Persero	388.307	0,06
Italien			11.369.054	1,62
4.672	EUR	DiaSorin	733.396	0,10
296.781	EUR	Eni	4.364.605	0,63
62.742	EUR	GVS	571.925	0,08
556.374	EUR	Intesa Sanpaolo	1.282.371	0,18
16.562	EUR	Moncler	929.644	0,13
39.626	EUR	Prysmian	1.357.171	0,19
195.370	EUR	UniCredit	2.129.942	0,31
Japan			480.192	0,07
28.200	JPY	WealthNavi	480.192	0,07
Kasachstan			2.105.425	0,30
211.176	USD	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	2.105.425	0,30

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Mexiko			666.968	0,10
61.626	USD	Banco Santander Mexico Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	322.920	0,05
37.849	USD	Vista Oil & Gas SAB de CV	344.048	0,05
Peru			372.829	0,05
10.791	USD	Intercorp Financial Services	372.829	0,05
Philippinen			3.993.785	0,57
1.084.020	PHP	Ayala Land	734.272	0,10
277.290	PHP	International Container Terminal Services	1.204.653	0,17
3.938.100	PHP	Wilcon Depot	2.054.860	0,30
Polen			812.717	0,12
47.102	PLN	Grupa Pracuj	706.236	0,10
1.434	PLN	KRUK	106.481	0,02
Katar			1.810.093	0,26
1.841.315	QAR	Qatar Gas Transport	1.810.093	0,26
Russland			-	-
262.653	USD	Fix Price Group	-	-
62.454	USD	Softline Holding	-	-
Slowenien			3.767.218	0,54
248.569	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	3.767.218	0,54
Südafrika			7.767.623	1,11
149.613	ZAR	Bid	3.256.111	0,46
21.507	ZAR	Capitec Bank Holdings	3.446.346	0,50
96.138	ZAR	Tiger Brands	1.065.166	0,15
Südkorea			53.224.947	7,59
9.128	KRW	Hana Financial Group	366.009	0,05
66.407	KRW	Hankook Tire & Technology	1.843.650	0,26
8.118	KRW	KB Financial Group	410.572	0,06
6.909	KRW	Korea Zinc	3.334.652	0,48
8.987	KRW	LG Chem	3.944.626	0,56
702	KRW	LG Chem - Preference	158.117	0,02
434	KRW	LG Energy Solution	158.267	0,02
95.415	KRW	LG Uplus	1.102.108	0,16
14.920	KRW	NAVER	4.191.461	0,60
363.850	KRW	Samsung Electronics	20.893.494	2,98
154.485	KRW	Samsung Electronics - Preference	8.029.830	1,14
17.341	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	3.133.269	0,45
5.713	KRW	Samsung SDI	2.809.247	0,40

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
25.042	KRW	SK Hynix	2.437.982	0,35
8.769	KRW	SK Telecom	411.663	0,06
Schweiz			3.376.347	0,48
714.199	ZAR	Mediclinic International	3.376.347	0,48
Taiwan			96.412.407	13,73
41.000	TWD	Accton Technology	318.395	0,05
187.792	TWD	Advantech	2.421.833	0,35
914.000	TWD	ASE Technology Holding	3.301.712	0,47
262.000	TWD	Chroma ATE	1.645.987	0,23
302.000	TWD	CTBC Financial Holding	309.890	0,04
45.250	TWD	Dadi Early-Childhood Education Group	190.309	0,03
249.000	TWD	Delta Electronics	2.333.438	0,33
369.000	TWD	Formosa Plastics	1.371.604	0,20
984.000	TWD	Getac Holdings	1.708.602	0,24
94.000	TWD	Giant Manufacturing	854.650	0,12
5.990	TWD	Hiwin Technologies	50.175	0,01
926.000	TWD	Hon Hai Precision Industry	3.425.859	0,49
327.000	TWD	MediaTek	10.328.779	1,46
120.000	TWD	Mega Financial Holding	179.676	0,03
234.000	TWD	Merida Industry	2.066.279	0,29
281.000	TWD	Nien Made Enterprise	3.300.229	0,47
183.000	TWD	Novatek Microelectronics	2.724.098	0,39
114.000	TWD	Simplo Technology	1.235.433	0,18
190.750	TWD	Sporton International	1.254.956	0,18
2.451.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	51.070.520	7,27
245.000	TWD	Uni-President Enterprises	560.948	0,08
779.000	TWD	United Microelectronics	1.468.195	0,21
97.000	TWD	Universal Vision Biotechnology	946.251	0,13
293.000	TWD	Vanguard International Semiconductor	1.273.179	0,18
40.650	TWD	Voltronic Power Technology	2.071.410	0,30
Thailand			6.157.543	0,88
561.600	THB	Kasikornbank	2.727.771	0,39
643.200	THB	Kasikornbank-XDR	3.124.115	0,45
1.069.800	THB	Land & Houses	305.657	0,04
Türkei			1.501.373	0,21
239.574	TRY	Sok Marketler Ticaret	203.948	0,03
244.515	TRY	Tofas Turk Otomobil Fabrikasi	1.297.425	0,18

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Vereinigte Arabische Emirate			789.096	0,11
483.065	AED	Emaar Properties	789.096	0,11
Vereinigtes Königreich			21.440.587	3,06
311.234	GBP	Bytes Technology Group	2.035.268	0,29
18.532	EUR	CNH Industrial	295.112	0,04
138.780	GBP	Gresham House	1.695.468	0,24
1.204.271	GBP	Harworth Group	2.815.943	0,40
362.669	GBP	Inspecc Group	1.738.933	0,25
236.758	GBP	LBG Media	575.382	0,08
288.402	PLN	Pepco Group	3.072.948	0,45
994.993	GBP	Premier Foods	1.490.063	0,21
66.937	GBP	Rathbones Group	1.741.049	0,25
78.210	GBP	Science in Sport	59.076	0,01
946.319	GBP	TT Electronics	2.554.636	0,36
298.830	GBP	Tyman	1.248.334	0,18
141.455	GBP	Watches of Switzerland Group	2.118.375	0,30
Vereinigte Staaten			4.600.060	0,66
6.342	USD	Mastercard	2.266.503	0,32
7.293	EUR	Stellantis	119.405	0,02
9.984	USD	Visa	2.214.152	0,32
Summe Aktien			305.624.664	43,57
Anleihen				
Angola			342.592	0,05
340.000	USD	Angolan Government International Bond 26/11/29, 8.00%	342.592	0,05
Argentinien			611.893	0,09
830.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 1.13%	253.075	0,04
423.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/01/38, 2.00%	158.963	0,02
354.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/41, 2.50%	124.417	0,02
241.741	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/46, 1.13%	75.438	0,01
Brasilien			2.037.929	0,28
4.336.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10.00%	873.443	0,12
5.890.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/31, 10.00%	1.164.486	0,16

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
China			225.475	0,03
290.000	USD	Country Garden Holdings 08/04/26, 7.25%	225.475	0,03
Ecuador			545.776	0,08
630.319	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/35, 1.00%	413.811	0,06
230.000	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/40, 0.50%	131.965	0,02
Ungarn			138.742	0,02
50.660.000	HUF	Hungary Government Bond 24/11/32, 4.75%	138.742	0,02
Indonesien			750.811	0,11
6.100.000.000	IDR	Indonesia Treasury Bond 15/09/30, 7.00%	432.749	0,07
1.200.000.000	IDR	Indonesia Treasury Bond 15/06/36, 6.25%	80.941	0,01
2.960.000.000	IDR	Indonesia Treasury Bond 15/02/44, 8.75%	237.121	0,03
Elfenbeinküste			482.827	0,07
470.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5.88%	482.827	0,07
Mexiko			1.421.299	0,20
4.300.000	MXN	Mexican Bonos 18/11/38, 8.50%	219.724	0,03
3.310.000	MXN	Mexican Bonos 18/11/42, 7.75%	155.242	0,02
13.750.000	MXN	Mexican Bonos 12/11/47, 8.00%	659.669	0,09
3.800.000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/09/24, 7.19%	179.785	0,03
4.600.000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/11/26, 7.47%	206.879	0,03
Nigeria			354.158	0,05
350.000	USD	Nigeria Government International Bond 24/03/29, 8.38%	354.158	0,05
Peru			403.928	0,06
1.540.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/32, 6.15%	403.928	0,06
Polen			237.903	0,03
1.350.000	PLN	Republic of Poland Government Bond 25/10/30, 1.25%	237.903	0,03
Russland			-	-
38.000.000	RUB	Russian Federal Bond - OFZ 23/03/33, 7.70%	-	-
Südafrika			1.654.335	0,24
6.480.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/30, 8.00%	405.186	0,06

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
3.900.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	238.417	0,03
10.690.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	657.640	0,10
5.900.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/40, 9.00%	353.092	0,05
Türkei			823.635	0,12
470.000	USD	Pegasus Hava Tasimaciligi 30/04/26, 9.25%	464.125	0,07
350.000	USD	Turkey Government International Bond 24/09/27, 8.60%	359.510	0,05
Ukraine			200.272	0,03
3.000.000	UAH	Ukraine Government Bond 22/05/24, 9.99%	32.521	-
6.460.000	UAH	Ukraine Government Bond 26/02/25, 15.84%	72.095	0,01
8.190.000	UAH	Ukraine Government Bond 26/05/27, 9.79%	95.656	0,02
Summe Anleihen			10.231.575	1,46
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			315.856.239	45,03

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen				
Vereinigtes Königreich			481.060	0,07
525.000	USD	Petrofac 15/11/26, 9.75%	481.060	0,07
Vereinigte Staaten			249.882.714	35,62
20.000.000	USD	United States Treasury Bill 07/04/22, ZCP	19.999.812	2,85
20.000.000	USD	United States Treasury Bill 28/04/22, ZCP	19.997.448	2,85
25.000.000	USD	United States Treasury Bill 05/05/22, ZCP	24.995.391	3,56
25.000.000	USD	United States Treasury Bill 12/05/22, ZCP	24.993.477	3,56
25.000.000	USD	United States Treasury Bill 19/05/22, ZCP	24.987.863	3,56
30.000.000	USD	United States Treasury Bill 26/05/22, ZCP	29.987.572	4,28
30.000.000	USD	United States Treasury Bill 02/06/22, ZCP	29.983.493	4,28
30.000.000	USD	United States Treasury Bill 09/06/22, ZCP	29.981.797	4,27

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
25.000.000	USD	United States Treasury Bill 16/06/22, ZCP	24.979.411	3,56
20.000.000	USD	United States Treasury Bill 30/06/22, ZCP	19.976.450	2,85
Summe Anleihen			250.363.774	35,69
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			250.363.774	35,69

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Luxemburg			32.503.097	4,63
71.120	USD	Schroder ISF China A	11.650.518	1,66
4.685	USD	Schroder ISF Emerging Markets Value	710.058	0,10
32.296	USD	Schroder ISF Indian Equity	11.764.509	1,68
76.669	USD	Schroder ISF Securitised Credit	8.378.012	1,19
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen			32.503.097	4,63
Summe Kapitalanlagen			598.723.110	85,35
Sonstiges Nettovermögen			102.794.782	14,65
Nettoinventarwert			701.517.892	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Argentinien				
250.000	USD	Transportadora de Gas del Sur 02/05/25, 6.75%	227.774	0,67
775.000	USD	YPF 27/06/29, 8.50%	602.958	1,78
250.000	USD	YPF Energia Electrica 25/07/26, 10.00%	226.544	0,67
Kanada				
100.000	EUR	Primo Water Holdings 31/10/28, 3.88%	103.345	0,30
China				
200.000	USD	Shimao Group Holdings 15/07/26, 5.60%	58.000	0,17
200.000	USD	Shimao Group Holdings 13/07/30, 4.60%	53.500	0,16
Frankreich				
100.000	EUR	Afflelou 19/05/26, 4.25%	108.438	0,32
100.000	EUR	Altice France 15/07/29, 4.00%	99.839	0,29
100.000	EUR	Banijay Entertainment 01/03/25, 3.50%	110.724	0,33
100.000	EUR	Iliad Holding 15/10/28, 5.63%	110.647	0,33
100.000	EUR	Laboratoire Eimer Selas 01/02/29, 5.00%	103.406	0,30
100.000	EUR	Loxam 15/07/26, 3.75%	109.744	0,32
Deutschland				
100.000	EUR	Cheplapharm Arzneimittel 15/01/28, 4.38%	109.657	0,32
100.000	EUR	Gruenenthal 15/05/28, 4.13%	107.998	0,32
100.000	EUR	Nidda BondCo 30/09/25, 5.00%	100.703	0,30
100.000	EUR	Renk 15/07/25, 5.75%	111.532	0,32
Indien				
200.000	USD	Vedanta Resources Finance II 21/01/24, 13.88%	209.500	0,62
Irland				
100.000	EUR	eircom Finance DAC 15/02/27, 2.63%	103.235	0,30
100.000	EUR	Rockford Tower Europe CLO DAC 20/04/34, variabel	101.697	0,30
Italien				
100.000	EUR	Castor 15/02/29, variabel	110.321	0,32
100.000	EUR	Centurion Bidco 30/09/26, 5.88%	107.904	0,32
100.000	EUR	Telecom Italia 11/04/24, 4.00%	113.657	0,34

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Luxemburg			538.849	1,59
100.000	EUR	Altice Financing 15/01/28, 3.00%	97.770	0,29
125.000	USD	ARD Finance 30/06/27, 6.50%	114.524	0,34
100.000	EUR	INEOS Finance 01/05/26, 2.88%	105.663	0,31
100.000	EUR	Matterhorn Telecom 15/11/27, 4.00%	108.312	0,32
100.000	EUR	Summer BC Holdco B 31/10/26, 5.75%	112.580	0,33
Niederlande			488.010	1,44
100.000	EUR	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 3.75%	108.663	0,32
175.000	USD	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 5.50%	173.918	0,51
100.000	EUR	UPC Holding 15/06/29, 3.88%	107.320	0,32
100.000	EUR	Ziggo Bond 28/02/30, 3.38%	98.109	0,29
Spanien			314.294	0,92
100.000	EUR	Cirsa Finance International 15/03/27, 4.50%	104.975	0,31
100.000	EUR	Grifols Escrow Issuer 15/10/28, 3.88%	105.533	0,30
100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	103.786	0,31
Schweden			199.653	0,59
100.000	EUR	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden perpetual, variabel	91.247	0,27
100.000	EUR	Verisure Holding 15/07/26, 3.88%	108.406	0,32
Vereinigtes Königreich			833.718	2,45
100.000	GBP	AA Bond 31/01/26, 6.50%	129.039	0,38
100.000	EUR	EG Global Finance 30/10/25, 6.25%	110.677	0,33
100.000	GBP	Hurricane Finance 15/10/25, 8.00%	133.433	0,39
100.000	EUR	INEOS Quattro Finance 1 15/07/26, 3.75%	104.311	0,31
100.000	GBP	Premier Foods Finance 15/10/26, 3.50%	122.596	0,36
100.000	GBP	Thames Water Kemble Finance 19/05/26, 4.63%	126.925	0,37
100.000	EUR	Victoria 24/08/26, 3.63%	106.737	0,31
Vereinigte Staaten			735.821	2,16
30.000	USD	Array Technologies 01/12/28, 1.00%	22.905	0,07
100.000	EUR	Avantor Funding 15/07/28, 3.88%	111.314	0,33

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
100.000	EUR	Dana Financing Luxembourg 15/07/29, 3,00%	101.064	0,30
100.000	EUR	Energizer Gamma Acquisition 30/06/29, 3,50%	97.770	0,29
30.000	USD	NRG Energy 01/06/48, 2,75%	33.030	0,10
55.000	USD	Oceaneering International 01/02/28, 6,00%	53.591	0,16
115.000	USD	Olin 01/08/29, 5,63%	117.399	0,34
200.000	USD	TransDigm 15/11/27, 5,50%	198.748	0,57
Summe Anleihen			6.201.468	18,25
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			6.201.468	18,25

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen				
Argentinien				
400.000	USD	Telecom Argentina 06/08/25, 8,50%	388.482	1,14
Australien				
262.000	AUD	Ruby Bond Trust 12/03/53, variabel	196.776	0,58
272.000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2021-1 12/03/53, variabel	204.022	0,60
Brasilien				
200.000	USD	Azul Investments 15/06/26, 7,25%	168.846	0,50
Kanada				
125.000	USD	Bombardier 15/06/26, 7,13%	122.652	0,36
200.000	USD	Intelligent Packaging 15/09/28, 6,00%	197.500	0,59
90.000	USD	Precision Drilling 15/01/26, 7,13%	91.904	0,27
65.000	USD	Strathcona Resources 01/08/26, 6,88%	65.579	0,19
Kaimaninseln				
250.000	USD	ACAM 17/11/34, variabel	238.010	0,70
250.000	USD	ACAM Series 2019-FL1 17/11/34, variabel	242.609	0,71
375.000	USD	ICG US CLO 16/01/33, variabel	350.779	1,03

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
375.000	USD	Marble Point CLO XV 23/07/32, variabel	352.705	1,04
250.000	USD	MP CLO VIII 28/04/34, variabel	237.953	0,70
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI 20/07/34, variabel	240.608	0,71
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI Series 2021-11A 20/07/34, variabel	240.983	0,71
375.000	USD	Trinitas CLO XVI 20/07/34, variabel	371.138	1,09
1.000.000	USD	Trinitas CLO XVIII 20/01/35, variabel	999.822	2,95
400.000	USD	TRTX Issuer 15/03/38, variabel	397.985	1,17
Frankreich			175.688	0,52
160.000	USD	Iliad Holding 15/10/26, 6,50%	160.641	0,48
15.000	USD	Iliad Holding 15/10/28, 7,00%	15.047	0,04
Deutschland			140.097	0,41
145.000	USD	Mercer International 01/02/29, 5,13%	140.097	0,41
Irland			4.272.776	12,56
375.000	EUR	Ares European CLO XII DAC 20/04/32, variabel	390.244	1,15
250.000	EUR	BBAM European CLO I DAC 22/07/34, variabel	258.602	0,76
300.000	EUR	Bluemountain Fuji Eur CLO IV DAC 25/02/34, variabel	310.586	0,91
100.000	GBP	Frost CMBS DAC 22/11/26, variabel	127.563	0,38
109.000	GBP	Frost CMBS DAC* 22/11/26, variabel	137.442	0,40
104.000	EUR	Frost CMBS DAC 22/11/26, variabel	110.570	0,33
375.000	EUR	GoldenTree Loan Management CLO 4 DAC 20/07/34, variabel	394.099	1,16
177.206	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 17/08/33, variabel	188.928	0,56
160.282	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance Series1A 17/08/33, variabel	170.884	0,50
375.000	EUR	Palmer Square European CLO DAC 15/04/35, variabel	387.530	1,14
375.000	EUR	Segovia European CLO 20/07/32, variabel	405.134	1,18
250.000	EUR	St Paul's CLO VII DAC 18/07/34, variabel	269.287	0,79
310.000	GBP	Taurus UK DAC 17/05/30, variabel	370.532	1,09

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
286.473	GBP	Taurus UK DAC 17/08/31, variabel	365.002	1,07	180.000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/28, 5.63%	164.583	0,48
375.000	EUR	Vendome Funding CLO DAC 20/07/34, variabel	386.373	1,14	165.000	USD	Carnival 01/03/27, 5.75%	157.411	0,46
Israel			31.631	0,09	160.000	USD	CITGO Petroleum 15/06/25, 7.00%	161.178	0,47
30.000	USD	Nice 15/09/25, ZCP	31.631	0,09	75.000	USD	Colgate Energy Partners III 15/02/26, 7.75%	80.054	0,24
Luxemburg			125.683	0,37	45.000	USD	CommScope 01/07/28, 7.13%	40.551	0,12
130.000	USD	ION Trading Technologies 15/05/28, 5.75%	125.683	0,37	145.000	USD	CommScope Technologies 15/06/25, 6.00%	138.646	0,41
Vereinigtes Königreich			124.221	0,37	130.000	USD	Community Health Systems 15/03/27, 5.63%	132.832	0,39
100.000	GBP	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 15/07/28, 4.88%	124.221	0,37	30.000	USD	Community Health Systems 15/01/29, 6.00%	30.403	0,09
Vereinigte Staaten			11.650.279	34,27	200.000	USD	Compass Group Diversified Holdings 15/04/29, 5.25%	189.260	0,56
195.000	USD	Academy 15/11/27, 6.00%	199.875	0,59	35.000	USD	Comstock Resources 15/01/30, 5.88%	34.528	0,10
125.000	USD	Acadia Healthcare 01/07/28, 5.50%	125.313	0,37	165.000	USD	Consolidated Communications 01/10/28, 6.50%	152.444	0,45
65.000	USD	Acadia Healthcare 15/04/29, 5.00%	64.248	0,19	165.000	USD	Cushman & Wakefield US Borrower 15/05/28, 6.75%	172.699	0,51
170.000	USD	Ahead DB Holdings 01/05/28, 6.63%	151.222	0,44	60.000	USD	CVR Energy 15/02/25, 5.25%	58.343	0,17
160.000	USD	Albertsons 15/02/28, 5.88%	160.294	0,47	30.000	USD	DigitalOcean Holdings 01/12/26, ZCP	23.865	0,07
50.000	USD	Allied Universal 01/06/28, 4.63%	47.567	0,14	205.000	USD	Directv Financing 15/08/27, 5.88%	202.053	0,59
125.000	USD	Allied Universal Finance 15/07/26, 6.63%	126.650	0,37	35.000	USD	DISH DBS 01/12/26, 5.25%	33.384	0,10
30.000	USD	American Airlines 15/07/25, 11.75%	35.055	0,10	15.000	USD	DISH DBS 01/12/28, 5.75%	14.222	0,04
180.000	USD	American Finance Trust 30/09/28, 4.50%	162.798	0,48	30.000	USD	Dropbox 01/03/26, ZCP	28.140	0,08
200.000	USD	APX Group 15/02/27, 6.75%	204.742	0,60	30.000	USD	Enphase Energy 01/03/28, ZCP	31.320	0,09
250.000	USD	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 15/05/36, variabel	247.798	0,73	32.000	USD	Etsy 15/06/28, 0.25%	28.592	0,08
185.000	USD	Arconic 15/02/28, 6.13%	185.962	0,55	45.000	USD	EverArc Escrow 30/10/29, 5.00%	41.203	0,12
145.000	USD	ASP Unifrax Holdings 30/09/28, 5.25%	135.555	0,40	30.000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/30, 6.75%	27.638	0,08
80.000	USD	AssuredPartners 15/01/29, 5.63%	73.786	0,22	45.000	USD	FirstCash 01/01/30, 5.63%	43.400	0,13
10.000	USD	Bausch Health 01/02/27, 6.13%	10.086	0,03	400.000	USD	FMC GMSR Issuer Trust 25/07/26, variabel	376.134	1,10
80.000	USD	Bausch Health 01/06/28, 4.88%	76.708	0,23	20.000	USD	Ford Motor 15/03/26, ZCP	23.740	0,07
21.000	USD	Beauty Health 01/10/26, 1.25%	19.157	0,06	195.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/05/28, 5.50%	177.546	0,52
20.000	USD	BellRing Brands 15/03/30, 7.00%	20.480	0,06	120.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/28, 5.00%	115.347	0,34
358.817	USD	Blackbird Capital Aircraft 15/07/46, 2.44%	328.977	0,96					
250.000	USD	BRSP 19/08/38, variabel	246.625	0,73					
20.000	USD	Burlington Stores 15/04/25, 2.25%	22.938	0,07					

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
85.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/29, 6.75%	81.695	0,24	205.000	USD	Performance Food Group 15/10/27, 5.50%	204.480	0,60
135.000	USD	Graham Packaging 15/08/28, 7.13%	122.776	0,36	175.000	USD	Pike 01/09/28, 5.50%	165.240	0,49
130.000	USD	Gray Television 15/10/30, 4.75%	121.241	0,36	200.000	USD	Post Holdings 15/01/28, 5.63%	196.638	0,58
160.000	USD	Hawaiian Brand Intellectual Property 20/01/26, 5.75%	160.302	0,47	205.000	USD	Prime Security Services Borrower 15/01/28, 6.25%	201.110	0,59
10.000	USD	Health Catalyst 15/04/25, 2.50%	11.381	0,03	293.416	USD	PRPM 25/06/26, 3.72%	276.959	0,80
65.000	USD	Herbalife International 01/06/29, 4.88%	57.095	0,17	200.000	USD	PRPM 25/09/26, variabel	188.221	0,55
170.000	USD	Hess Midstream Operations 15/06/28, 5.13%	170.757	0,50	165.000	USD	SEG Holding 15/10/28, 5.63%	165.182	0,49
45.000	USD	Hunt 15/04/29, 5.25%	42.957	0,13	85.000	USD	Six Flags Entertainment 15/04/27, 5.50%	85.164	0,25
25.000	USD	iHeartCommunications 01/05/27, 8.38%	25.906	0,08	30.000	USD	Snap 01/03/28, 0.13%	29.955	0,09
165.000	USD	iHeartCommunications 15/08/27, 5.25%	163.436	0,48	30.000	USD	Spotify USA 15/03/26, ZCP	25.714	0,08
185.000	USD	Iron Mountain 15/03/28, 5.25%	182.601	0,54	65.000	USD	Suburban Propane Partners 01/06/31, 5.00%	61.025	0,18
25.000	USD	Iron Mountain 15/07/28, 5.00%	24.417	0,07	25.000	USD	Tenet Healthcare 01/02/27, 6.25%	25.693	0,08
30.000	USD	JetBlue Airways 01/04/26, 0.50%	28.063	0,08	95.000	USD	TMS International 15/04/29, 6.25%	90.431	0,27
145.000	USD	LABL 01/11/28, 5.88%	136.209	0,40	135.000	USD	Tronox 15/03/29, 4.63%	126.388	0,37
200.000	USD	Legends Hospitality Holding 01/02/26, 5.00%	192.256	0,57	30.000	USD	Twitter 15/06/24, 0.25%	30.600	0,09
30.000	USD	Lumentum Holdings 15/06/28, 0.50%	29.490	0,09	110.000	USD	Uber Technologies 15/01/28, 6.25%	113.877	0,34
55.000	USD	MEDNAX 15/02/30, 5.38%	53.261	0,16	180.000	USD	Univision Communications 01/06/27, 6.63%	188.760	0,56
145.000	USD	Minerals Technologies 01/07/28, 5.00%	138.293	0,41	10.000	USD	Venture Global Calcasieu Pass 15/08/29, 3.88%	9.723	0,03
75.000	USD	Mozart Debt Merger Sub 01/10/29, 5.25%	70.194	0,21	15.000	USD	Venture Global Calcasieu Pass 15/08/31, 4.13%	14.742	0,04
145.000	USD	MPH Acquisition Holdings 01/09/28, 5.50%	139.501	0,41	195.000	USD	VM Consolidated 15/04/29, 5.50%	183.414	0,54
25.000	USD	NCR 01/10/28, 5.00%	23.981	0,07	189.000	USD	VMC Finance 16/06/36, variabel	188.065	0,55
160.000	USD	NCR 01/09/29, 6.13%	160.900	0,47	455.000	USD	VMC Finance Series 2021-FL4 16/06/36, variabel	445.929	1,30
85.000	USD	Nexstar Media 15/07/27, 5.63%	86.275	0,25	205.000	USD	Wash Multifamily Acquisition 15/04/26, 5.75%	205.848	0,61
145.000	USD	NFP 15/08/28, 4.88%	138.753	0,41	200.000	USD	Watco 15/06/27, 6.50%	197.386	0,58
12.000	USD	Nutanix 01/10/27, 0.25%	10.058	0,03	175.000	USD	Xerox Holdings 15/08/28, 5.50%	170.849	0,50
30.000	USD	Okta 15/06/26, 0.38%	29.400	0,09			Summe Anleihen	21.628.728	63,63
150.000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/28, 4.25%	136.627	0,40			Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	21.628.728	63,63
10.000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/29, 6.25%	8.869	0,03			Summe Kapitalanlagen	27.830.196	81,88
155.000	USD	Ortho-Clinical Diagnostics 01/06/25, 7.38%	159.885	0,47			Sonstiges Nettovermögen	6.157.612	18,12
30.000	USD	Perficient 15/11/26, 0.13%	26.955	0,08			Nettoinventarwert	33.987.808	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Israel			766.223	0,33
41.605	USD	Cognyte Software	470.553	0,20
61.598	USD	ironSource	295.670	0,13
Schweiz			11.749.487	5,08
148.109	USD	Alcon	11.749.487	5,08
Vereinigte Staaten			179.667.446	77,76
20.968	USD	Abbott Laboratories	2.481.772	1,07
2.061	USD	Adobe	939.033	0,41
24.438	USD	agilon health	619.503	0,27
69.419	USD	Allison Transmission Holdings	2.725.390	1,18
839	USD	Alphabet	2.333.553	1,01
39.369	USD	Analog Devices	6.502.971	2,81
27.815	USD	Anterix	1.610.489	0,70
38.909	USD	Baker Hughes	1.416.677	0,61
82.679	USD	Boston Scientific	3.661.853	1,58
7.855	USD	Bunge	870.413	0,38
314.846	USD	Carnival	6.366.186	2,76
7.437	USD	Comerica	672.528	0,29
22.744	USD	Constellation Brands	5.238.398	2,27
3.245	USD	Crown Holdings	405.917	0,18
3.342	USD	CyberArk Software	563.963	0,24
19.973	USD	Danaher	5.858.680	2,54
46.308	USD	DR Horton	3.450.409	1,49
55.084	USD	Dropbox	1.280.703	0,55
11.394	USD	Eaton	1.729.153	0,75
14.097	USD	Eli Lilly	4.036.958	1,75
38.900	USD	Halliburton	1.473.143	0,64
9.959	USD	Janus Henderson Group	348.764	0,15
111.373	USD	Johnson Controls International	7.302.728	3,16
85.103	USD	KeyCorp	1.904.605	0,82
14.885	USD	Keysight Technologies	2.351.383	1,02
14.994	USD	LPL Financial Holdings	2.739.104	1,19
54.431	USD	Marvell Technology	3.903.247	1,69
6.299	USD	MasTec	548.643	0,24
9.883	USD	Medtronic	1.096.519	0,47
15.819	USD	Microsoft	4.877.156	2,11
6.966	USD	Old Dominion Freight Line	2.080.605	0,90
38.707	USD	ON24	508.997	0,22
53.334	USD	Option Care Health	1.523.219	0,66
55.567	USD	PACCAR	4.893.786	2,12

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
17.157	USD	PayPal Holdings	1.984.207	0,86
88.244	USD	Pfizer	4.568.392	1,98
148.936	USD	Portillo's	3.657.868	1,58
7.373	USD	PotlatchDeltic	388.778	0,17
4.872	USD	PTC	524.812	0,23
61.253	USD	QUALCOMM	9.360.683	4,05
278.197	USD	Regions Financial	6.192.665	2,68
13.132	USD	Roper Technologies	6.201.324	2,68
48.881	USD	S&P Global	20.050.009	8,67
63.850	USD	Sabre	729.806	0,32
95.066	USD	Schlumberger	3.927.176	1,70
7.628	USD	Sealed Air	510.771	0,22
4.297	USD	Sherwin-Williams	1.072.617	0,46
172.470	USD	Southwest Airlines	7.899.126	3,42
6.438	USD	Splunk	956.751	0,41
27.685	USD	T-Mobile US	3.553.370	1,54
47.844	USD	Verra Mobility	778.900	0,34
17.952	USD	Waste Connections	2.507.894	1,09
208.929	USD	Wells Fargo	10.124.699	4,38
43.870	USD	Williams-Sonoma	6.361.150	2,75
Summe Aktien			192.183.156	83,17
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			192.183.156	83,17
Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Vereinigte Staaten			15.990.947	6,92
16.000.000	USD	United States Treasury Bill 07/07/22, ZCP	15.990.947	6,92
Summe Anleihen			15.990.947	6,92
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			15.990.947	6,92
Summe Kapitalanlagen			208.174.103	90,09
Sonstiges Nettovermögen			22.889.097	9,91
Nettoinventarwert			231.063.200	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Deutschland				
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4.25%	17.673	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4.75%	18.985	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3.25%	16.700	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2.50%	15.532	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2.50%	15.940	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1.25%	12.816	-
Vereinigte Staaten			30.246	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2.50%	9.773	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3.00%	10.655	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2.50%	9.818	-
Summe Anleihen			127.892	0,02
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			127.892	0,02

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Kanada				
50.000.000	USD	Canadian Treasury Bill 07/04/22, ZCP	49.998.250	5,95

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Vereinigte Staaten			125.020.908	14,87
125.000.000	USD	United States Treasury Bill 21/04/22, ZCP	124.989.931	14,87
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2.88%	10.455	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3.00%	10.697	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2.50%	9.825	-
Summe Anleihen			175.019.158	20,82
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			175.019.158	20,82

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Luxemburg				
5.000.000	USD	JPMorgan Liquidity Funds-US Dollar Treasury Liquidity Fund	5.000.000	0,59
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen			5.000.000	0,59
Summe Kapitalanlagen			180.147.050	21,43

Termineinlagen				
Finanzen				
115.000.000	USD	Banque NA 01/04/22, 0.30%	115.000.000	13,68
11.691.500	USD	JPMorgan Chase Bank NA 01/04/22, 0.03%	11.691.500	1,39
35.000.000	USD	Mizuho Bank 01/04/22, 0.32%	35.000.000	4,16
Summe Termineinlagen			161.691.500	19,23
Sonstiges Nettovermögen			498.813.309	59,34
Nettoinventarwert			840.651.859	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert GBP	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Vereinigtes Königreich			9.964.563	26,95
30.951	GBP	AB Dynamics	337.366	0,91
129.239	GBP	Bytes Technology Group	643.352	1,74
1.296.958	GBP	Comptoir Group	63.551	0,17
462.556	GBP	Everyman Media Group	592.072	1,60
58.197	GBP	Gresham House	541.232	1,46
497.242	GBP	Harworth Group	885.091	2,40
169.742	GBP	Inspecc Group	619.558	1,68
144.742	GBP	LBG Media	267.773	0,72
433.349	GBP	Premier Foods	494.018	1,34
29.884	GBP	Rathbones Group	591.703	1,60
553.087	GBP	Science in Sport	318.025	0,86
392.843	GBP	TT Electronics	807.292	2,18
129.288	GBP	Tyman	411.136	1,11
72.823	GBP	Vitec Group	983.110	2,67
62.938	GBP	Vp	528.679	1,43
58.173	GBP	Watches of Switzerland Group	663.172	1,79
221.022	GBP	Wincanton	853.145	2,31
36.692	GBP	Young & Company's Brewery	245.103	0,66
8.423	GBP	Young & Company's Brewery Class A	119.185	0,32
Summe Aktien			9.964.563	26,95
Anleihen				
Vereinigtes Königreich			17.024.577	46,05
4.650.000	GBP	United Kingdom Gilt 22/07/22, 0.50%	4.649.027	12,58
3.100.000	GBP	United Kingdom Gilt 09/09/22, 1.75%	3.114.106	8,42
3.300.000	GBP	United Kingdom Gilt 22/07/23, 0.75%	3.278.550	8,87
2.000.000	GBP	United Kingdom Gilt 07/09/23, 2.25%	2.025.513	5,48
4.050.000	GBP	United Kingdom Gilt 31/01/24, 0.13%	3.957.381	10,70
Summe Anleihen			17.024.577	46,05
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			26.989.140	73,00

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert GBP	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Vereinigtes Königreich			6.872.446	18,59
1.300.000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 05/09/22, ZCP	1.294.990	3,50
5.600.000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 12/09/22, ZCP	5.577.456	15,09
Summe Anleihen			6.872.446	18,59
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			6.872.446	18,59
Summe Kapitalanlagen			33.861.586	91,59
Sonstiges Nettovermögen			3.109.337	8,41
Nettoinventarwert			36.970.923	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	
Aktien						8.291	CAD	Pembina Pipeline	311.505	0,07		
Australien						2.735.120	0,59	13.492	USD	Suncor Energy	439.704	0,09
26.539	AUD	Australia & New Zealand Banking Group	548.112	0,12	21.085	CAD	Tourmaline Oil	971.480	0,21			
277.448	GBP	Glencore	1.822.348	0,39	33.228	CAD	Vermilion Energy	697.704	0,15			
117.426	AUD	Whitehaven Coal	364.660	0,08	11.439	USD	Zymeworks	74.925	0,02			
Österreich						2.850.183	0,61	China				
18.631	EUR	Addiko Bank	245.265	0,05	41.000	HKD	Akeso	87.304	0,02			
28.306	EUR	BAWAG Group	1.439.169	0,31	1.613	CNH	Amoy Diagnostics	12.975	-			
31.846	EUR	Erste Group Bank	1.165.749	0,25	7.385	HKD	Angang Steel	3.403	-			
Belgien						1.553.116	0,33	943	HKD	Anhui Conch Cement	4.851	-
8.644	EUR	Galapagos	538.365	0,12	131	HKD	Baidu	2.366	-			
3.698	EUR	KBC Ancora	164.046	0,04	4.600	CNH	Baoshan Iron & Steel	4.886	-			
11.762	EUR	KBC Group	850.705	0,17	34.651	HKD	China Gas Holdings	44.412	0,01			
Brasilien						1.498.399	0,32	41.979	HKD	China Longyuan Power Group	95.605	0,02
750	USD	Banco Bradesco	3.480	-	3.174	HKD	China National Building Material	3.947	-			
1.082	BRL	BR Properties	2.020	-	3.350	HKD	China Oilfield Services	3.434	-			
37.214	USD	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	365.814	0,08	3.100	CNH	China Railway Group	2.941	-			
107.669	BRL	Cosan	534.833	0,11	1.531	CNH	Contemporary Amperex Technology	123.419	0,03			
140.728	BRL	Hapvida Participacoes e Investimentos	349.969	0,08	178.000	HKD	CSPC Pharmaceutical Group	205.647	0,05			
2.334	BRL	Hypera	18.977	-	28.853	HKD	Everest Medicines	95.584	0,02			
14.760	USD	Petroleo Brasileiro	218.448	0,05	10.645	HKD	Ganfeng Lithium	152.202	0,04			
243	USD	Vale	4.858	-	80	CNH	Ganfeng Lithium	1.582	-			
Burkina Faso						198.564	0,04	200	CNH	Guangzhou Tinci Materials Technology	2.958	-
8.005	CAD	Endeavour Mining	198.564	0,04	188.443	HKD	Hope Education Group	17.802	-			
Kamerun						171.032	0,04	4.300	CNH	Industrial & Commercial Bank of China	3.228	-
6.902	USD	Golar LNG	171.032	0,04	4.400	CNH	Metallurgical of China	2.596	-			
Kanada						12.635.586	2,72	4.000	CNH	PetroChina	3.474	-
226.192	CAD	ARC Resources	3.028.801	0,66	390	HKD	Ping An Insurance Group of China	2.771	-			
44.226	USD	Barrick Gold	1.084.864	0,23	15.000	HKD	Remegen	89.043	0,02			
36.168	CAD	Baytex Energy	157.674	0,03	1.500	CNH	Sany Heavy Industry	4.135	-			
3.631	USD	Canadian Natural Resources	225.049	0,05	73.600	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer	78.831	0,02			
70.799	USD	Cenovus Energy	1.180.927	0,25	1.400	CNH	Sinoma Science & Technology	5.349	-			
3.200	USD	Clementia Pharmaceuticals	-	-	9.234	CNH	Venustech Group	30.354	0,01			
54.051	CAD	Enerplus	684.852	0,15	9.899	HKD	WuXi AppTec	157.332	0,04			
105.567	CAD	Headwater Exploration	559.860	0,12	300	CNH	Wuxi Lead Intelligent Equipment	2.759	-			
17.678	CAD	Intact Financial	2.612.071	0,56	328	HKD	XPeng	4.711	-			
3.179	USD	Nuvei	239.665	0,05	648	USD	Xpeng-ADR	17.878	-			
17.863	CAD	Parex Resources	366.505	0,08								

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
100	CNH	Yunnan Energy New Material	3.462	-
1.306	CNH	Zhejiang HangKe Technology	11.730	-
2.470	HKD	Zijin Mining Group	3.803	-
4.274	CNH	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology	4.466	-
Dänemark			1.255.155	0,27
8.752	USD	Ascendis Pharma	1.027.135	0,22
622	DKK	Genmab	228.020	0,05
Ägypten			165.975	0,04
138.174	GBP	Centamin	165.975	0,04
Frankreich			4.997.696	1,08
71.455	EUR	ALD	951.727	0,21
63.862	EUR	AXA	1.876.747	0,39
2.859	EUR	Cie de Saint-Gobain	171.643	0,04
1.365	EUR	Gaztransport Et Technigaz	153.268	0,03
5.979	EUR	Publicis Groupe	365.504	0,08
5.533	EUR	Rothschild	219.434	0,05
14.407	EUR	TotalEnergies	733.614	0,16
9.532	EUR	Veolia Environnement	306.748	0,07
2.129	EUR	Vinci	219.011	0,05
Deutschland			3.836.166	0,83
1.377	USD	BioNTech	234.861	0,05
49.581	EUR	Deutsche Bank	631.312	0,14
10.516	EUR	Siemens	1.461.843	0,31
23.179	EUR	Talanx	1.026.184	0,22
52.147	EUR	TUI	165.275	0,04
613	EUR	Volkswagen	106.467	0,02
1.228	EUR	Wacker Chemie	210.224	0,05
Ghana			71.375	0,02
9.927	USD	Kosmos Energy	71.375	0,02
Griechenland			331.743	0,07
39.458	EUR	Public Power Corp.	331.743	0,07
Hongkong			639.260	0,14
60.734	HKD	AIA Group	639.260	0,14
Indien			2.748.783	0,59
41.122	INR	Bharti Airtel	409.700	0,09
41.711	INR	Kotak Mahindra Bank	964.954	0,21
14.307	INR	Mahindra & Mahindra	152.284	0,03
171.213	INR	NTPC	305.031	0,07
185.434	INR	Power Grid of India	530.546	0,11
11.109	INR	Reliance Industries	386.268	0,08

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Indonesien			618.546	0,13
26.200	IDR	Aneka Tambang	4.451	-
199.800	IDR	Bank Rakyat Indonesia Persero	64.826	0,01
11.680.200	IDR	Panin Financial	139.878	0,03
1.262.100	IDR	Telekomunikasi Indonesia Persero	402.466	0,09
1.900	IDR	United Tractors	3.380	-
7.600	IDR	Vale Indonesia	3.545	-
Irland			3.063.468	0,66
16.412	USD	AerCap Holdings	825.195	0,18
607.438	EUR	AIB Group	1.345.973	0,29
2.445	USD	ICON	594.673	0,13
69.430	EUR	Irish Continental Group	297.627	0,06
Israel			323.799	0,07
8.253	ILS	Mizrabi Tefahot Bank	323.799	0,07
Italien			1.620.470	0,35
1.924	EUR	DiaSorin	302.024	0,07
3.876	EUR	Enel	26.019	0,01
1.200	USD	Stevanato Group	24.144	0,01
116.334	EUR	UniCredit	1.268.283	0,26
Japan			3.763.659	0,81
33.151	JPY	Astellas Pharma	520.384	0,11
8.600	JPY	Chugai Pharmaceutical	289.422	0,06
15.792	JPY	Daiichi Sankyo	347.647	0,07
934	JPY	Eisai	43.501	0,01
53	JPY	ENEOS Holdings	199	-
26.000	JPY	Fukuoka Financial Group	507.015	0,11
5.525	JPY	Japan Steel Works	173.365	0,04
177.614	JPY	Mitsubishi UFJ Financial Group	1.109.249	0,25
216	JPY	Nippon Shinyaku	14.780	-
2.389	JPY	Ono Pharmaceutical	60.167	0,01
2.594	JPY	Panasonic	25.324	0,01
262	JPY	Rohm	20.639	-
98	JPY	Sumitomo Mitsui Financial Group	3.145	-
1.200	JPY	T&D Holdings	16.471	-
10.800	JPY	Tokio Marine Holdings	632.351	0,14
Luxemburg			634.271	0,14
17.769	EUR	ArcelorMittal	575.949	0,13
15.636	USD	Arrival	58.322	0,01
Malaysia			4.860	-
2.940	MYR	Malaysia Airports Holdings	4.860	-

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens		
Niederlande					3.845.115					0,83	
2.251	USD	Argenx	709.763	0,15	52	CHF	Lonza Group	37.827	0,01		
152.323	GBP	DP Eurasia	114.056	0,02	3.574	CHF	Molecular Partners	72.018	0,02		
2.349	EUR	Ebusco Holding	50.153	0,01	4.599	CHF	Novartis	404.382	0,09		
74.015	EUR	ING Groep	778.753	0,18	579	CHF	Roche Holding	229.614	0,05		
8.785	EUR	Koninklijke Philips	269.491	0,06	273	CHF	Tecan Group	108.721	0,02		
22.166	USD	Merus	586.069	0,13	46.298	CHF	UBS Group	909.125	0,19		
14.170	EUR	NN Group	718.881	0,15	Thailand					2.878	-
22.310	GBP	Shell	617.949	0,13	8.700	THB	Banpu	2.878	-		
Norwegen					814.202					0,18	
26.160	NOK	Aker Carbon Capture	68.016	0,01	Vereinigtes Königreich					7.567.278	1,63
19.893	USD	Equinor	746.186	0,17	6.191	GBP	Abcam	112.639	0,02		
Philippinen					5.946					-	
12.709	PHP	Bloomerry Resorts	1.680	-	32.507	EUR	Allfunds Group	375.431	0,08		
2.025	PHP	Security Bank	4.266	-	4.115	GBP	AstraZeneca	547.702	0,12		
Puerto Rico					773.179					0,17	
9.459	USD	Popular	773.179	0,17	90.904	GBP	Babcock International Group	387.505	0,08		
Singapur					610.580					0,13	
5.796	EUR	STMicroelectronics	253.844	0,05	79.918	GBP	Beazley	441.774	0,10		
15.100	SGD	United Overseas Bank	356.736	0,08	1.468	GBP	British American Tobacco	61.604	0,01		
Südafrika					1.878.970					0,40	
11.071	GBP	Anglo American	577.737	0,12	2.292	GBP	Genus	84.967	0,02		
27.735	USD	Gold Fields	428.783	0,09	20.815	GBP	Harbour Energy	132.999	0,03		
6.375	ZAR	Rand Merchant Investment Holdings	22.769	-	26.401	GBP	Imperial Brands	558.548	0,12		
8.965	ZAR	Sibanye Stillwater	36.688	0,01	15.684	GBP	Intermediate Capital Group	367.872	0,08		
62.805	GBP	Thungela Resources	812.993	0,18	925.551	GBP	Lloyds Banking Group	572.118	0,12		
Südkorea					454.328					0,10	
9.982	USD	Coupang	176.482	0,04	19.657	GBP	National Grid	302.742	0,07		
142	KRW	KB Financial Group	7.182	-	6.535	GBP	Persimmon	184.657	0,04		
178	KRW	Korea Electric Power	3.326	-	58.439	GBP	Prudential	870.555	0,19		
1.291	USD	POSCO Holdings	76.518	0,02	25.180	GBP	Rotork	107.966	0,02		
55	KRW	Samsung Electronics	3.158	-	252.261	GBP	Serco Group	477.522	0,10		
1.035	KRW	SK Innovation	183.593	0,04	28.189	GBP	Smith & Nephew	451.772	0,10		
51	KRW	S-Oil	4.069	-	134.776	GBP	Standard Chartered	903.302	0,20		
Spanien					3.112.136					0,67	
117.665	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	678.170	0,15	66.825	NOK	Subsea 7	625.603	0,13		
886.479	EUR	Banco de Sabadell	731.186	0,16	Vereinigte Staaten					95.341.624	20,56
253.597	EUR	Banco Santander	869.678	0,18	2.070	USD	Accenture	698.066	0,15		
45.697	EUR	Grifols	833.102	0,18	43.604	USD	Aclaris Therapeutics	751.733	0,16		
Schweden					538.978					0,12	
4.736	SEK	Lundin Energy	201.128	0,04	9.129	USD	AdaptHealth	146.338	0,03		
15.804	SEK	Sandvik	337.850	0,08	3.550	USD	Advanced Micro Devices	388.157	0,08		
Schweiz					2.481.469					0,53	
6.817	CHF	ABB	222.573	0,05	3.280	USD	AECOM	251.937	0,05		
6.234	CHF	Alcon	497.209	0,10	10.520	USD	agilon health	266.682	0,06		
					5.572	USD	Airbnb	957.047	0,21		
					946	USD	Alcoa	85.168	0,02		
					629	USD	Align Technology	274.244	0,06		
					20.232	USD	Aligos Therapeutics	43.499	0,01		
					14.748	USD	Alkermes	388.020	0,08		
					2.185	USD	Alnylam Pharmaceuticals	356.789	0,08		
					383	USD	Alphabet	1.065.257	0,23		
					85	USD	Amazon.com	277.096	0,06		
					468	USD	Amedisys	80.632	0,02		

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
12.334	USD	Amerant Bancorporation	389.631	0,08	34.886	USD	Coterra Energy	940.875	0,20
11.802	USD	American Electric Power	1.177.486	0,25	2.501	USD	Covetrus	41.992	0,01
6.098	USD	American Express	1.140.326	0,25	9.932	USD	CSX	371.953	0,08
1.738	USD	American Water Works	287.691	0,06	1.827	USD	Danaher	535.914	0,12
21.409	USD	Ameris Bancorporation	939.427	0,20	766	USD	Deere	318.242	0,07
84.998	USD	Amicus Therapeutics	804.931	0,17	1.935	USD	Denbury	152.033	0,03
40.162	USD	Antero Resources	1.226.146	0,26	16.103	USD	DHT Holdings	93.397	0,02
392	USD	Anthem	192.558	0,04	4.844	USD	East West Bancorporation	382.773	0,08
7.978	USD	Apellis Pharmaceuticals	405.362	0,09	1.282	USD	Eastern Bankshares	27.614	0,01
3.890	USD	Applied Industrial Technologies	399.347	0,09	1.710	USD	Edison International	119.871	0,03
27.741	USD	Arch Capital Group	1.343.219	0,29	644	USD	Edwards Lifesciences	75.812	0,02
13.062	USD	Archaea Energy	286.450	0,06	2.960	USD	Elanco Animal Health	77.226	0,02
6.077	USD	Ares Management	493.635	0,11	6.433	USD	Eli Lilly	1.842.217	0,41
27.970	USD	Aris Water Solution	509.054	0,11	1.904	USD	Encompass Health	135.393	0,03
5.443	USD	Arista Networks	756.468	0,16	46.214	USD	EnLink Midstream LLC	445.965	0,10
1.105	USD	AvalonBay Communities	274.449	0,06	2.764	USD	Enstar Group	721.819	0,16
22.724	USD	Baker Hughes	827.381	0,18	3.446	USD	Entergy	402.321	0,09
850	USD	Baxter International	65.909	0,01	25.713	USD	Entrada Therapeutics	241.445	0,05
363	USD	Becton Dickinson	96.558	0,02	9.252	USD	EOG Resources	1.103.116	0,24
75	USD	Bio-Techne	32.478	0,01	239	USD	Equinix	177.247	0,04
10.055	USD	Blueprint Medicines	642.313	0,14	28.581	USD	Equitable Holdings	883.439	0,19
5.167	USD	Boston Scientific	228.846	0,05	4.010	USD	Etsy	498.363	0,11
46.412	USD	Brigham Minerals	1.185.827	0,26	8.558	USD	Exact Sciences	598.375	0,13
3.449	USD	Builders FirstSource	222.598	0,05	16.992	USD	Exelon	809.329	0,17
1.215	USD	Bunge	134.634	0,03	5.465	USD	Exxon Mobil	451.354	0,10
3.511	USD	BWX Technologies	189.102	0,04	3.629	USD	FB Financial	161.200	0,03
5.511	USD	Cabot	377.008	0,08	13.692	USD	Fidelity National Financial	668.717	0,14
2.668	USD	Cactus	151.382	0,03	6.739	USD	Fifth Third Bancorporation	290.047	0,06
1.675	USD	Cano Health	10.636	-	14.082	USD	First Busey	356.838	0,08
26.044	USD	CareMax	194.549	0,04	9.857	USD	First Republic Bank	1.597.820	0,34
11.254	USD	Cargurus	477.845	0,10	12.421	USD	FirstEnergy	569.627	0,12
1.950	USD	CBRE Group	178.464	0,04	4.648	USD	FleetCor Technologies	1.157.631	0,25
7.486	USD	Celldex Therapeutics	254.973	0,05	9.223	USD	Flowserve	331.106	0,07
6.166	USD	Centene	519.116	0,11	400	USD	Fluence Energy	5.244	-
11.699	USD	CenterPoint Energy	358.457	0,08	31.851	USD	Fluor	913.805	0,20
12.420	USD	Change Healthcare	270.756	0,06	1.164	USD	Fluor-Preference perpetual	1.702.858	0,37
23.731	USD	Charles Schwab	2.000.760	0,44	14.911	USD	Ford Motor	252.145	0,05
5.440	USD	Cheniere Energy	754.256	0,16	4.616	USD	Freeport-McMoRan	229.600	0,05
21.033	USD	Chesapeake Energy	1.829.870	0,40	595	USD	Generac Holdings	176.870	0,04
1.425	USD	Chubb	304.808	0,07	3.747	USD	Gilead Sciences	222.759	0,05
5.506	USD	Clean Energy Fuels	43.718	0,01	3.367	USD	Glaukos	194.680	0,04
1.843	USD	Clean Harbors	205.753	0,04	4.337	USD	Global Payments	593.475	0,13
6.476	USD	ConocoPhillips	647.600	0,14	5.542	USD	GoDaddy	463.865	0,10
1.356	USD	CONSOL Energy	51.026	0,01	2.160	USD	Goldman Sachs Group	713.016	0,15
3.807	USD	Consolidated Edison	360.447	0,08					
2.841	USD	Constellation Energy	159.806	0,03					

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
1.018	USD	Gulfport Energy	91.437	0,02	259	USD	Molina Healthcare	86.400	0,02
3.773	USD	Haemonetics	238.529	0,05	8.559	USD	Morgan Stanley	748.057	0,16
1.839	USD	Halliburton	69.643	0,02	14.023	USD	MVB Financial	581.955	0,13
52.420	USD	Hamilton Lane Alliance Holdings I	518.958	0,11	14.945	USD	Myovant Sciences	199.067	0,04
2.106	USD	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital	99.888	0,02	4.300	USD	NanoString Technologies	149.425	0,03
182	USD	HCA Healthcare	45.613	0,01	16.532	USD	Navigator Holdings	201.856	0,04
619	USD	Health Catalyst	16.174	-	4.467	USD	NeoGenomics	54.274	0,01
1.941	USD	Hilton Worldwide Holdings	294.527	0,06	9.209	USD	New Jersey Resources	422.325	0,09
963	USD	Hologic	73.978	0,02	19.626	USD	NextDecade	129.924	0,03
2.900	USD	Home BancShares	65.540	0,01	5.263	USD	NiSource	167.363	0,04
489	USD	Humana	212.798	0,05	1.325	USD	Noble	46.441	0,01
964	USD	IDEXX Laboratories	527.366	0,11	22.518	USD	NOV	441.578	0,10
98	USD	Illumina	34.241	0,01	6.652	USD	NOW	73.372	0,02
100.970	USD	ImmunoGen	480.617	0,10	20.121	USD	Nurix Therapeutics	281.895	0,06
95	USD	Inari Medical	8.611	-	1.055	USD	Oasis Petroleum	154.347	0,03
1.484	USD	Insulet	395.323	0,09	35.022	USD	Olema Pharmaceuticals	149.194	0,03
101	USD	Intel	5.006	-	634	USD	ONEOK	44.779	0,01
4.159	USD	Intra-Cellular Therapies	254.489	0,05	7.628	USD	Oscar Health	76.051	0,02
16.086	USD	Ironwood Pharmaceuticals	202.362	0,04	25.111	USD	Ovintiv	1.357.752	0,29
3.684	USD	Jamf Holding	128.240	0,03	4.962	USD	Owens & Minor	218.427	0,05
11.424	USD	Johnson Controls International	749.072	0,16	1.314	USD	Palo Alto Networks	817.978	0,18
2.238	USD	Karuna Therapeutics	283.756	0,06	7.176	USD	Patterson-UTI Energy	111.084	0,02
13.915	USD	Kinder Morgan	263.133	0,06	14.161	USD	PDC Energy	1.029.221	0,22
9.495	USD	Kodiak Sciences	73.301	0,02	2.713	USD	Peabody Energy	66.550	0,01
13.194	USD	Kymera Therapeutics	558.370	0,12	54.987	USD	Perella Weinberg Partners	519.627	0,11
581	USD	Laboratory of America Holdings	153.186	0,03	9.683	USD	Pfizer	501.289	0,11
14.041	USD	Livent	366.049	0,08	5.239	USD	Pioneer Natural Resources	1.309.907	0,28
101	USD	LPL Financial Holdings	18.451	-	7.652	USD	Portland General Electric	422.008	0,09
332	USD	M&T Bank	56.274	0,01	4.649	USD	Progressive	529.940	0,11
5.516	USD	Madrigal Pharmaceuticals	541.230	0,12	3.058	USD	Prologis	493.806	0,11
34.997	USD	Marathon Oil	878.775	0,19	976	USD	Quidel	109.761	0,02
5.511	USD	Marvell Technology	395.194	0,09	880	USD	R1 RCM	23.549	0,01
3.975	USD	Mastercard	1.420.586	0,31	8.897	USD	Rattler Midstream	124.291	0,03
1.400	USD	Maxeon Solar Technologies	20.272	-	3.922	USD	Raymond James Financial	431.067	0,09
23.386	USD	Medical Properties Trust	494.380	0,11	420	USD	Regeneron Pharmaceuticals	293.336	0,06
58.810	USD	MGIC Investment	796.876	0,17	8.096	USD	Rice Acquisition II	80.960	0,02
2.017	USD	Middleby	330.667	0,07	14.906	USD	Rice Acquisition II-XNYS	146.973	0,03
4.628	USD	Mirati Therapeutics	380.514	0,08	2.925	USD	S&P Global	1.199.777	0,26
1.121	USD	Moderna	193.103	0,04	2.500	USD	Sage Therapeutics	82.750	0,02

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
139	USD	Salesforce.com	29.512	0,01	4.313	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	414.781	0,09
19.616	USD	Schlumberger	810.337	0,17	6.959	USD	Weyerhaeuser	263.746	0,06
6.140	EUR	Schneider Electric	1.033.528	0,22	19.486	USD	Whiting Petroleum	1.588.304	0,34
4.380	USD	Seagen	630.939	0,14	28.643	USD	WisdomTree Investments	168.134	0,04
6.386	USD	Sempra Energy	1.073.614	0,23	661	USD	Wolfsped	75.261	0,02
9.575	USD	Skyline Champion	525.476	0,11	3.575	USD	Zions Bancorporation	234.377	0,05
104	USD	SoFi Technologies	983	-	1.319	USD	Zoetis	248.750	0,05
931	USD	SolarEdge Technologies	300.126	0,06			Vietnam	284.711	0,06
15.152	USD	Solaris Oilfield Infrastructure	171.066	0,04					
3.505	USD	South Jersey Industries	121.098	0,03	131.240	VND	Vietnam Technological & Commercial Joint Stock Bank	284.711	0,06
28.355	USD	Spring Valley Acquisition	296.877	0,06			Summe Aktien	164.719.860	35,51
7.478	USD	Square	1.014.017	0,22			Anleihen		
7.799	EUR	Stellantis	127.689	0,03			Argentinien	20.830	-
1.906	USD	StepStone Group	63.012	0,01	47.145	USD	Cia Latinoamericana de Infraestructura & Servicios 25/07/27, 5.25%	20.830	-
1.494	USD	Stryker	399.421	0,09			China	2.063.003	0,44
1.144	USD	Synaptics	228.228	0,05	700.000	USD	Agricultural Bank of China 30/07/22, variabel	700.420	0,15
22.600	USD	Synovus Financial	1.107.400	0,24	200.000	USD	Bank of China 17/04/22, variabel	200.036	0,04
8.981	USD	Talos Energy	141.810	0,03	700.000	USD	Bank of China 22/11/22, variabel	700.235	0,15
3.789	USD	Targa Resources	285.956	0,06	200.000	USD	ICBCIL Finance 05/04/22, 3.38%	200.004	0,04
169	USD	Teleflex	59.966	0,01	200.000	GBP	Industrial & Commercial Bank of China 31/07/22, 1.50%	262.308	0,06
11.583	USD	Tenaris	348.301	0,08			Kroatien	197.261	0,04
175	USD	Thermo Fisher Scientific	103.364	0,02	190.000	EUR	Croatia Government International Bond 19/06/29, 1.13%	197.261	0,04
9.116	USD	Tradeweb Markets	801.023	0,17			Frankreich	301.405	0,06
512	USD	Triumph Bancorporation	48.138	0,01	300.000	USD	Dexia Credit Local 20/09/22, 2.38%	301.405	0,06
2.944	USD	Turning Point Therapeutics	79.046	0,02			Deutschland	4.804.936	1,04
753	USD	Ultra Beauty	299.860	0,06	1.600.000	EUR	Deutsche Bank perpetual, variabel	1.809.736	0,40
16.971	USD	United Community Banks	590.591	0,13	135.000	EUR	Renk 15/07/25, 5.75%	150.568	0,03
1.573	USD	UnitedHealth Group	802.183	0,17	500.000	EUR	Volkswagen International Finance perpetual, variabel	551.883	0,12
3.182	USD	Valero Energy	323.100	0,07	900.000	EUR	Volkswagen International Finance perpetual, variabel*	993.176	0,21
5.716	USD	Vaxcyte	138.041	0,03	200.000	EUR	Vonovia Finance 28/01/41, 1.00%	166.098	0,04
19.612	USD	Ventyx Biosciences	266.135	0,06					
3.710	USD	VeracYTE	102.285	0,02					
1.390	USD	Verisk Analytics	298.336	0,06					
1.609	USD	Vertex Pharmaceuticals	419.901	0,09					
8.574	USD	Verve Therapeutics	195.659	0,04					
1.456	USD	Viper Energy Partners	43.054	0,01					
2.290	USD	Waste Management	362.965	0,08					
1.156	USD	Waters	358.811	0,08					
15.074	USD	Western Alliance Bancorporation	1.248.429	0,27					

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
100.000	EUR	Wintershall Dea Finance 2 perpetual, variabel	97.415	0,02
1.100.000	EUR	Wintershall Dea Finance 2 Series NC8 perpetual, variabel	1.036.060	0,22
Ungarn			385.833	0,08
425.000	USD	Hungary Government International Bond 22/09/31, 2.13%	385.833	0,08
Japan			330.763	0,07
40.000.000	JPY	Development Bank of Japan 20/09/22, 1.70%	330.763	0,07
Luxemburg			401.989	0,09
380.000	EUR	Altice Financing 15/01/25, 2.25%	401.989	0,09
Mexiko			708.835	0,15
600.000	EUR	America Movil 02/03/24, ZCP	708.835	0,15
Niederlande			3.517.508	0,76
1.325.000	EUR	Aegon perpetual, variabel	1.299.679	0,28
2.000.000	EUR	Cooperatieve Rabobank perpetual, variabel	2.217.829	0,48
Peru			1.353.124	0,29
1.700.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/31, 6.95%	474.449	0,10
3.350.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/32, 6.15%	878.675	0,19
Saudi-Arabien			2.024.501	0,44
385.000	USD	EIG Pearl Holdings Sarl 31/08/36, 3.55%	368.250	0,08
1.765.000	USD	EIG Pearl Holdings Sarl 30/11/46, 4.39%	1.656.251	0,36
Südafrika			8.127.849	1,76
55.580.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	3.397.750	0,73
55.520.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	3.415.550	0,75
9.545.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/36, 6.25%	460.054	0,10
14.810.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/44, 8.75%	854.495	0,18
Südkorea			2.256.338	0,49
635.000	USD	Export-Import Bank of Korea 05/07/22, variabel	635.981	0,14
200.000	USD	Export-Import Bank of Korea 22/03/23, variabel	201.026	0,04

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
710.000	USD	Export-Import Bank of Korea 27/04/23, variabel	717.295	0,16
500.000	USD	Korea Development Bank 30/10/22, variabel	501.813	0,11
200.000	USD	Korea Development Bank 18/02/23, variabel	200.223	0,04
Spanien			1.149.423	0,25
325.000	EUR	Arena Luxembourg Finance Sarl 01/02/28, 1.88%	322.029	0,07
600.000	EUR	Cellnex Telecom 20/11/31, 0.75%	575.454	0,13
240.000	EUR	Cirsa Finance International Sarl 15/03/27, 4.50%	251.940	0,05
Supranational			3.841.407	0,83
127.500.000	ZAR	Asian Development Bank 30/04/40, ZCP	1.605.955	0,35
16.000.000	TRY	European Bank for Reconstruction & Development 15/10/26, ZCP	318.190	0,07
40.000.000	MXN	European Bank for Reconstruction & Development 19/01/32, ZCP	809.152	0,17
200.000	USD	European Investment Bank 19/01/23, variabel	200.084	0,04
575.000	EUR	European Union 06/07/51, 0.70%	548.354	0,12
11.750.000	MXN	International Bank for Reconstruction & Development 25/05/33, ZCP	240.766	0,05
7.200.000	TRY	International Finance 09/05/27, ZCP	118.906	0,03
Vereinigtes Königreich			1.353.707	0,29
290.000	GBP	B&M European Value Retail 15/11/28, 4.00%	358.227	0,08
375.000	GBP	CPUK Finance 28/08/27, 4.50%	475.363	0,10
460.000	GBP	Heathrow Funding 09/08/49, 2.75%	520.117	0,11
Vereinigte Staaten			1.672.969	0,36
1.670.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/22, 1.75%	1.672.969	0,36
Summe Anleihen			34.511.681	7,44
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			199.231.541	42,95

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien									
Vereinigte Staaten									
34.299	USD	Archaea Energy	752.177	0,16	100.000	CAD	Province of British Columbia 12/04/22, ZCP	79.978	0,02
Summe Aktien									
752.177 0,16									
Anleihen									
Kanada									
9.539.574 2,06									
200.000	CAD	Alberta Treasury Bill 12/04/22, ZCP	159.969	0,03	600.000	CAD	Province of Manitoba Canada Treasury Bill 20/04/22, ZCP	479.802	0,10
100.000	CAD	Alberta Treasury Bill 01/11/22, ZCP	79.637	0,02	200.000	CAD	Province of Manitoba Canada Treasury Bill 18/05/22, ZCP	159.853	0,03
500.000	USD	CDP Financial 15/06/22, ZCP	499.135	0,11	500.000	CAD	Province of Newfoundland & Labrador Canada 02/06/22, 1.95%	400.749	0,09
400.000	CAD	City of Edmonton Canada 21/06/22, ZCP	319.394	0,07	365.000	CAD	Province of Quebec Coupon Strip 01/06/22, ZCP	291.643	0,06
250.000	CAD	City of Montreal Canada 11/05/22, 0.25%	199.956	0,04	200.000	CAD	Quebec Treasury Bill 08/04/22, ZCP	159.970	0,03
300.000	CAD	City of Montreal Canada 19/05/22, ZCP	239.773	0,05	500.000	CAD	Regional Municipality of York 02/05/22, ZCP	399.765	0,09
300.000	CAD	City of Montreal Coupon Strip 01/12/22, ZCP	237.163	0,05	500.000	CAD	Regional Municipality of York 06/05/22, ZCP	399.741	0,09
400.000	CAD	City of Ottawa Ontario 13/04/22, ZCP	319.905	0,07	500.000	CAD	Societe de transport de Montreal 20/04/22, ZCP	399.848	0,09
250.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 13/04/22, ZCP	199.955	0,04	Deutschland				
85.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 27/04/22, ZCP	67.965	0,01	349.572 0,08				
500.000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 04/05/22, ZCP	399.768	0,09	350.000	USD	Erste Abwicklungsanstalt 02/06/22, ZCP	349.572	0,08
400.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 14/04/22, ZCP	319.903	0,07	Japan				
700.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 05/05/22, ZCP	559.651	0,13	19.107.121 4,12				
300.000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 19/05/22, ZCP	239.773	0,05	231.850.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 04/04/22, ZCP	1.904.486	0,41
195.000	CAD	Nova Scotia Treasury Bill 05/04/22, ZCP	155.973	0,03	19.350.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 11/04/22, ZCP	158.950	0,03
500.000	CAD	Ontario Teachers Finance Trust 03/05/22, ZCP	399.783	0,09	160.550.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill Series 1050 11/04/22, ZCP	1.318.829	0,28
320.000	CAD	Ontario Treasury Bill 06/04/22, ZCP	255.952	0,06	76.750.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 18/04/22, ZCP	630.471	0,14
200.000	CAD	Ontario Treasury Bill 07/09/22, ZCP	159.475	0,03	20.850.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 25/04/22, ZCP	171.278	0,04
300.000	CAD	Ontario Treasury Bill 14/09/22, ZCP	239.222	0,05	220.700.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill Series 1053 25/04/22, ZCP	1.812.989	0,39
200.000	CAD	Ontario Treasury Bill 07/12/22, ZCP	159.025	0,03	88.750.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 09/05/22, ZCP	729.083	0,16
750.000	CAD	Province of Alberta 01/04/22, ZCP	599.929	0,14	69.200.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 16/05/22, ZCP	568.492	0,12
600.000	CAD	Province of Alberta 23/09/22, ZCP	478.180	0,10	95.700.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 23/05/22, ZCP	786.203	0,17
					144.600.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 25/05/22, ZCP	1.188.024	0,26
					187.600.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 30/05/22, ZCP	1.541.195	0,33

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
167.850.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 06/06/22, ZCP	1.378.984	0,30	1.555.000	USD	United States Treasury Bill 03/05/22, ZCP	1.554.758	0,34
122.600.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 13/06/22, ZCP	1.007.253	0,22	3.980.000	USD	United States Treasury Bill 10/05/22, ZCP	3.978.815	0,86
306.950.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 20/06/22, ZCP	2.521.841	0,54	24.575.000	USD	United States Treasury Bill 12/05/22, ZCP	24.566.374	5,29
183.900.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 27/06/22, ZCP	1.510.876	0,33	1.920.000	USD	United States Treasury Bill 17/05/22, ZCP	1.919.406	0,41
228.600.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 04/07/22, ZCP	1.878.167	0,40	4.605.000	USD	United States Treasury Bill 19/05/22, ZCP	4.603.212	0,99
Südkorea			748.020	0,16	7.532.000	USD	United States Treasury Bill 24/05/22, ZCP	7.528.815	1,62
250.000	USD	Export-Import Bank of Korea 21/06/22, ZCP	249.494	0,05	1.000.000	USD	United States Treasury Bill 26/05/22, ZCP	999.867	0,22
500.000	USD	Korea Development Bank 12/07/22, ZCP	498.526	0,11	2.314.000	USD	United States Treasury Bill 31/05/22, ZCP	2.312.594	0,50
Vereinigte Staaten			115.776.691	24,94	2.020.000	USD	United States Treasury Bill 02/06/22, ZCP	2.019.654	0,44
240.000	USD	Adams Homes 15/02/25, 7.50%	240.229	0,05	2.320.000	USD	United States Treasury Bill 09/06/22, ZCP	2.319.502	0,50
1.760.000	USD	Community Health Systems 15/02/31, 4.75%	1.665.646	0,37	1.965.000	USD	United States Treasury Bill 16/06/22, ZCP	1.964.619	0,42
1.110.000	USD	Federal Home Loan Bank Discount Notes 13/04/22, ZCP	1.109.925	0,24	14.725.000	USD	United States Treasury Bill 23/06/22, ZCP	14.708.262	3,17
531.000	USD	Federal Home Loan Bank Discount Notes 18/04/22, ZCP	530.940	0,11	795.000	USD	United States Treasury Bill 30/06/22, ZCP	793.916	0,17
490.000	USD	Scripps Escrow II 15/01/31, 5.38%	469.851	0,10	500.000	USD	United States Treasury Bill 07/07/22, ZCP	499.714	0,11
7.820.000	USD	United States Cash Management Bill 07/06/22, ZCP	7.814.709	1,68	1.500.000	USD	United States Treasury Bill 11/08/22, ZCP	1.499.338	0,32
250.000	USD	United States Cash Management Bill 14/06/22, ZCP	249.743	0,05	2.182.000	USD	United States Treasury Bill 08/09/22, ZCP	2.180.214	0,47
4.797.000	USD	United States Cash Management Bill 21/06/22, ZCP	4.791.803	1,03	375.000	USD	United States Treasury Bill 06/10/22, ZCP	374.592	0,08
2.314.000	USD	United States Treasury Bill 05/04/22, ZCP	2.313.970	0,50	3.060.000	USD	United States Treasury Bill 03/11/22, ZCP	3.057.244	0,66
5.286.700	USD	United States Treasury Bill 07/04/22, ZCP	5.286.609	1,14	420.000	USD	United States Treasury Bill 01/12/22, ZCP	419.281	0,09
5.079.000	USD	United States Treasury Bill 12/04/22, ZCP	5.078.809	1,09	Summe Anleihen		145.520.978	31,36	
285.000	USD	United States Treasury Bill 14/04/22, ZCP	284.976	0,06	Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden				
2.185.000	USD	United States Treasury Bill 19/04/22, ZCP	2.184.808	0,47	Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden		146.273.155	31,52	
3.020.000	USD	United States Treasury Bill 21/04/22, ZCP	3.019.808	0,65	Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen				
2.030.000	USD	United States Treasury Bill 26/04/22, ZCP	2.029.888	0,44	Luxemburg		856.520	0,18	
1.405.000	USD	United States Treasury Bill 28/04/22, ZCP	1.404.800	0,30	135.454	EUR	UBS Lux Fund Solutions - Solactive China Technology UCITS ETF	856.520	0,18
					Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen		856.520	0,18	

* Notleidendes Wertpapier.

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Optionsscheine	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Vereinigte Staaten			15.358	-
10.500	USD	Churchill Capital VI Warrants 31/12/27	6.613	-
5.260	USD	Metals Acquisition Warrants 12/07/26	4.734	-
7.865	USD	Ribbit LEAP Warrants 09/09/25	4.011	-
Summe Optionsscheine			15.358	-
Summe Kapitalanlagen			346.376.574	74,65
Sonstiges Nettovermögen			117.616.540	25,35
Nettoinventarwert			463.993.114	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 54 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022

Die Gesellschaft

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft in der Rechtsform einer „Société Anonyme“, die nach den Gesetzen des Großherzogtums Luxemburg gegründet wurde und 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 Anlagerisiko zu streuen und die Erträge aus ihrem Portfoliomanagement an ihre Anteilsinhaber weiterzugeben.

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

Anteilklassen

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

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

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

Ausgabeaufschlag

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

Anteilklassen	Ausgabeaufschlag
A ¹ -, A2- und K-Anteile	Bis zu 3,09278 % des Nettoinventarwerts je Anteil
A1-Anteile	Bis zu 2,04081 % des Nettoinventarwerts je Anteil
C-, C1-, E- und F-Anteile	Bis zu 1,01010 % des Nettoinventarwerts je Anteil
I-, IF-, IZ-, N-, R-, S- und X-Anteile	Kein Ausgabeaufschlag

Vertriebsgebühr

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

Swing-Pricing

Der Nettoinventarwert je Anteil eines Teilfonds kann verwässert werden, wenn Anleger Anteile eines Teilfonds zu einem Kurs kaufen oder verkaufen, der die Handels- und sonstigen Kosten im Zusammenhang mit vom Anlageverwalter zur Berücksichtigung von Mittelzu- oder Mittelabflüssen vorgenommenen Wertpapiertransaktionen nicht berücksichtigt. Um diesen Auswirkungen entgegenzuwirken, kann ein Swing-Pricing-Mechanismus angewandt werden, um die Interessen der Anteilsinhaber 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 2022, dem letzten Berechnungstag des Berichtszeitraums, wurden Swing-Pricing-Anpassungen für den Schroder GAIA Wellington Pagosa vorgenommen. Die nachfolgende Tabelle stellt den offiziellen Nettoinventarwert je Anteil dieses Teilfonds nach Anwendung der Swing-Pricing-Anpassung zu diesem Termin dar. Alle sonstigen in diesem Bericht aufgeführten Finanzinformationen werden vor den Swing Pricing-Anpassungen ausgewiesen.

	Schroder GAIA Wellington Pagosa	
	Währung	
Nettoinventarwert je Anteil* (einschließlich Swing-Pricing-Anpassung) zum 31. März 2022		
Klasse A Thes.	USD	114,78
Klasse A Thes. In CHF abgesichert	CHF	105,48
Klasse A Thes. In EUR abgesichert	EUR	106,58
Klasse A Thes. In SGD abgesichert	SGD	157,97
Klasse C Thes.	USD	117,67
Klasse C Thes. In BRL abgesichert	USD	144,52
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	CHF	108,17
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	EUR	109,28

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

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Swing-Pricing (Forts.)

	Währung	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	GBP	90,27
Klasse C1 Thes. In CHF abgesichert	CHF	5.405,38
Klasse C1 Thes. In EUR abgesichert	EUR	5.466,17
Klasse E Thes.	USD	120,45
Klasse E Thes. In CHF abgesichert	CHF	110,50
Klasse E Thes. In EUR abgesichert	EUR	111,65
Klasse E Thes. In GBP abgesichert	GBP	92,40

Mindestanlage bei Erstzeichnung, Mindestanlage bei weiteren Zeichnungen und Mindestanlagebestand

Teilfonds	Anteilklassen	Mindestanlage bei Erstzeichnung		Mindestanlage bei Folgezeich- nungen		Mindestan- lagebestand	
Schroder GAIA BlueTrend	A-, C-, E- und N-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
Schroder GAIA Cat Bond	A-, C- und F-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
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A-, A1-, C- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
Schroder GAIA Egerton Equity	A-, A1-, C- und E-Anteile	EUR	10.000	EUR	5.000	EUR	10.000
	X-Anteile	EUR	100.000.000	EUR	2.500.000	EUR	100.000.000
Schroder GAIA Helix	A-, C-, C1-, E- und S-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
	IZ-Anteile	USD	100.000.000	USD	20.000.000	USD	100.000.000
	X-Anteile	USD	100.000.000	USD	2.500.000	USD	100.000.000
Schroder GAIA Oaktree Credit	A2-, C- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
Schroder GAIA Sirios US Equity	A-, C- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	X-Anteile	USD	100.000.000	USD	2.500.000	USD	100.000.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C- und K-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	C- und K-Anteile	GBP	10.000	GBP	5.000	GBP	10.000
	I-Anteile	GBP	5.000.000	GBP	2.500.000	GBP	5.000.000
	R-Anteile		Entfällt		Entfällt		Entfällt
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A-, C-, C1- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000

Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden

Der Abschluss wird im Einklang mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen für Investmentfonds auf der Grundlage der Unternehmensfortführung aufgestellt und dargestellt.

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Nettoinventarwert

Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil

Der Nettoinventarwert je Anteil wird für jede Anteilsklasse am Berechnungstag in der Währung der jeweiligen Anteilsklasse berechnet. Bei der Berechnung wird der der jeweiligen Anteilsklasse zuzurechnende Nettoinventarwert, der dem anteiligen Wert ihrer Vermögenswerte abzüglich ihrer Verbindlichkeiten entspricht, durch die Anzahl der ausgegebenen Anteile dieser Anteilsklasse dividiert. Die sich daraus ergebende Summe wird auf bis zu vier Dezimalstellen gerundet. 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 Wertpapieren, die nicht an einer amtlichen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden oder zum Handel zugelassen sind, oder bei Wertpapieren, die zwar gehandelt werden oder zum Handel zugelassen sind, deren letzter verfügbarer Kurs aber nicht ihren tatsächlichen Wert widerspiegelt, muss der Verwaltungsrat den erwarteten Verkaufspreis zugrunde legen, der mit der gebotenen Sorgfalt und in gutem Glauben anzusetzen ist.

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

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

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

Fair Value Pricing

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

Zum 31. März 2022 wurde die Fair-Value-Anpassung auf die folgenden Wertpapiere angewandt:

Teilfonds	Wertpapiername
Schroder GAIA Cat Bond	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP
	Vousoir Re perpetual, variabel
Schroder GAIA Helix	CFD auf MAGNIT PJSC
	CFD auf TRINITY LIMITED
	Fix Price Group
	Russian Federal Bond - OFZ 23/03/33, 7.70%
	Softline Holding
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Clementia Pharmaceuticals

Besteuerung

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

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

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

Von der Gesellschaft vereinnahmte Zins- und Dividendenerträge unterliegen gegebenenfalls einer nicht erstattungsfähigen Quellensteuer in den Herkunftsländern. Die Gesellschaft kann außerdem in den Herkunftsländern zu einer Steuer auf realisierten oder nicht realisierten Kapitalzuwachs seines Vermögens veranlagt werden, und in bestimmten Ländern werden Rückstellungen dafür anerkannt.

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Managementgebühren

Die Anlageverwalter sind berechtigt, Managementgebühren 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	Managementgebühren
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 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	1,00 %
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Egerton Equity	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C- und E-Anteile	1,25 %
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25 % (1,25 %)
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Helix	A-Anteile	2,00 %
	C-, C1- und IZ*-Anteile	1,00 %
	E-Anteile	0,75 %
	S*-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00 % (0,35 %)
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00 % (0,60 %)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Oaktree Credit	A2-Anteile	1,25 %
	C-Anteile	0,75 %
	E-Anteile	0,60 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Sirios US Equity	A-Anteile	2,00 %
	C-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	1,00 %
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25 % (1,25 %)
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C-Anteile	1,40 %
	K-Anteile	1,90 %
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	C- und R-Anteile	0,75 %
	K-Anteile	1,25 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A- und A1*-Anteile	2,00 %
	C- und C1-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	0,75 %
	I*-Anteile	Entfällt

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

Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

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

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Performancegebühren

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

Die Performancegebühr einer Anteilsklasse läuft an jedem Geschäftstag auf und wird am nächstfolgenden Berechnungstag in den Nettoinventarwerten der Teilfonds berücksichtigt, und zwar auf Grundlage der Differenz zwischen dem Nettoinventarwert je Anteil am gleichen Berechnungstag (vor Abzug etwaiger Rückstellungen für die Performancegebühr) und der Hurdle, multipliziert mit der durchschnittlichen Zahl der während des 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 während des Berichtszeitraums für die einzelnen Anteilsklassen erhobenen Performancegebühren sind auf den Seiten 134-135 aufgeführt.

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

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

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

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

Für den Schroder GAIA Cat Bond und den Schroder GAIA Oaktree Credit wird keine Performancegebühr berechnet.

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Gebühren der Verwahrstelle und der Verwaltungsstelle

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

Wiederanlage von Barsicherheiten

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

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

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

Devisenterminkontrakte

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

Am 31. März 2022 waren die folgenden Teilfonds in Devisenterminkontrakten engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Absicherung des Portfolios					
AUD	18.500.000	USD	13.696.457	20. Apr. 2022	149.634
AUD	2.005.000	USD	1.504.245	26. Apr. 2022	(3.517)
BRL	3.962.296	USD	767.074	26. Apr. 2022	60.043
BRL	81.287.585	USD	15.671.815	15. Jun. 2022	1.044.154
CAD	29.361.464	USD	23.314.302	20. Apr. 2022	170.471
CAD	1.705.000	USD	1.360.722	26. Apr. 2022	2.973
CHF	1.065.000	USD	1.149.909	26. Apr. 2022	3.475
CLP	4.906.352.623	USD	6.138.585	15. Jun. 2022	19.389
CNH	13.264.266	USD	2.086.957	6. Apr. 2022	(10)
CNH	119.596.705	USD	18.874.216	20. Apr. 2022	(74.331)
CNH	39.721.494	USD	6.229.936	18. Mai 2022	3.216
EUR	15.100.000	USD	16.600.831	20. Apr. 2022	111.248
EUR	1.100.000	USD	1.217.350	26. Apr. 2022	308
GBP	3.830.617	USD	5.042.267	20. Apr. 2022	(10.747)
HKD	13.420.000	USD	1.715.031	26. Apr. 2022	(1.504)
HUF	908.069.855	USD	2.664.073	20. Apr. 2022	64.326
IDR	277.651.663.282	USD	19.216.328	15. Jun. 2022	55.268
INR	2.287.535.245	USD	30.107.642	15. Jun. 2022	(153.927)
JPY	2.043.705.950	USD	17.198.976	20. Apr. 2022	(406.505)
JPY	87.365.000	USD	712.784	26. Apr. 2022	5.155
KRW	65.739.439	USD	54.210	26. Apr. 2022	4
KRW	22.107.385.332	USD	18.198.284	15. Jun. 2022	28.147
MXN	369.390.562	USD	17.814.239	20. Apr. 2022	705.632
MXN	10.880.000	USD	534.509	26. Apr. 2022	10.396
NOK	120.601.825	USD	13.662.085	20. Apr. 2022	33.988
NZD	20.600.000	USD	14.170.491	20. Apr. 2022	103.227
PHP	154.396.373	USD	2.956.986	15. Jun. 2022	15.232
PLN	13.801.060	USD	3.209.863	20. Apr. 2022	69.923
SEK	76.938.191	USD	8.029.308	20. Apr. 2022	155.831
SEK	4.965.000	USD	533.908	26. Apr. 2022	(5.643)
SGD	13.075.787	USD	9.643.367	20. Apr. 2022	3.422
THB	37.702.616	USD	1.137.077	20. Apr. 2022	(3.116)
TWD	356.300.816	USD	12.602.610	15. Jun. 2022	(158.332)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
USD	11.633.173	AUD	15.907.074	20. Apr. 2022	(272.276)
USD	735.808	AUD	980.000	26. Apr. 2022	2.286
USD	140.292	AUD	192.926	15. Jun. 2022	(4.258)
USD	754.945	BRL	3.962.296	26. Apr. 2022	(72.172)
USD	760.741	BRL	3.962.296	24. Mai 2022	(59.373)
USD	7.646.229	BRL	39.344.747	15. Jun. 2022	(444.619)
USD	6.390.300	CAD	8.153.467	20. Apr. 2022	(131253)
USD	958.767	CAD	1.205.000	26. Apr. 2022	(5.017)
USD	1.207.184	CHF	1.125.000	26. Apr. 2022	(11.179)
USD	2.366.115	CLP	1.949.517.998	15. Jun. 2022	(80.729)
USD	2.088.445	CNH	13.264.266	6. Apr. 2022	1.497
USD	15.306.877	CNH	97.517.814	20. Apr. 2022	(22.336)
USD	2.987	CNH	19.031	18. Mai 2022	2
USD	10.216	CZK	230.000	26. Apr. 2022	(180)
USD	30.427.786	EUR	27.300.000	20. Apr. 2022	213.227
USD	2.672.091	EUR	2.430.000	26. Apr. 2022	(17.825)
USD	17.905.177	GBP	13.630.617	20. Apr. 2022	1.347
USD	1.254.051	GBP	950.000	26. Apr. 2022	6.268
USD	1.516.906	HKD	11.865.000	26. Apr. 2022	1.929
USD	4.371.640	HUF	1.541.777.051	20. Apr. 2022	(260.803)
USD	6.242	HUF	2.125.000	26. Apr. 2022	(138)
USD	5.665.716	IDR	81.932.839.698	15. Jun. 2022	(21.181)
USD	23.116.505	INR	1.775.178.234	15. Jun. 2022	(128.243)
USD	37.638.180	JPY	4.361.369.653	20. Apr. 2022	1.802.215
USD	946.590	JPY	114.500.000	26. Apr. 2022	5.664
USD	1.917.478	KRW	2.345.247.212	26. Apr. 2022	(16.625)
USD	26.820.173	KRW	32.283.216.650	15. Jun. 2022	204.276
USD	4.325.660	MXN	90.364.952	20. Apr. 2022	(204.904)
USD	213.382	MXN	4.330.000	26. Apr. 2022	(3.478)
USD	11.649.372	NOK	104.977.287	20. Apr. 2022	(272.311)
USD	13.500.135	NZD	19.800.000	20. Apr. 2022	(219.264)
USD	13.870	NZD	20.000	26. Apr. 2022	14
USD	7.243.416	PHP	379.392.576	15. Jun. 2022	(60.109)
USD	5.502.896	PLN	24.365.044	20. Apr. 2022	(287.399)
USD	12.782	PLN	55.000	26. Apr. 2022	(281)
USD	16.282.906	SEK	160.749.509	20. Apr. 2022	(818.585)
USD	11.797.753	SGD	16.052.544	20. Apr. 2022	(45.164)
USD	150.903	SGD	205.000	26. Apr. 2022	(335)
USD	8.049.300	THB	267.565.716	20. Apr. 2022	1.868
USD	286.532	THB	9.556.609	26. Apr. 2022	(907)
USD	98.627	TRY	1.495.000	26. Apr. 2022	(1.532)
USD	24.893.822	TWD	688.656.465	15. Jun. 2022	841.583
USD	623.305	ZAR	9.259.315	20. Apr. 2022	(9.065)
USD	2.900.069	ZAR	42.830.000	26. Apr. 2022	(22.768)
ZAR	140.785.569	USD	9.256.075	20. Apr. 2022	358.948
ZAR	27.105.000	USD	1.844.503	26. Apr. 2022	5.217
					USD 1.949.862

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	144.968.203	USD	29.773.545	29. Apr. 2022	463.945
CHF	758.206	USD	813.598	29. Apr. 2022	7.618
EUR	60.262.238	USD	66.316.110	29. Apr. 2022	397.835
GBP	63.334.961	USD	83.427.671	29. Apr. 2022	(241.278)
USD	1.613.844	BRL	7.793.363	29. Apr. 2022	(11.696)
USD	4.112	EUR	3.721	29. Apr. 2022	(7)
USD	819	GBP	626	29. Apr. 2022	(2)
					USD 616.415
					USD 2.566.277
Schroder GAIA Cat Bond					
Absicherung des Portfolios					
USD	76.003.080	EUR	66.500.000	06 Mai 2022	2.365.704
					USD 2.365.704
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	207.300.385	USD	222.451.821	29. Apr. 2022	2.075.660
EUR	667.700.248	USD	734.814.386	29. Apr. 2022	4.370.185
GBP	10.503	USD	13.837	29. Apr. 2022	(41)
JPY	1.280.187	USD	10.530	28. Apr. 2022	(10)
SEK	6.673.454.141	USD	710.135.483	29. Apr. 2022	(55.844)
SGD	396.365	USD	291.965	29. Apr. 2022	448
USD	135.956,00	CHF	126.459,00	29. Apr. 2022	(1.010)
USD	1.375.988,00	EUR	1.251.455,00	29. Apr. 2022	(9.448)
USD	141.727,00	SEK	1.331.506,00	29. Apr. 2022	50
USD	812,00	SGD	1.102,00	29. Apr. 2022	(2)
					USD 6.379.988
					USD 8.745.692
Schroder GAIA Contour Tech Equity					
Absicherung des Portfolios					
AUD	4.194.290	USD	3.063.943	12. Mai 2022	76.302
EUR	4.060.962	USD	4.535.092	12. Mai 2022	(37.052)
GBP	3.314.317	USD	4.447.184	12. Mai 2022	(94.288)
JPY	1.299.546.284	USD	11.059.980	12. Mai 2022	(376.359)
NOK	71.519.659	USD	8.062.978	12. Mai 2022	57.384
USD	2.750.256	AUD	3.797.039	12. Mai 2022	(92.570)
USD	5.756.826	EUR	5.159.916	12. Mai 2022	41.551
USD	4.850.966	GBP	3.636.319	12. Mai 2022	75.164
USD	8.715.941	JPY	1.012.182.154	12. Mai 2022	394.752
USD	9.104.123	NOK	80.764.639	12. Mai 2022	(65.918)
					USD (21.034)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	4.010.619	USD	4.303.735	29. Apr. 2022	40.176
EUR	107.579.965	USD	118.393.523	29. Apr. 2022	704.006
GBP	23.700.386	USD	31.220.423	29. Apr. 2022	(91.491)
SEK	156.226.264	USD	16.624.612	29. Apr. 2022	(1.574)
SGD	891.928	USD	657.000	29. Apr. 2022	1.007
USD	126.363	CHF	117.736	29. Apr. 2022	(1.158)
USD	3.889.755	EUR	3.519.415	29. Apr. 2022	(6.449)
USD	1.106.274	GBP	842.306	29. Apr. 2022	(40)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)					
USD	431.472	SEK	4.047.820	29. Apr. 2022	770
USD	16.959	SGD	23.059	29. Apr. 2022	(52)
					USD 645.195
					USD 624.161
Schroder GAIA Egerton Equity					
Absicherung des Portfolios					
CHF	8.177.000	EUR	8.123.889	8. Apr. 2022	(124.586)
CNY	32.921.000	EUR	4.791.715	11. Apr. 2022	(102.736)
EUR	64.554.090	CAD	89.634.000	8. Apr. 2022	(250.676)
EUR	14.114.455	CNY	97.545.000	11. Apr. 2022	220.999
EUR	6.820.428	GBP	5.728.000	8. Apr. 2022	19.524
EUR	4.357.857	HKD	37.026.000	8. Apr. 2022	85.410
EUR	6.264.430	JPY	785.240.000	8. Apr. 2022	434.055
EUR	2.545.481	SEK	27.661.000	8. Apr. 2022	(113.761)
EUR	646.435.167	USD	703.789.000	8. Apr. 2022	10.310.725
GBP	4.740.000	EUR	5.717.629	8. Apr. 2022	(89.786)
HKD	13.242.000	EUR	1.531.852	8. Apr. 2022	(3.851)
USD	33.588.000	EUR	30.736.033	8. Apr. 2022	(377.292)
					EUR 10.008.025
Absicherung der Anteilsklasse					
EUR	863.101	GBP	719.395	29. Apr. 2022	9.598
EUR	5.919.930	USD	6.556.435	29. Apr. 2022	(2.448)
GBP	65.057.716	EUR	77.892.780	29. Apr. 2022	(707.295)
USD	304.224.377	EUR	276.510.702	29. Apr. 2022	(1.707.077)
					EUR (2.407.222)
					EUR 7.600.803
Schroder GAIA Helix					
Absicherung des Portfolios					
AUD	194.000	USD	141.187	7. Apr. 2022	3.988
AUD	19.065.000	USD	13.815.743	28. Apr. 2022	454.626
AUD	22.160.000	USD	15.858.603	18. Mai 2022	734.607
CAD	20.250.000	USD	16.019.669	28. Apr. 2022	176.508
CHF	20.647.000	EUR	20.002.716	28. Apr. 2022	218.477
CHF	24.683.000	USD	27.082.644	28. Apr. 2022	(349.361)
CLP	180.715.000	USD	215.355	12. Apr. 2022	14.026
DKK	13.512.000	EUR	1.815.641	28. Apr. 2022	922
DKK	43.836.000	USD	6.664.765	28. Apr. 2022	(140.991)
EUR	10.850.922	CHF	11.167.000	28. Apr. 2022	(82.316)
EUR	5.450.549	DKK	40.566.000	28. Apr. 2022	(3.218)
EUR	6.779.793	GBP	5.705.794	28. Apr. 2022	11.184
EUR	1.294.956	NOK	12.782.000	28. Apr. 2022	(17.875)
EUR	16.442.629	SEK	172.363.000	28. Apr. 2022	(137.266)
EUR	460.000	USD	520.905	11. Apr. 2022	(11.933)
EUR	85.876.501	USD	96.947.525	28. Apr. 2022	(1.879.881)
EUR	630.000	USD	693.083	6. Jun. 2022	5.523
GBP	12.943.720	EUR	15.405.257	28. Apr. 2022	(53.208)
GBP	73.990.373	USD	99.419.660	28. Apr. 2022	(2.237.553)
GBP	4.318.000	USD	5.830.031	18. Mai 2022	(159.055)
HKD	1.512.704.000	USD	194.024.348	28. Apr. 2022	(871.962)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)					
JPY	6.448.143.144	USD	56.232.360	28. Apr. 2022	(3.241.269)
MXN	4.920.000	USD	240.011	6. Jun. 2022	4.481
NOK	72.509.000	EUR	7.190.258	28. Apr. 2022	273.760
NOK	35.741.000	USD	3.988.530	28. Apr. 2022	69.947
NZD	551.000	USD	368.281	28. Apr. 2022	13.454
NZD	3.463.000	USD	2.288.370	18. Mai 2022	109.878
SEK	197.935.000	EUR	18.880.642	28. Apr. 2022	159.224
SEK	136.174.569	USD	14.696.912	28. Apr. 2022	(207.713)
SGD	7.150.000	USD	5.265.021	21. Apr. 2022	9.942
SGD	15.330.000	USD	11.377.091	28. Apr. 2022	(67.570)
SGD	14.312.000	USD	10.624.534	18. Mai 2022	(65.991)
USD	145.333	AUD	194.000	7. Apr. 2022	158
USD	2.307.509	AUD	3.148.000	28. Apr. 2022	(48.805)
USD	750.508	AUD	1.023.000	18. Mai 2022	(15.505)
USD	9.755.407	CAD	12.348.000	28. Apr. 2022	(120.663)
USD	20.759.335	CHF	19.273.000	28. Apr. 2022	(114.570)
USD	3.886.129	DKK	26.090.000	28. Apr. 2022	3.357
USD	522.578	EUR	460.000	11. Apr. 2022	13.606
USD	74.995.252	EUR	67.310.947	28. Apr. 2022	480.189
USD	701.025	EUR	630.000	6. Jun. 2022	2.419
USD	77.717.229	GBP	58.452.104	28. Apr. 2022	943.751
USD	51.502.823	HKD	402.684.000	28. Apr. 2022	85.379
USD	34.500.338	JPY	4.094.103.694	28. Apr. 2022	854.831
USD	232.703	MXN	4.920.000	6. Jun. 2022	(11.789)
USD	4.098.727	NOK	36.173.093	28. Apr. 2022	(8.812)
USD	11.008.395	SEK	103.592.514	28. Apr. 2022	(14.021)
USD	2.052.926	SGD	2.794.000	21. Apr. 2022	(8.366)
USD	864.102	SGD	1.173.000	28. Apr. 2022	(1.265)
USD	627.513	SGD	855.000	18. Mai 2022	(3.255)
					USD (5.229.976)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	6.101.796	USD	6.547.743	29. Apr. 2022	61.126
EUR	239.921.289	USD	264.037.882	29. Apr. 2022	1.569.506
GBP	187.658.979	USD	247.220.591	29. Apr. 2022	(742.595)
JPY	1.240.806	USD	10.206	28. Apr. 2022	(9)
SEK	128.266	USD	13.650	29. Apr. 2022	(2)
SGD	30.063	USD	22.144	29. Apr. 2022	34
USD	41.727	CHF	38.800	29. Apr. 2022	(298)
USD	2.774.186	EUR	2.519.079	29. Apr. 2022	(14.588)
USD	27.916.798	GBP	21.176.387	29. Apr. 2022	102.976
USD	17	JPY	2.119	28. Apr. 2022	-
USD	34	SEK	323	29. Apr. 2022	-
USD	50	SGD	67	29. Apr. 2022	-
					USD 976.150
					USD (4.253.826)
Schroder GAIA Oaktree Credit					
Absicherung des Portfolios					
AUD	8.479	USD	6.164	20. Apr. 2022	182
EUR	458.864	USD	515.314	20. Apr. 2022	(7.462)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)					
GBP	66.132	USD	88.522	20. Apr. 2022	(1.658)
USD	394.542	AUD	549.438	20. Apr. 2022	(16.678)
USD	7.802.433	EUR	6.879.671	20. Apr. 2022	188.285
USD	1.821.382	GBP	1.342.886	20. Apr. 2022	57.498
					USD 220.167
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	517.703	USD	555.539	29. Apr. 2022	5.186
EUR	1.999.120	USD	2.200.064	29. Apr. 2022	13.083
GBP	19.728	USD	25.987	29. Apr. 2022	(76)
USD	77	CHF	72	29. Apr. 2022	(1)
USD	1.135	EUR	1.031	29. Apr. 2022	(7)
					USD 18.185
					USD 238.352
Schroder GAIA Sirius US Equity					
Absicherung des Portfolios					
DKK	6.292.000	USD	938.902	15. Jun. 2022	(544)
EUR	566.000	USD	624.913	15. Jun. 2022	2.998
GBP	122.000	USD	160.883	15. Jun. 2022	(664)
USD	16.800.090	EUR	15.253.000	15. Jun. 2022	(121.328)
USD	18.906.832	GBP	14.519.000	15. Jun. 2022	(160.562)
USD	2.527.578	SEK	24.187.000	15. Jun. 2022	(49.678)
					USD (329.778)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	3.252.312	USD	3.490.006	29. Apr. 2022	32.580
EUR	51.677.425	USD	56.881.501	29. Apr. 2022	328.538
GBP	8.582.742	USD	11.306.003	29. Apr. 2022	(33.124)
USD	10.499	CHF	9.765	29. Apr. 2022	(78)
USD	1.247.976	EUR	1.128.044	29. Apr. 2022	(839)
USD	120.689	GBP	91.629	29. Apr. 2022	340
					USD 327.417
					USD (2.361)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
AUD	7.889.344	USD	5.776.091	15. Jun. 2022	134.969
BRL	28.464.106	USD	5.583.661	18. Apr. 2022	370.821
CAD	18.838.010	USD	15.029.881	15. Jun. 2022	35.934
CHF	21.845.013	USD	23.625.315	15. Jun. 2022	90.084
CNH	35.408.210	USD	5.566.209	15. Jun. 2022	(18.106)
CZK	47.183.850	USD	2.017.203	15. Jun. 2022	102.442
EUR	33.000.000	USD	36.463.851	15. Jun. 2022	145.786
GBP	1.000.000	USD	1.313.622	15. Jun. 2022	(350)
ILS	6.982.324	USD	2.127.484	15. Jun. 2022	65.485
JPY	8.051.353.113	USD	69.528.906	15. Jun. 2022	(3.264.152)
MXN	88.092.835	USD	4.079.860	15. Jun. 2022	290.911
NZD	12.947.081	USD	8.834.380	15. Jun. 2022	127.218
PLN	30.510.116	USD	6.786.406	15. Jun. 2022	421.947
SEK	6.161.951	USD	629.143	15. Jun. 2022	27.447
SGD	9.382.080	USD	6.886.244	15. Jun. 2022	35.920
USD	10.385.328	AUD	14.136.746	15. Jun. 2022	(206.574)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)						
USD	37.407.819	CAD	48.062.544	15. Jun. 2022	(1.030.501)	
USD	11.270.413	CHF	10.435.126	15. Jun. 2022	(58.176)	
USD	5.986.584	CNH	38.245.220	15. Jun. 2022	(6.050)	
USD	1.752.538	CZK	39.922.391	15. Jun. 2022	(40.900)	
USD	97.812.480	EUR	89.000.000	15. Jun. 2022	(922.601)	
USD	32.251.464	GBP	24.516.085	15. Jun. 2022	55.182	
USD	678.962	HUF	239.934.747	15. Jun. 2022	(36.080)	
USD	1.584.586	ILS	5.135.000	15. Jun. 2022	(28.186)	
USD	7.541	INR	580.429	18. Apr. 2022	(107)	
USD	24.661.615	JPY	2.993.657.444	15. Jun. 2022	23.027	
USD	2.984.158	KRW	3.600.506.566	15. Jun. 2022	15.721	
USD	5.557.356	MXN	119.976.548	15. Jun. 2022	(395.341)	
USD	6.350.165	NOK	56.753.072	15. Jun. 2022	(93.139)	
USD	2.779.565	PLN	12.120.526	15. Jun. 2022	(84.043)	
USD	3.021.643	SEK	29.740.903	15. Jun. 2022	(147.411)	
USD	3.553.064	SGD	4.829.133	15. Jun. 2022	(9.904)	
USD	224.104	TWD	6.252.435	15. Jun. 2022	5.729	
USD	119.841	TWD	3.409.000	18. Apr. 2022	860	
USD	518.894	ZAR	7.959.511	15. Jun. 2022	(20.702)	
ZAR	27.635.984	USD	1.799.111	15. Jun. 2022	74.405	
					USD	(4.338.435)
Absicherung der Anteilsklasse						
CHF	4.481.797	USD	4.809.349	29. Apr. 2022	44.894	
EUR	161.669.063	USD	177.935.819	29. Apr. 2022	1.041.614	
GBP	216.142.512	USD	284.724.071	29. Apr. 2022	(834.788)	
USD	1.774	CHF	1.649	29. Apr. 2022	(12)	
USD	25	EUR	23	29. Apr. 2022	-	
USD	223.179	GBP	169.987	29. Apr. 2022	(88)	
					USD	251.620
					USD	(4.086.815)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund						
Absicherung der Anteilsklasse						
CHF	284.591	GBP	231.853	29. Apr. 2022	2.830	
EUR	16.991.673	GBP	14.187.708	29. Apr. 2022	134.142	
GBP	1.265.459	EUR	1.518.360	29. Apr. 2022	(14.328)	
USD	2.198.755	GBP	1.669.184	29. Apr. 2022	4.864	
					GBP	127.508
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
Absicherung des Portfolios						
AUD	73.042.000	USD	54.272.279	6. Apr. 2022	386.171	
AUD	745.000	USD	534.165	11. Apr. 2022	23.359	
AUD	186.000	USD	132.767	27. Apr. 2022	6.455	
AUD	7.965.000	USD	5.969.995	6. Mai 2022	(7.407)	
AUD	850.000	USD	634.257	15. Jun. 2022	2.603	
BRL	159.678.000	USD	31.612.203	4. Apr. 2022	1.926.195	
BRL	4.171.000	USD	713.601	27. Apr. 2022	156.850	
BRL	21.048.000	USD	4.355.510	3. Mai 2022	30.017	
BRL	17.895.000	USD	3.478.686	2. Jun. 2022	214.649	
BRL	4.077.000	USD	689.661	5. Jul. 2022	144.098	

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
BRL	5.910.000	USD	1.060.565	14. Jul. 2022	144.882
BRL	3.475.000	USD	595.544	10. Feb. 2023	74.632
CAD	27.485.000	USD	21.683.609	6. Apr. 2022	301.664
CAD	7.505.000	USD	5.997.052	6. Mai 2022	5.311
CAD	2.170.000	USD	1.715.885	15. Jun. 2022	19.586
CAD	1.793.000	USD	1.409.591	9. Aug. 2022	24.144
CHF	15.130.000	USD	16.182.444	6. Apr. 2022	192.138
CHF	3.675.000	USD	3.939.620	6. Mai 2022	41.876
CHF	1.333.000	USD	1.461.046	15. Jun. 2022	(13.914)
CLP	10.315.100.000	USD	12.970.329	6. Apr. 2022	135.627
CLP	729.076.000	USD	855.790	3. Mai 2022	65.981
CLP	4.092.069.000	USD	5.166.007	6. Mai 2022	4.847
CLP	1.735.606.000	USD	2.129.287	15. Jun. 2022	49.076
CLP	181.097.000	USD	208.157	22. Jun. 2022	18.877
CLP	723.258.000	USD	870.556	12. Sep. 2022	23.763
CNH	125.382.000	USD	19.716.016	6. Apr. 2022	11.094
CNH	56.533.000	USD	8.878.962	15. Jun. 2022	(20.822)
CNH	4.793.000	USD	742.180	11. Jul. 2022	7.980
COP	32.589.777.000	USD	8.401.919	6. Apr. 2022	233.254
COP	16.394.677.000	USD	4.348.605	6. Mai 2022	(21.830)
COP	3.581.300.000	USD	929.357	15. Jun. 2022	10.052
CZK	122.337.000	USD	5.441.888	6. Apr. 2022	100.937
CZK	112.407.000	USD	5.069.335	6. Mai 2022	5.126
CZK	73.530.000	USD	3.210.792	15. Jun. 2022	92.406
EGP	4.000	USD	245	15. Jun. 2022	(28)
EUR	60.400.000	USD	66.574.929	6. Apr. 2022	246.176
EUR	20.848.000	USD	23.034.994	29. Apr. 2022	45.004
EUR	7.360.000	USD	8.159.999	6. Mai 2022	(10.057)
EUR	5.896.000	USD	6.559.749	15. Jun. 2022	(18.828)
EUR	228.000	USD	254.475	3. Aug. 2022	(851)
EUR	188.000	USD	209.840	4. Aug. 2022	(699)
EUR	294.000	USD	326.987	16. Sep. 2022	907
GBP	29.211.000	USD	38.449.231	6. Apr. 2022	(76.919)
GBP	2.675.000	USD	3.518.003	29. Apr. 2022	(4.562)
GBP	8.641.000	USD	11.338.708	6. Mai 2022	10.288
GBP	4.083.000	USD	5.453.476	15. Jun. 2022	(91.387)
GBP	215.000	USD	292.111	25. Aug. 2022	(9.692)
HKD	2.172.000	USD	277.503	6. Apr. 2022	(220)
HKD	10.935.000	USD	1.399.948	15. Jun. 2022	(2.503)
HUF	2.507.839.030	USD	7.391.822	6. Apr. 2022	157.847
HUF	407.956.447	USD	1.210.435	6. Mai 2022	12.523
HUF	605.300.000	USD	1.752.144	15. Jun. 2022	51.739
HUF	2.143.400.000	USD	7.086.565	29. Jul. 2022	(738.613)
HUF	230.957.000	USD	661.865	26. Sep. 2022	16.163
HUF	228.812.000	USD	651.886	28. Sep. 2022	19.646
IDR	57.031.000.000	USD	3.991.521	6. Apr. 2022	(21.013)
IDR	52.299.000.000	USD	3.659.576	18. Apr. 2022	(20.262)
IDR	832.000.000	USD	57.858	6. Mai 2022	(4)
IDR	52.299.000.000	USD	3.650.890	18. Mai 2022	(16.230)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
IDR	43.125.000.000	USD	2.998.803	15. Jun. 2022	(5.531)
ILS	9.900.000	USD	3.085.134	6. Apr. 2022	17.321
ILS	1.245.000	USD	387.305	15. Jun. 2022	3.718
INR	1.453.861.000	USD	19.050.058	6. Apr. 2022	132.154
INR	22.757.000	USD	296.643	2. Mai 2022	2.793
INR	490.360.000	USD	6.451.663	6. Mai 2022	(2.302)
INR	85.980.000	USD	1.116.202	15. Jun. 2022	9.647
INR	26.723.000	USD	347.747	17. Aug. 2022	(131)
JPY	2.798.858.796	USD	23.497.055	6. Apr. 2022	(505.858)
JPY	666.200.000	USD	5.387.004	6. Mai 2022	88.864
JPY	442.000.000	USD	3.850.718	15. Jun. 2022	(212.941)
KRW	18.189.300.000	USD	14.859.245	6. Apr. 2022	147.101
KRW	1.608.810.000	USD	1.313.207	6. Mai 2022	13.351
KRW	1.369.900.000	USD	1.136.340	15. Jun. 2022	(6.926)
KRW	482.822.000	USD	388.386	19. Sep. 2022	10.248
MXN	791.271.135	USD	38.717.855	6. Apr. 2022	1.050.852
MXN	3.696.000	USD	176.126	20. Apr. 2022	9.178
MXN	292.840.000	USD	14.616.835	6. Mai 2022	23.074
MXN	119.894.000	USD	5.651.143	15. Jun. 2022	297.458
NOK	247.184.550	USD	27.600.483	6. Apr. 2022	475.764
NOK	134.749.451	USD	15.579.556	6. Mai 2022	(279.744)
NZD	50.155.000	USD	34.539.538	6. Apr. 2022	219.767
NZD	621.000	USD	414.952	26. Apr. 2022	15.293
NZD	3.830.000	USD	2.659.115	6. Mai 2022	(6.066)
NZD	640.000	USD	439.491	15. Jun. 2022	3.499
PEN	19.719.000	USD	5.309.496	6. Apr. 2022	50.841
PEN	3.353.000	USD	893.221	15. Jun. 2022	12.324
PHP	221.910.000	USD	4.265.859	6. Apr. 2022	22.269
PHP	214.630.000	USD	4.123.709	6. Mai 2022	16.815
PHP	77.630.000	USD	1.491.973	15. Jun. 2022	2.450
PLN	71.085.865	USD	16.647.175	6. Apr. 2022	268.216
PLN	21.649.893	USD	5.046.908	6. Mai 2022	89.872
PLN	1.763.000	USD	388.549	10. Jun. 2022	28.184
PLN	12.065.000	USD	2.781.628	15. Jun. 2022	68.861
PLN	3.055.000	USD	700.367	26. Sep. 2022	13.602
PLN	2.918.000	USD	664.239	28. Sep. 2022	17.567
RON	3.010.000	USD	666.298	15. Jun. 2022	749
RUB	40.050.000	USD	400.500	6. Apr. 2022	91.824
RUB	18.864.000	USD	177.544	19. Apr. 2022	51.101
RUB	35.930.000	USD	352.567	25. Apr. 2022	79.366
RUB	86.621.000	USD	824.962	26. Apr. 2022	214.937
RUB	28.985.000	USD	362.334	28. Apr. 2022	(15.309)
RUB	25.364.000	USD	311.796	4. Mai 2022	(10.578)
RUB	28.770.000	USD	371.465	12. Mai 2022	(32.089)
RUB	58.365.000	USD	750.067	13. Jul. 2022	(97.291)
RUB	10.545.000	USD	124.351	24. Aug. 2022	(10.701)
SEK	264.446.000	USD	27.607.422	6. Apr. 2022	518.891
SEK	61.418.000	USD	6.480.996	6. Mai 2022	55.115
SEK	770.000	USD	82.054	15. Jun. 2022	(7)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
SGD	8.905.474	USD	6.551.271	6. Apr. 2022	19.254
SGD	2.345.333	USD	1.729.639	6. Mai 2022	570
SGD	3.630.000	USD	2.675.186	15. Jun. 2022	3.054
THB	72.899.000	USD	2.229.532	5. Apr. 2022	(37.083)
THB	69.501.000	USD	2.067.067	12. Apr. 2022	23.184
THB	76.055.000	USD	2.290.123	10. Jun. 2022	(724)
THB	162.887.000	USD	4.901.884	15. Jun. 2022	2.061
TRY	35.052.000	USD	2.346.419	6. Apr. 2022	40.256
TRY	14.297.000	USD	927.022	6. Mai 2022	22.561
TRY	10.895.000	USD	703.490	15. Jun. 2022	(1.197)
TRY	19.156.000	USD	1.264.422	21. Jul. 2022	(66.433)
TRY	16.545.000	USD	916.367	15. Sep. 2022	70.581
TWD	785.377.000	USD	27.500.559	6. Apr. 2022	(89.322)
TWD	16.955.000	USD	597.714	29. Apr. 2022	(5.942)
TWD	46.205.000	USD	1.615.688	6. Mai 2022	(2.965)
TWD	59.720.000	USD	2.119.060	15. Jun. 2022	(33.261)
USD	53.147.598	AUD	73.042.000	6. Apr. 2022	(1.510.853)
USD	594.527	AUD	814.000	11. Apr. 2022	(14.633)
USD	117.785	AUD	165.000	27. Apr. 2022	(5.718)
USD	687.211	AUD	925.000	29. Apr. 2022	(5.170)
USD	31.551.427	AUD	42.125.000	6. Mai 2022	16.702
USD	1.840.779	AUD	2.520.000	15. Jun. 2022	(47.322)
USD	31.605.396	BRL	159.678.000	4. Apr. 2022	(1.933.003)
USD	987.333	BRL	5.534.000	27. Apr. 2022	(167.565)
USD	10.172.319	BRL	49.000.000	3. Mai 2022	(37.239)
USD	2.116.469	BRL	11.056.000	2. Jun. 2022	(165.369)
USD	937.722	BRL	5.270.000	5. Jul. 2022	(140.009)
USD	1.674.963	BRL	8.558.000	14. Jul. 2022	(70.591)
USD	586.158	CAD	750.000	1. Apr. 2022	(13.770)
USD	154.667	CAD	195.000	5. Apr. 2022	(1.313)
USD	21.937.034	CAD	27.805.000	6. Apr. 2022	(304.208)
USD	160.644	CAD	200.000	8. Apr. 2022	664
USD	240.512	CAD	300.000	12. Apr. 2022	546
USD	514.307	CAD	650.000	13. Apr. 2022	(5.617)
USD	313.357	CAD	400.000	14. Apr. 2022	(6.595)
USD	868.139	CAD	1.100.000	20. Apr. 2022	(11.698)
USD	143.961	CAD	180.000	26. Apr. 2022	(7)
USD	67.718	CAD	85.000	27. Apr. 2022	(266)
USD	932.455	CAD	1.175.000	29. Apr. 2022	(7.318)
USD	394.629	CAD	500.000	2. Mai 2022	(5.267)
USD	393.154	CAD	500.000	3. Mai 2022	(6.740)
USD	393.936	CAD	500.000	4. Mai 2022	(5.955)
USD	549.394	CAD	700.000	5. Mai 2022	(10.452)
USD	4.857.623	CAD	6.101.000	6. Mai 2022	(21.846)
USD	206.871	CAD	250.000	11. Mai 2022	6.925
USD	156.919	CAD	200.000	18. Mai 2022	(3.038)
USD	471.745	CAD	600.000	19. Mai 2022	(8.125)
USD	285.967	CAD	365.000	1. Jun. 2022	(5.955)
USD	399.990	CAD	500.000	2. Jun. 2022	97

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	6.870.888	CAD	8.749.000	15. Jun. 2022	(126.180)
USD	318.300	CAD	400.000	21. Jun. 2022	(1.597)
USD	327.397	CAD	420.000	23. Aug. 2022	(8.434)
USD	158.936	CAD	200.000	7. Sep. 2022	(978)
USD	241.612	CAD	300.000	14. Sep. 2022	1.747
USD	471.828	CAD	600.000	23. Sep. 2022	(7.889)
USD	80.000	CAD	100.000	1. Nov. 2022	52
USD	234.054	CAD	300.000	1. Dez. 2022	(5.778)
USD	157.593	CAD	200.000	7. Dez. 2022	(2.294)
USD	16.214.147	CHF	15.035.000	6. Apr. 2022	(57.623)
USD	158.247	CHF	148.000	29. Apr. 2022	(2.052)
USD	10.679.975	CHF	9.920.000	6. Mai 2022	(67.353)
USD	497.947	CHF	455.000	15. Jun. 2022	3.990
USD	12.904.684	CLP	10.315.100.000	6. Apr. 2022	(201.273)
USD	3.369.834	CLP	2.652.300.000	6. Mai 2022	18.313
USD	863.683	CLP	708.000.000	15. Jun. 2022	(24.929)
USD	1.510.487	CLP	1.230.292.000	22. Jun. 2022	(31.884)
USD	19.652.997	CNH	125.382.000	6. Apr. 2022	(74.113)
USD	9.807.157	CNH	62.756.000	6. Mai 2022	(47.385)
USD	2.525.915	CNH	16.145.000	15. Jun. 2022	(3.842)
USD	539.769	CNH	3.478.000	16. Sep. 2022	(3.228)
USD	364.830	CNH	2.361.000	19. Sep. 2022	(3.736)
USD	134.015	CNY	854.000	15. Jun. 2022	(66)
USD	8.581.070	COP	32.589.777.000	6. Apr. 2022	(54.102)
USD	708.108	COP	2.705.150.000	15. Jun. 2022	(1.478)
USD	5.331.362	CZK	122.337.000	6. Apr. 2022	(211.462)
USD	288.424	CZK	6.500.000	6. Mai 2022	(5.010)
USD	1.989.830	CZK	45.410.000	15. Jun. 2022	(50.129)
USD	930.899	DKK	6.155.000	15. Jun. 2022	12.970
USD	246	EGP	4.000	15. Jun. 2022	29
USD	67.063.284	EUR	60.400.000	6. Apr. 2022	242.175
USD	54.627.380	EUR	49.370.000	29. Apr. 2022	(28.195)
USD	13.548.006	EUR	12.334.000	6. Mai 2022	(109.789)
USD	436.787	EUR	380.000	9. Mai 2022	15.945
USD	386.111	EUR	353.000	10. Jun. 2022	(5.406)
USD	10.997.584	EUR	9.865.000	15. Jun. 2022	53.521
USD	310.387	EUR	274.000	3. Aug. 2022	5.593
USD	303.899	EUR	267.000	4. Aug. 2022	6.875
USD	389.382	EUR	352.000	16. Sep. 2022	(3.198)
USD	38.403.647	GBP	29.047.000	6. Apr. 2022	246.766
USD	10.856.552	GBP	8.237.000	29. Apr. 2022	37.783
USD	12.857.479	GBP	9.804.000	6. Mai 2022	(18.987)
USD	3.882.130	GBP	2.922.000	15. Jun. 2022	44.751
USD	273.600	GBP	200.000	1. Aug. 2022	10.911
USD	278.133	HKD	2.172.000	6. Apr. 2022	851
USD	542.603	HKD	4.245.000	29. Apr. 2022	568
USD	1.811.460	HKD	14.156.000	15. Jun. 2022	2.384
USD	7.254.438	HUF	2.498.906.110	6. Apr. 2022	(268.339)
USD	1.593.643	HUF	546.500.000	6. Mai 2022	(44.635)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	2.824.081	HUF	968.500.000	15. Jun. 2022	(62.192)
USD	6.920.668	HUF	2.143.400.000	29. Jul. 2022	572.716
USD	3.965.815	IDR	57.031.000.000	6. Apr. 2022	(4.692)
USD	948.768	IDR	13.601.000.000	15. Jun. 2022	4.733
USD	7.141.989	IDR	104.598.000.000	21. Feb. 2023	(13.572)
USD	3.035.238	ILS	9.900.000	6. Apr. 2022	(67.217)
USD	1.385.046	ILS	4.455.000	6. Mai 2022	(11.805)
USD	1.095.389	ILS	3.530.000	15. Jun. 2022	(13.293)
USD	19.215.838	INR	1.453.861.000	6. Apr. 2022	33.626
USD	564.980	INR	43.230.000	29. Apr. 2022	(4.017)
USD	502.769	INR	38.668.000	2. Mai 2022	(6.024)
USD	16.037.655	INR	1.227.041.000	6. Mai 2022	(100.755)
USD	2.157.241	INR	165.718.000	15. Jun. 2022	(12.722)
USD	2.006.925	JPY	231.850.000	4. Apr. 2022	102.456
USD	23.631.830	JPY	2.796.208.473	6. Apr. 2022	662.405
USD	1.568.810	JPY	179.900.000	11. Apr. 2022	90.906
USD	675.505	JPY	76.750.000	18. Apr. 2022	44.901
USD	2.126.347	JPY	241.550.000	25. Apr. 2022	141.403
USD	2.797.203	JPY	336.800.000	28. Apr. 2022	29.367
USD	4.490.014	JPY	551.100.502	6. Mai 2022	(39.787)
USD	770.325	JPY	88.750.000	9. Mai 2022	40.773
USD	602.937	JPY	69.200.000	16. Mai 2022	33.972
USD	829.498	JPY	95.700.000	23. Mai 2022	42.485
USD	1.261.312	JPY	144.600.000	25. Mai 2022	72.085
USD	1.632.195	JPY	187.600.000	31. Mai 2022	89.046
USD	1.459.558	JPY	167.850.000	6. Jun. 2022	78.584
USD	1.064.642	JPY	122.600.000	13. Jun. 2022	55.689
USD	1.976.303	JPY	233.101.000	15. Jun. 2022	57.820
USD	2.641.515	JPY	306.950.000	21. Jun. 2022	114.656
USD	1.551.448	JPY	183.900.000	27. Jun. 2022	37.207
USD	1.891.341	JPY	228.600.000	5. Jul. 2022	8.410
USD	355.159	JPY	40.000.000	20. Sep. 2022	24.363
USD	16.906.294	KRW	20.399.840.000	6. Apr. 2022	76.233
USD	4.123.258	KRW	5.038.950.000	6. Mai 2022	(31.652)
USD	1.034.992	KRW	1.249.400.000	15. Jun. 2022	4.924
USD	38.499.306	MXN	791.725.657	6. Apr. 2022	(1.292.242)
USD	60.747	MXN	1.291.000	20. Apr. 2022	(3.979)
USD	7.375.073	MXN	147.924.447	6. Mai 2022	(20.093)
USD	5.827.344	MXN	122.161.000	15. Jun. 2022	(233.735)
USD	356.875	MXN	7.605.000	4. Aug. 2022	(16.924)
USD	445.815	MXN	9.322.000	28. Sep. 2022	(7.514)
USD	28.212.203	NOK	247.113.400	6. Apr. 2022	144.039
USD	1.094.063	NOK	9.400.000	6. Mai 2022	26.762
USD	34.129.166	NZD	50.155.000	6. Apr. 2022	(630.139)
USD	422.745	NZD	621.000	26. Apr. 2022	(7.500)
USD	11.970.435	NZD	17.252.000	6. Mai 2022	19.938
USD	1.611.101	NZD	2.364.000	15. Jun. 2022	(25.192)
USD	5.245.594	PEN	19.719.000	6. Apr. 2022	(114.744)
USD	4.740.023	PEN	17.649.000	6. Mai 2022	(44.538)
USD	717.609	PEN	2.695.000	15. Jun. 2022	(10.229)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
USD	4.252.447	PHP	221.910.000	6. Apr. 2022	(35.680)	
USD	4.251.557	PHP	221.910.000	6. Mai 2022	(29.409)	
USD	1.795.034	PHP	93.550.000	15. Jun. 2022	(5.858)	
USD	16.579.818	PLN	71.048.780	6. Apr. 2022	(326.749)	
USD	6.473.419	PLN	27.620.000	6. Mai 2022	(79.862)	
USD	2.911.222	PLN	12.642.000	15. Jun. 2022	(75.592)	
USD	671.703	RON	3.010.000	15. Jun. 2022	4.656	
USD	443.522	RUB	40.050.000	6. Apr. 2022	(48.802)	
USD	248.865	RUB	18.864.000	19. Apr. 2022	20.221	
USD	11.911	RUB	1.471.000	25. Apr. 2022	(5.773)	
USD	656.713	RUB	86.621.000	26. Apr. 2022	(383.186)	
USD	208.525	RUB	28.985.000	28. Apr. 2022	(138.499)	
USD	333.474	RUB	25.364.000	4. Mai 2022	32.256	
USD	202.250	RUB	28.770.000	12. Mai 2022	(137.127)	
USD	390.401	RUB	58.365.000	13. Jul. 2022	(262.375)	
USD	68.922	RUB	10.545.000	24. Aug. 2022	(44.728)	
USD	27.701.775	SEK	263.986.000	6. Apr. 2022	(375.613)	
USD	2.225.268	SEK	20.607.000	6. Mai 2022	32.268	
USD	1.123.543	SEK	10.614.000	15. Jun. 2022	(7.436)	
USD	6.571.639	SGD	8.908.275	6. Apr. 2022	(954)	
USD	4.657.109	SGD	6.338.000	6. Mai 2022	(18.587)	
USD	479.924	SGD	650.000	15. Jun. 2022	349	
USD	14.023.238	THB	464.060.000	5. Apr. 2022	66.560	
USD	2.849.417	THB	94.622.000	12. Apr. 2022	3.648	
USD	11.763.179	THB	391.161.000	6. Mai 2022	(2.913)	
USD	3.499.442	THB	117.310.000	15. Jun. 2022	(32.343)	
USD	2.339.150	TRY	35.052.000	6. Apr. 2022	(47.525)	
USD	2.870.226	TRY	44.080.000	6. Mai 2022	(57.497)	
USD	3.284.545	TRY	51.347.000	15. Jun. 2022	(25.289)	
USD	27.770.412	TWD	785.377.000	6. Apr. 2022	359.174	
USD	6.755.461	TWD	194.211.000	6. Mai 2022	(23.212)	
USD	4.348.330	TWD	121.565.000	15. Jun. 2022	102.511	
USD	22.104.662	ZAR	332.565.701	6. Apr. 2022	(648.636)	
USD	1.575.445	ZAR	23.269.320	6. Mai 2022	(10.446)	
USD	11.331.144	ZAR	175.374.000	15. Jun. 2022	(557.917)	
USD	1.063.263	ZAR	16.538.000	27. Jul. 2022	(52.227)	
USD	434.537	ZAR	6.550.000	28. Sep. 2022	(3.941)	
ZAR	331.952.436	USD	21.734.641	6. Apr. 2022	976.696	
ZAR	164.540.000	USD	11.163.829	6. Mai 2022	50.189	
ZAR	36.520.000	USD	2.405.057	15. Jun. 2022	70.729	
ZAR	15.988.000	USD	1.016.402	27. Jul. 2022	61.992	
					USD	(258.545)
Absicherung der Anteilsklasse						
BRL	122.810.733	USD	25.213.950	29. Apr. 2022	401.931	
CHF	4.520.194	USD	4.851.211	29. Apr. 2022	44.619	
EUR	127.700.488	USD	140.552.683	29. Apr. 2022	819.483	
GBP	50.247.059	USD	66.191.122	29. Apr. 2022	(194.844)	

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
SGD	2.758.934	USD	2.032.244	29. Apr. 2022	3.118
USD	1.579.493	BRL	7.628.258	29. Apr. 2022	(11.610)
USD	142	EUR	129	29. Apr. 2022	(1)
USD	1.947	GBP	1.475	29. Apr. 2022	10
					USD 1.062.706
					USD 804.161

Die Devisenterminkontrakte waren mit den folgenden Kontrahenten verbunden:

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend		
	HSBC	616.414
	UBS	1.949.863
		USD 2.566.277
Schroder GAIA Cat Bond		
	Brown Brothers Harriman & Co	2.365.704
	HSBC	6.379.988
		USD 8.745.692
Schroder GAIA Contour Tech Equity		
	HSBC	645.195
	Morgan Stanley	(21.034)
		USD 624.161
Schroder GAIA Egerton Equity		
	Brown Brothers Harriman & Co	9.889.762
	HSBC	(2.288.959)
		EUR 7.600.803
Schroder GAIA Helix		
	Goldman Sachs	(3.815.792)
	HSBC	976.150
	J.P. Morgan	(1.414.184)
		USD (4.253.826)
Schroder GAIA Oaktree Credit		
	HSBC	18.185
	State Street	220.167
		USD 238.352
Schroder GAIA Sirius US Equity		
	HSBC	327.417
	Morgan Stanley	(329.778)
		USD (2.361)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
	Citi Bank	(2.866.254)
	Deutsche Bank	156.931
	HSBC	251.620
	Morgan Stanley	21.451
	Newedge Group	(1.650.563)
		USD (4.086.815)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund		
	HSBC	127.508
		GBP 127.508

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Bank of America	384.272
	Barclays Bank	(1.526.453)
	BNP Paribas	(130.219)
	Citi Bank	(9.807)
	Credit Suisse	4.452
	Deutsche Bank	(23.859)
	Goldman Sachs	(529.678)
	HSBC	1.091.175
	J.P. Morgan	1.155.507
	Morgan Stanley	(195.168)
	Standard Chartered Bank	131.018
UBS	452.921	
	USD	804.161

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 2022 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	1.000.000	JPY	135.557.000	1. Apr. 2022	(7.246)
EUR	1.000.000	USD	1.112.302	1. Apr. 2022	(6.052)
GBP	169.987	USD	223.220	4. Apr. 2022	83
JPY	135.557.000	USD	1.114.870	1. Apr. 2022	(1.374)
NOK	9.691.870	EUR	1.000.000	4. Apr. 2022	(5.383)
SGD	361.574	USD	267.000	1. Apr. 2022	(225)
USD	2.231.504	EUR	2.000.000	1. Apr. 2022	19.004
USD	1.186.362	EUR	1.063.820	5. Apr. 2022	9.511
				USD	8.318

Kontrahenten von Kassageschäften

Fonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Brown Brothers Harriman & Co	9.594
	Citi Bank	1.528
	Deutsche Bank	2.474
	Morgan Stanley	(225)
	Newedge Group	(5.053)
	USD	8.318

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Terminkontrakte

Terminkontrakte wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Terminkontrakten“ aufgeführt. Zum 31. März 2022 hielten die folgenden Teilfonds offene Terminkontrakte auf Indizes (mit Aktienbezug), Rentenwerte und Währungen:

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/Long-Position	Marktpreis	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Jun. 22	90	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(67.248.593)	9,98	6.053
Sep. 22	90	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(67.200.329)	9,96	98.207
Dez. 22	110	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(82.074.470)	9,95	169.428
Mrz. 23	7	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	5.219.018	9,94	(14.668)
Dez. 22	1	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	247.525	97,34	(4.175)
Mrz. 23	1	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	246.938	97,04	(4.338)
Juni 23	1	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	244.188	96,87	(2.013)
Sep. 24	23	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(5.616.425)	97,24	25.412
Dez. 24	24	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(5.861.550)	97,30	23.850
Mrz. 25	26	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(6.347.750)	97,40	17.075
Jun. 25	25	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(6.104.800)	97,49	11.675
Sep. 25	24	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(5.863.863)	97,57	9.962
Dez. 25	24	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(5.863.200)	97,61	6.600
Mrz. 26	22	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(5.376.063)	97,66	5.038
Apr. 22	4	Amsterdam Index Future	Morgan Stanley	EUR	618.633	724,01	22.116
Jun. 22	28	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(2.760.445)	126,74	104.874
Jun. 22	206	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(17.214.649)	109,89	275.407
Sep. 22	311	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(60.893.543)	97,49	265.148
Dez. 22	4	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	782.756	97,09	(6.129)
Mrz. 23	3	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	586.690	96,86	(5.599)
Juni 23	5	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	974.333	96,74	(7.049)
Apr. 22	1.319	BIST 30 Index Future	Morgan Stanley	TRY	2.018.589	2.519,75	246.683
Apr. 22	13	CAC 40 Index Future	Morgan Stanley	EUR	950.805	6.657,50	6.626
Jun. 22	279	Canada 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	(30.022.549)	130,56	885.054
Apr. 22	6	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(159.250)	23,47	18.436
Mai 22	7	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(180.650)	24,99	5.736
Jun. 22	3	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	J.P. Morgan	USD	520.840	34.618,00	(1.570)
Jun. 22	4	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(844.148)	4.530,75	(62.003)
Dez. 22	13	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(3.598.687)	99,72	13.441
Mrz. 23	10	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(2.756.360)	99,30	10.233
Juni 23	7	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(1.924.833)	98,97	8.933
Sep. 24	98	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(26.864.396)	98,72	109.546
Jun. 22	8	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(1.708.205)	186,20	60.335
Jun. 22	14	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	595.312	3.823,00	(3.225)
Jun. 22	36	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(5.225.416)	128,86	93.567
Jun. 22	37	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(5.798.144)	138,31	136.943
Jun. 22	15	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(2.696.053)	158,66	63.289
Jun. 22	101	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(17.349.186)	151,51	420.784
Jun. 22	14	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	1.367.010	7.486,00	9.747
Apr. 22	79	FTSE China A50 Future	Morgan Stanley	USD	(1.053.655)	13.749,00	(32.516)
Jun. 22	9	FTSE MIB Index Future	Morgan Stanley	EUR	1.204.319	24.406,00	10.642
Apr. 22	31	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	1.905.647	1.544,00	8.913
Jun. 22	38	FTSE/JSE Top 40 Future	Morgan Stanley	ZAR	1.711.138	68.881,00	80.121
Apr. 22	7	Hang Seng Index Future	Morgan Stanley	HKD	(975.342)	21.990,00	(7.194)
Apr. 22	26	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	(1.247.233)	7.521,00	(938)
Apr. 22	1	IBEX 35 Index Future	Morgan Stanley	EUR	91.188	8.415,90	1.913
Mrz. 23	1	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	324.882	97,85	(3.547)
Dez. 24	197	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(63.544.811)	97,98	157.671
Jun. 22	65	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	(80.126.284)	149,70	197.748
Jun. 22	44	KOSPI2 Index Future	J.P. Morgan	KRW	(3.167.895)	365,70	(151.027)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Marktpreis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)								
Jun. 22	77	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(12.362.878)	121,23	100.337	
Apr. 22	175	Mini Bovespa Future	Morgan Stanley	BRL	893.532	120.379,00	(8.587)	
Jun. 22	2	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(205.905)	2.144,40	(8.535)	
Jun. 22	24	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(1.262.400)	1.125,50	(88.200)	
Apr. 22	34	MSCI Singapore Index ETS Future	Morgan Stanley	SGD	(822.958)	334,85	(17.039)	
Jun. 22	1	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(271.650)	14.868,75	(25.725)	
Jun. 22	2	Nikkei 225 (SGX) Future	Morgan Stanley	JPY	228.725	27.795,00	(411)	
Apr. 22	48	OMXS30 Index Future	Morgan Stanley	SEK	1.081.077	2.085,00	(16.668)	
Jun. 22	4	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(399.145)	2.066,40	(14.135)	
Jun. 22	1	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	271.510	2.689,20	(2.590)	
Jun. 22	36	S&P/TSX 60 Index Future	J.P. Morgan	CAD	7.413.875	1.317,10	171.711	
Jun. 22	1.496	SET 50 Index Future	J.P. Morgan	THB	9.084.318	1.016,70	64.453	
Apr. 22	2	SGX Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	(70.224)	17.536,50	78	
Jun. 22	181	Short-Term Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(22.302.177)	110,97	82.515	
Jun. 22	257	South Korea 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	(25.294.476)	117,00	486.094	
Jun. 22	517	South Korea 3 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	(45.776.354)	106,23	463.941	
Jun. 22	51	SPI 200 Future	Morgan Stanley	AUD	6.903.404	7.479,00	232.179	
Jun. 22	2	Stoxx Euro ESG-X Index Future	Morgan Stanley	EUR	37.336	167,60	(254)	
Jun. 22	12	Swiss Market Index Future	Morgan Stanley	CHF	1.543.694	12.034,00	19.079	
Jun. 22	7	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	1.124.651	1.946,50	(5.421)	
Jun. 22	10	WIG20 Index Future	Morgan Stanley	PLN	97.728	2.165,00	5.325	
							USD	4.719.362
Schroder GAIA Egerton Equity								
Jun. 22	190	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	(36.003.947)	4.530,75	(2.904.188)	
							EUR	(2.904.188)
Schroder GAIA Helix								
Jun. 22	74	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	(16.446.500)	4.530,75	(317.275)	
Jun. 22	340	Euro Stoxx 50 Future	J.P. Morgan	EUR	(14.183.901)	3.823,00	(195.357)	
Jun. 22	92	Euro Stoxx Future	J.P. Morgan	EUR	(2.105.310)	426,60	(65.551)	
Jun. 22	236	FTSE 100 Index Future	J.P. Morgan	GBP	(22.159.018)	7.486,00	(1.049.183)	
Jun. 22	255	FTSE 250 Index Future	J.P. Morgan	GBP	(13.515.204)	21.038,00	(579.446)	
Jun. 22	39	MSCI Asia Future	J.P. Morgan	USD	(2.226.980)	589,80	(73.240)	
Jun. 22	243	MSCI China Future	J.P. Morgan	USD	4.731.979	521,70	1.606.677	
Jun. 22	408	MSCI EAFE Index Future	J.P. Morgan	USD	(41.424.823)	2.144,40	(2.320.937)	
Jun. 22	37	MSCI Emerging Market Index Future	J.P. Morgan	USD	(1.963.080)	1.125,50	(119.095)	
Jun. 22	57	MSCI Europe Future	J.P. Morgan	EUR	(1.729.128)	294,90	(130.400)	
Jun. 22	182	MSCI World Index Future	J.P. Morgan	USD	(16.170.368)	9.352,00	(850.272)	
Jun. 22	13	Topix Index Future	J.P. Morgan	JPY	(1.983.325)	1.946,50	(95.244)	
							USD	(4.189.323)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified								
Mrz. 23	78	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	19.072.189	97,60	(40.189)	
Dez. 22	13	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(3.235.538)	97,34	71.988	
Juni 23	172	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	42.155.250	96,87	(501.150)	
Dez. 23	77	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	18.879.263	96,97	(212.539)	
Jun. 24	34	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	8.385.348	97,17	(126.323)	
Sep. 24	48	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	11.832.150	97,24	(163.950)	
Dez. 24	33	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	8.123.313	97,30	(96.475)	
Apr. 22	22	Amsterdam Index Future	Newedge Group	EUR	3.423.129	724,01	100.990	
Jun. 22	60	Australia 10 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	5.872.881	126,74	(182.373)	
Jun. 22	66	Australia 3 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	5.497.484	109,89	(70.348)	
Jun. 22	3	Australian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	225.455	74,97	(560)	

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Marktpreis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Dez. 22	7	Bankers' Acceptance Future	Newedge Group	CAD	(1.375.125)	97,09	16.028
Jun. 22	4	British Pound Future	Morgan Stanley	USD	(327.993)	131,31	(282)
Apr. 22	101	CAC 40 Index Future	Newedge Group	EUR	7.282.731	6.657,50	155.777
Jun. 22	54	Canada 10 Year Bond Future	Newedge Group	CAD	5.822.469	130,56	(182.954)
Jun. 22	1	Canadian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(78.588)	80,09	(1.502)
Apr. 22	215	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(6.539.671)	23,47	1.493.836
Mai 22	47	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(1.411.005)	24,99	236.583
Jun. 22	72	Dax Index Future	Newedge Group	EUR	27.244.668	14.433,00	1.495.042
Jun. 22	5	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Morgan Stanley	USD	(876.100)	34.618,00	10.650
Apr. 22	13	Dubai IRD FX Future	Newedge Group	USD	339.768	131,68	2.600
Jun. 22	172	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(36.745.498)	4.530,75	(2.218.953)
Dez. 22	7	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	1.930.309	99,72	207
Juni 23	26	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	7.145.393	98,97	(29.191)
Sep. 23	46	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	12.683.198	98,77	(118.438)
Dez. 23	52	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	14.334.690	98,70	(140.397)
Jun. 22	13	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Newedge Group	EUR	(2.877.954)	186,20	200.165
Jun. 22	3	Euro FX Future	Morgan Stanley	USD	414.381	1,11	1.832
Jun. 22	630	Euro Stoxx 50 Future	Newedge Group	EUR	25.024.299	3.823,00	1.619.621
Jun. 22	145	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	21.000.795	128,86	(330.846)
Jun. 22	66	Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	(10.490.195)	138,31	391.836
Jun. 22	192	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	35.242.558	158,66	(1.543.174)
Jun. 22	53	Euro-OAT Future	Newedge Group	EUR	9.249.080	151,51	(365.859)
Jun. 22	3	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(371.719)	110,74	4.217
Jun. 22	181	FTSE 100 Index Future	Newedge Group	GBP	(16.735.342)	7.486,00	(1.064.168)
Apr. 22	216	FTSE China A50 Future	Newedge Group	USD	(2.898.143)	13.749,00	(71.641)
Jun. 22	25	FTSE MIB Index Future	Newedge Group	EUR	(3.254.449)	24.406,00	(120.443)
Jun. 22	80	FTSE/JSE Top 40 Future	Newedge Group	ZAR	(3.560.415)	68.881,00	(210.658)
Apr. 22	21	IBEX 35 Index Future	Newedge Group	EUR	(1.926.707)	8.415,90	(28.412)
Mrz. 23	25	ICE 3 Month SONIA Index Future	Newedge Group	GBP	8.037.321	97,85	(3.941)
Jun. 22	26	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Newedge Group	JPY	32.174.552	149,70	(203.138)
Jun. 22	3	Japanese Yen Future	Morgan Stanley	USD	(323.948)	82,38	15.042
Jun. 22	237	KOSDAQ150 Index Future	Newedge Group	KRW	2.411.646	1.318,30	166.111
Jun. 22	90	KOSPI2 Index Future	Newedge Group	KRW	(6.506.607)	365,70	(282.099)
Jun. 22	121	Long Gilt Future	Newedge Group	GBP	(19.467.029)	121,23	197.321
Jun. 22	14	Mexican Peso Future	Morgan Stanley	USD	323.537	4,97	24.574
Jun. 22	40	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(4.077.895)	2.144,40	(210.905)
Jun. 22	144	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(7.621.410)	1.125,50	(482.190)
Apr. 22	209	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	(5.132.202)	334,85	(31.309)
Jun. 22	18	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(5.384.935)	14.868,75	32.185
Jun. 22	5	New Zealand Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(342.670)	69,24	(3.530)
Jun. 22	10	Nikkei 225 (OSE) Future	Newedge Group	JPY	(2.075.398)	27.830,00	(210.621)
Jun. 22	41	Nikkei 225 (YEN) Future	Morgan Stanley	JPY	(4.183.588)	27.535,00	(453.076)
Apr. 22	131	OMXS30 Index Future	Newedge Group	SEK	2.928.621	2.085,00	(23.672)
Jun. 22	92	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(9.216.085)	2.066,40	(289.355)
Jun. 22	15	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	3.877.125	2.689,20	156.675
Jun. 22	33	S&P/TSX 60 Index Future	Newedge Group	CAD	6.748.104	1.317,10	205.349
Jun. 22	423	SET 50 Index Future	Newedge Group	THB	(2.553.246)	1.016,70	(33.605)
Apr. 22	150	SGX Nifty 50 Future	Newedge Group	USD	5.271.912	17.536,50	(10.962)
Jun. 22	72	Short-Term Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	8.945.452	110,97	(106.692)
Jun. 22	28	South Korea 10 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	2.756.685	117,00	(53.826)
Jun. 22	22	South Korea 3 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	1.949.425	106,23	(21.237)
Jun. 22	12	SPI 200 Future	Newedge Group	AUD	1.601.568	7.479,00	77.393
Jun. 22	10	Stoxx 600 Bank Future	Newedge Group	EUR	(73.206)	133,60	(691)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Marktpreis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Jun. 22	108	Stoxx Europe 600 Future	Newedge Group	EUR	2.502.996	449,40	181.608
Jun. 22	3	Swiss Franc Future	Morgan Stanley	USD	405.056	108,71	2.606
Jun. 22	114	Topix Index Future	Newedge Group	JPY	(16.507.393)	1.946,50	(1.720.059)
Jun. 22	4	UD Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	(396.780)	98,36	3.340
Jun. 22	26	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(3.200.453)	122,88	5.703
Jun. 22	15	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	2.061.016	135,47	(28.984)
Jun. 22	216	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	45.972.727	105,96	(197.601)
Jun. 22	4	US 3 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	877.172	109,09	(4.422)
Jun. 22	272	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	31.764.398	114,69	(569.398)
Apr. 22	26	US Dollar Index Future	Newedge Group	KRW	261.898	1.212,20	(1.866)
Jun. 22	63	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(9.751.734)	150,06	297.797
Jun. 22	25	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	4.514.281	177,13	(86.156)
Apr. 22	84	VSTOXX Mini Future	Newedge Group	EUR	(304.316)	28,40	40.409
Jun. 22	25	WIG20 Index Future	Newedge Group	PLN	(247.921)	2.165,00	(9.710)
						USD	(5.652.385)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund							
Jun. 22	38	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	(2.730.870)	7.486,00	(113.810)
						GBP	(113.810)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Jun. 22	146	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	14.161.304	126,74	(314.401)
Jun. 22	24	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	2.006.088	109,89	(32.584)
Jun. 22	378	Canada 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	39.549.318	130,56	(72.711)
Jun. 22	22	Canada 5 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	(2.108.555)	117,34	43.619
Jun. 22	4	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(903.338)	4.530,75	(2.812)
Jun. 22	74	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(15.371.089)	186,20	128.292
Jun. 22	59	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	(2.401.400)	3.823,00	(93.824)
Jun. 22	17	Euro Stoxx Bank Future	Morgan Stanley	EUR	(79.569)	87,70	(2.896)
Jun. 22	522	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(74.218.444)	128,86	(193.372)
Jun. 22	20	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(3.106.472)	138,31	46.363
Jun. 22	175	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(30.960.862)	158,66	245.278
Jun. 22	125	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(21.664.473)	151,51	713.481
Jun. 22	525	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(64.255.678)	110,74	(57.132)
Jun. 22	7	KOSPI2 Index Future	Morgan Stanley	KRW	(501.805)	365,70	(26.206)
Jun. 22	204	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(32.684.044)	121,23	196.272
Jun. 22	25	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(2.535.688)	2.144,40	(144.813)
Jun. 22	1	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	103.115	2.066,40	205
Apr. 22	29	SGX Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	(998.205)	17.536,50	(18.913)
Jun. 22	26	Stoxx 600 Industrial Goods & Services Future	Morgan Stanley	EUR	(997.246)	683,50	14.287
Jun. 22	162	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	19.885.469	122,88	20.281
Jun. 22	39	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(5.269.297)	135,47	(13.984)
Jun. 22	452	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(96.831.664)	105,96	1.042.976
Jun. 22	309	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	35.443.833	114,69	(5.395)
Jun. 22	32	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(4.872.438)	150,06	70.438
Jun. 22	210	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	37.353.404	177,13	(157.154)
						USD	1.385.295

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Optionskontrakte

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

Zum 31. März 2022 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						
(1.146.573)	Put auf UBS ETC Linked to a Systematica Strategy Delta-1 Basket on Commodity Future Ausübungskurs 69,12 Läuft am 4. Apr. 2022 ab	UBS	USD	(4.324)	-	4.324
				USD	-	4.324
Schroder GAIA Helix						
77	Put auf Deutsche Börse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 14.300,00 Läuft am 14. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	72.116	107.967	35.851
15.447	Call auf Frontline Ltd Ausübungskurs 12,00 Läuft am 14. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	343.695	77.235	(266.460)
2.268	Call auf Scorpio Tankers, Inc. Ausübungskurs 23,00 Läuft am 14. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	86.003	85.050	(953)
30	Put auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 1.100,00 Läuft am 14. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	16.712	25.500	8.788
32	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.115,00 Läuft am 14. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	200.759	11.520	(189.239)
30	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.150,00 Läuft am 14. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	156.112	12.300	(143.812)
20	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.450,00 Läuft am 1. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	90.074	1.250	(88.824)
				USD	320.822	(644.649)
Schroder GAIA Sirius US Equity						
32	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.100,00 Läuft am 17. Jun. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	586.496	178.400	(408.096)
24	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.100,00 Läuft am 16. Sep. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	598.285	304.200	(294.085)
21	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.100,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	556.012	379.470	(176.542)
17	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.100,00 Läuft am 17. Mrz. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	573.001	376.125	(196.876)
				USD	1.238.195	(1.075.599)
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
45.730	Call auf Baidu, Inc. Ausübungskurs 220,00 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	HKD	42.741	34	(42.707)
(45.730)	Call auf Baidu, Inc. Ausübungskurs 280,00 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	HKD	(10.267)	(2)	10.265
36	Call auf Block, Inc. Ausübungskurs 220,00 Läuft am 17. Jun. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	27.117	3.312	(23.805)
172	Call auf Citigroup, Inc. Ausübungskurs 75,00 Läuft am 17. Jun. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	30.928	688	(30.240)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
179.908	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 10,00 Läuft am 17. Jun. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	83.271	12.700	(70.571)
20.403	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 12,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	9.531	3.595	(5.936)
29.085	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 13,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	9.872	3.814	(6.058)
41.588	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 14,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	10.656	4.189	(6.467)
20.208	Call auf Deutsche Lufthansa AG Ausübungskurs 9,00 Läuft am 16. Sep. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	11.843	7.375	(4.468)
32.476	Call auf Deutsche Lufthansa AG Ausübungskurs 9,00 Läuft am 17. Jun. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	12.781	4.716	(8.065)
33.346	Call auf EasyJet PLC Ausübungskurs 8,00 Läuft am 17. Jun. 2022 ab	J.P. Morgan	GBP	13.117	2.166	(10.951)
27.606	Call auf EasyJet PLC Ausübungskurs 8,42 Läuft am 16. Sep. 2022 ab	J.P. Morgan	GBP	13.081	3.355	(9.726)
19.487.029	Call auf Euro Stoxx 50 Index versus S&P 500 Index Ausübungskurs 2,50 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	216.904	8.244	(208.660)
54	Call auf Fidelity National Financial, Inc. Ausübungskurs 135,00 Läuft am 15. Jul. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	18.722	2.565	(16.157)
4.910	Call auf Financial Select Sector SPDR Fund Ausübungskurs 518,00 Läuft am 17. Jun. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	98.200	15.058	(83.142)
65	Call auf FleetCor Technologies, Inc. Ausübungskurs 260,00 Läuft am 20. Mai 2022 ab	Morgan Stanley	USD	43.779	48.425	4.646
880.000	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 85,16 Läuft am 7. Apr. 2022 ab	Citi Bank	AUD	10.014	42.944	32.930
905.000	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 85,56 Läuft am 13. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	AUD	9.314	41.403	32.089
(1.285.000)	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 88,29 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	Citi Bank	AUD	(12.299)	(33.029)	(20.730)
(2.635.000)	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 89,05 Läuft am 20. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	AUD	(13.836)	(53.731)	(39.895)
(1.325.000)	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 92,30 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Citi Bank	AUD	(15.695)	(7.887)	7.808
(2.645.000)	Call auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,76 Läuft am 26. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	AUD	(12.816)	(9.189)	3.627
(904.000)	Call auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,46 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	(11.797)	(16.683)	(4.886)
4.241.000	Call auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,51 Läuft am 5. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	EUR	50.435	1.723	(48.712)
4.958.000	Call auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,52 Läuft am 6. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	33.160	1.234	(31.926)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
991.000	Call auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,55 Läuft am 31. Mrz. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	10.864	-	(10.864)
861.000	Call auf EUR/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,60 Läuft am 20. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	18.781	3.107	(15.674)
849.000	Call auf EUR/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,63 Läuft am 5. Apr. 2022 ab	Bank of America	EUR	19.840	73	(19.767)
(861.000)	Call auf EUR/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,40 Läuft am 20. Apr. 2022 ab	Citi Bank	EUR	(10.165)	(4.293)	5.872
(882.000)	Call auf EUR/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 1,04 Läuft am 20. Apr. 2022 ab	Citi Bank	EUR	(8.770)	(1.484)	7.286
158.000	Call auf EUR/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 1,05 Läuft am 2. Sep. 2022 ab	Bank of America	EUR	27.524	19.670	(7.854)
862.000	Call auf EUR/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 375,55 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	EUR	13.315	5.489	(7.826)
904.000	Call auf EUR/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 376,80 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Citi Bank	EUR	13.278	6.158	(7.120)
(849.000)	Call auf EUR/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 127,94 Läuft am 5. Apr. 2022 ab	Bank of America	EUR	(11.685)	(47.128)	(35.443)
(892.000)	Call auf EUR/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 134,37 Läuft am 26. Apr. 2022 ab	Citi Bank	EUR	(12.016)	(12.759)	(743)
(1.786.000)	Call auf EUR/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 135,00 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	Bank of America	EUR	(9.892)	(18.907)	(9.015)
892.000	Call auf EUR/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 22,28 Läuft am 26. Apr. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	10.837	6.658	(4.179)
882.000	Call auf EUR/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 22,98 Läuft am 20. Apr. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	11.815	1.046	(10.769)
4.241.000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,63 Läuft am 5. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	EUR	50.435	1.373	(49.062)
4.958.000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,64 Läuft am 6. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	32.673	1.304	(31.369)
904.000	Call auf EUR/TRY-Devisenkurs Ausübungskurs 16,84 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Bank of America	EUR	40.514	23.348	(17.166)
1.054.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,10 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	10.938	14.556	3.618
864.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	Citi Bank	EUR	8.941	8.139	(802)
(851.000)	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,12 Läuft am 13. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	(4.434)	(2.949)	1.485
(1.662.000)	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,13 Läuft am 12. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	(8.466)	(2.240)	6.226
1.142.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,13 Läuft am 4. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	14.077	54	(14.023)
875.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,14 Läuft am 16. Mai 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	13.336	2.010	(11.326)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1.706.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,18 Läuft am 5. Mai 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	10.083	220	(9.863)
752.000	Call auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,75 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	GBP	9.721	11.472	1.751
604.000	Call auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 157,19 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	GBP	8.619	16.901	8.282
(1.593.000)	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,33 Läuft am 2. Mai 2022 ab	J.P. Morgan	GBP	(10.641)	(10.605)	36
735.000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Läuft am 16. Mai 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	13.430	1.564	(11.866)
685.000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Läuft am 4. Apr. 2022 ab	Bank of America	GBP	12.059	6	(12.053)
(4.295.000)	Call auf NZD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 86,00 Läuft am 26. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	NZD	(22.714)	(16.784)	5.930
875.000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,66 Läuft am 3. Mai 2022 ab	Barclays Bank	NZD	11.046	26.997	15.951
945.000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,69 Läuft am 7. Apr. 2022 ab	Citi Bank	NZD	8.959	6.604	(2.355)
270.000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,72 Läuft am 19. Apr. 2022 ab	Bank of America	NZD	13.524	15.744	2.220
545.000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,73 Läuft am 9. Mai 2022 ab	Morgan Stanley	NZD	32.092	368	(31.724)
285.000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,73 Läuft am 9. Mai 2022 ab	J.P. Morgan	NZD	12.046	175	(11.871)
(995.000)	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,80 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Bank of America	USD	(22.430)	(19.278)	3.152
2.444.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 6,34 Läuft am 12. Jul. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	74.618	4.272	(70.346)
1.275.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 6,66 Läuft am 8. Feb. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	39.539	18.138	(21.401)
(2.858.000)	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,27 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	(11.289)	(6.651)	4.638
1.170.000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,92 Läuft am 11. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	14.192	6.060	(8.132)
1.226.000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,92 Läuft am 27. Mai 2022 ab	Citi Bank	USD	16.799	15.702	(1.097)
1.946.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,36 Läuft am 22. Apr. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	14.473	7.192	(7.281)
2.070.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,37 Läuft am 10. Jun. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	16.343	16.542	199
1.815.000	Call auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,44 Läuft am 10. Mrz. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	34.921	32.448	(2.473)
2.505.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,45 Läuft am 19. Mai 2022 ab	Barclays Bank	USD	7.289	5.223	(2.066)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
2.588.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,46 Läuft am 7. Jul. 2022 ab	Citi Bank	USD	32.220	12.846	(19.374)
872.000	Call auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,47 Läuft am 13. Mrz. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	17.575	13.980	(3.595)
(7.763.000)	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,88 Läuft am 7. Jul. 2022 ab	Citi Bank	USD	(18.243)	(3.947)	14.296
680.000	Call auf USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 22,18 Läuft am 4. Apr. 2022 ab	Bank of America	CZK	526	92	(434)
992.000	Call auf USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 22,87 Läuft am 4. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	CZK	342	5	(337)
776.000	Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.390,00 Läuft am 23. Jun. 2022 ab	Citi Bank	USD	10.866	9.422	(1.444)
704.000	Call auf Foreign Exchange USD/IDR Ausübungskurs 14.460,00 Läuft am 6. Mai 2022 ab	Bank of America	USD	8.496	3.138	(5.358)
1.072.000	Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.825,00 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	6.077	489	(5.588)
960.000	Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.946,00 Läuft am 7. Jun. 2022 ab	Bank of America	USD	7.416	2.422	(4.994)
976.000	Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,19 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	USD	8.443	8.299	(144)
730.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,50 Läuft am 25. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	7.267	6.416	(851)
1.332.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 76,84 Läuft am 11. Aug. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	20.482	19.687	(795)
1.559.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 77,04 Läuft am 4. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	6.766	138	(6.628)
776.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 77,17 Läuft am 10. Jun. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	10.920	13.954	3.034
1.835.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 77,42 Läuft am 17. Mai 2022 ab	Morgan Stanley	USD	8.050	6.223	(1.827)
(1.332.000)	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 79,09 Läuft am 11. Aug. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	(8.627)	(8.558)	69
818.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 114,49 Läuft am 27. Mai 2022 ab	Barclays Bank	USD	11.690	49.001	37.311
1.165.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 115,25 Läuft am 12. Apr. 2022 ab	Citi Bank	USD	14.106	62.215	48.109
1.162.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 117,93 Läuft am 14. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	USD	10.656	37.246	26.590
(993.000)	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 122,53 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(10.576)	(7.177)	3.399
800.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 95,99 Läuft am 17. Juni 2024 ab	BNP Paribas	USD	55.269	131.032	75.763
762.000	Call auf USD/KRW-Devisenkurs Ausübungskurs 1.192,50 Läuft am 23. Mai 2022 ab	Barclays Bank	USD	9.594	18.016	8.422

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(1.985.000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 20,50 Läuft am 26. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	(15.235)	(6.903)	8.332
2.488.000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 21,23 Läuft am 2. Mai 2022 ab	Goldman Sachs	USD	74.453	3.315	(71.138)
(875.000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 21,75 Läuft am 7. Apr. 2022 ab	Bank of America	USD	(9.477)	(12)	9.465
(1.906.000)	Call auf USD/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 8,90 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	USD	(13.532)	(15.325)	(1.793)
(927.000)	Call auf USD/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 9,20 Läuft am 12. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(8.772)	(758)	8.014
730.000	Call auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 51,72 Läuft am 22. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	8.791	4.922	(3.869)
800.000	Call auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 52,57 Läuft am 9. Jun. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	10.636	5.483	(5.153)
1.639.000	Call auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 52,60 Läuft am 3. Mai 2022 ab	Morgan Stanley	USD	8.023	4.714	(3.309)
745.000	Call auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,13 Läuft am 5. Mai 2022 ab	Citi Bank	USD	5.885	22.496	16.611
(3.523.000)	Call auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,00 Läuft am 7. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	USD	(26.986)	(352)	26.634
960.000	Call auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Läuft am 11. Apr. 2022 ab	Bank of America	USD	7.179	3.864	(3.315)
880.000	Call auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Läuft am 27. Mai 2022 ab	J.P. Morgan	SGD	5.835	5.615	(220)
995.000	Call auf USD/TRY-Devisenkurs Ausübungskurs 15,32 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Bank of America	USD	39.362	22.349	(17.013)
564.000	Call auf USD/TRY-Devisenkurs Ausübungskurs 15,35 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Bank of America	USD	21.297	12.318	(8.979)
3.144.000	Call auf USD/TWD-Devisenkurs Ausübungskurs 28,49 Läuft am 30. Mai 2022 ab	Barclays Bank	USD	17.166	34.838	17.672
(2.754.000)	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 15,50 Läuft am 12. Apr. 2022 ab	Bank of America	USD	(27.273)	(1.541)	25.732
(1.910.000)	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 15,75 Läuft am 20. Jun. 2022 ab	Bank of America	USD	(28.669)	(18.258)	10.411
786.000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 16,19 Läuft am 20. Mai 2022 ab	Barclays Bank	USD	10.273	1.999	(8.274)
814	Call auf FTSE China A50 Index Ausübungskurs 14.738,00 Läuft am 30. Mai 2022 ab	Goldman Sachs	CNY	23.228	20.246	(2.982)
1.430	Call auf FTSE China A50 Index Ausübungskurs 14.738,00 Läuft am 30. Mai 2022 ab	J.P. Morgan	CNY	53.802	35.566	(18.236)
187	Call auf Global Payments, Inc. Ausübungskurs 155,00 Läuft am 20. Mai 2022 ab	Morgan Stanley	USD	89.833	25.713	(64.120)
34	Call auf Goldman Sachs Group, Inc. Ausübungskurs 405,00 Läuft am 20. Mai 2022 ab	Morgan Stanley	USD	25.699	1.377	(24.322)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
71.325	Call auf International Consolidated Airlines Group Ausübungskurs 2,00 Läuft am 16. Sep. 2022 ab	J.P. Morgan	GBP	13.314	4.312	(9.002)
105.453	Call auf International Consolidated Airlines Group Ausübungskurs 2,00 Läuft am 17. Jun. 2022 ab	J.P. Morgan	GBP	13.941	2.051	(11.890)
2.643	Call auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 1.260,00 Läuft am 14. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	69.775	143	(69.632)
(78)	Call auf S&P Biotechnology Select Industry Index Ausübungskurs 11.659,00 Läuft am 17. Jun. 2022 ab	Barclays Bank	USD	(14.852)	(239)	14.613
86.496	Call auf Standard Chartered PLC Ausübungskurs 6,40 Läuft am 17. Jun. 2022 ab	Goldman Sachs	GBP	12.391	4.744	(7.647)
8.382	Call auf Stoxx Europe 600 Index Ausübungskurs 475,00 Läuft am 20. Mai 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	36.373	23.387	(12.986)
704.881	Call auf TOPIX Banks Index Ausübungskurs 173,95 Läuft am 13. Mai 2022 ab	BNP Paribas	JPY	7.785	5.344	(2.441)
625.000	Call auf TOPIX Banks Index Ausübungskurs 193,20 Läuft am 8. Jul. 2022 ab	Goldman Sachs	JPY	11.022	3.390	(7.632)
(120)	Put auf 3-Monats-LIBOR-Optionen Ausübungskurs 99,00 Läuft am 18. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	EUR	(66.285)	(270.478)	(204.193)
120	Put auf 3-Monats-LIBOR-Optionen Ausübungskurs 99,50 Läuft am 18. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	EUR	107.751	366.722	258.971
4.974	Put auf Financial Select Sector SPDR Fund Ausübungskurs 457,00 Läuft am 20. Mai 2022 ab	Goldman Sachs	USD	37.553	51.958	14.405
880.000	Put auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 85,16 Läuft am 7. Apr. 2022 ab	Citi Bank	AUD	10.014	66	(9.948)
(2.635.000)	Put auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 85,45 Läuft am 20. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	AUD	(10.244)	(2.120)	8.124
905.000	Put auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 85,56 Läuft am 13. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	AUD	9.315	300	(9.015)
(1.285.000)	Put auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 88,29 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	Citi Bank	AUD	(12.300)	(3.532)	8.768
(1.325.000)	Put auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 92,30 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Citi Bank	AUD	(15.695)	(21.196)	(5.501)
(2.505.000)	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,72 Läuft am 12. Apr. 2022 ab	Bank of America	AUD	(11.937)	(1.355)	10.582
(2.405.000)	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,72 Läuft am 13. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	AUD	(15.183)	(846)	14.337
265.000	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,72 Läuft am 28. Jun. 2022 ab	Morgan Stanley	AUD	22.294	24.831	2.537
(3.890.000)	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,74 Läuft am 20. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	AUD	(33.447)	(16.263)	17.184
(4.040.000)	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,74 Läuft am 2. Mai 2022 ab	Barclays Bank	AUD	(21.069)	(26.727)	(5.658)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(1.345.000)	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,75 Läuft am 28. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	AUD	(10.192)	(12.315)	(2.123)
(2.275.000)	Put auf CAD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 88,60 Läuft am 7. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	CAD	(9.782)	(24)	9.758
(4.845.000)	Put auf CAD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 92,70 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	CAD	(21.917)	(5.420)	16.497
4.958.000	Put auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,45 Läuft am 6. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	31.807	4.186	(27.621)
(904.000)	Put auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,46 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	(11.797)	(6.764)	5.033
4.241.000	Put auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,51 Läuft am 5. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	EUR	50.434	104.311	53.877
861.000	Put auf EUR/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,60 Läuft am 20. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	18.781	56.674	37.893
849.000	Put auf EUR/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,63 Läuft am 5. Apr. 2022 ab	Bank of America	EUR	19.840	64.086	44.246
(861.000)	Put auf EUR/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,40 Läuft am 20. Apr. 2022 ab	Citi Bank	EUR	(10.164)	(13.471)	(3.307)
(882.000)	Put auf EUR/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 1,04 Läuft am 20. Apr. 2022 ab	Citi Bank	EUR	(8.769)	(17.446)	(8.677)
862.000	Put auf EUR/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 375,55 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	EUR	13.316	24.190	10.874
904.000	Put auf EUR/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 376,80 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Citi Bank	EUR	13.278	28.110	14.832
(849.000)	Put auf EUR/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 127,94 Läuft am 5. Apr. 2022 ab	Bank of America	EUR	(11.653)	(22)	11.631
180.000	Put auf EUR/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 130,00 Läuft am 23. Mai 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	22.873	13.701	(9.172)
(892.000)	Put auf EUR/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 134,37 Läuft am 26. Apr. 2022 ab	Citi Bank	EUR	(12.016)	(10.126)	1.890
892.000	Put auf EUR/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 22,28 Läuft am 26. Apr. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	10.838	14.327	3.489
882.000	Put auf EUR/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 22,98 Läuft am 20. Apr. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	11.815	40.667	28.852
4.959.000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,56 Läuft am 6. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	31.569	2.286	(29.283)
4.241.000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,63 Läuft am 5. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	EUR	50.434	101.264	50.830
(1.315.000)	Put auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,75 Läuft am 8. Jun. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	(12.194)	(39.523)	(27.329)
904.000	Put auf EUR/TRY-Devisenkurs Ausübungskurs 16,84 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Bank of America	EUR	40.514	42.387	1.873
(1.662.000)	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,08 Läuft am 12. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	(8.283)	(1.051)	7.232

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(1.723.000)	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,09 Läuft am 20. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	(9.842)	(6.241)	3.601
1.054.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,10 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	10.938	7.090	(3.848)
864.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	Citi Bank	EUR	8.940	7.458	(1.482)
(2.730.000)	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Läuft am 28. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	EUR	(14.112)	(23.907)	(9.795)
1.142.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,13 Läuft am 4. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	14.078	27.428	13.350
875.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,14 Läuft am 16. Mai 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	13.336	2.010	(11.326)
752.000	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,75 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	GBP	9.721	6.387	(3.334)
604.000	Put auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 157,19 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	GBP	8.619	3.739	(4.880)
1.016.000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,31 Läuft am 23. Aug. 2022 ab	Morgan Stanley	GBP	11.741	26.698	14.957
735.000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Läuft am 16. Mai 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	13.429	32.036	18.607
685.000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Läuft am 4. Apr. 2022 ab	Bank of America	GBP	12.059	24.432	12.373
285.000	Put auf NZD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 80,00 Läuft am 23. Mai 2022 ab	J.P. Morgan	NZD	19.768	974	(18.794)
(4.270.000)	Put auf NZD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 83,00 Läuft am 26. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	NZD	(19.527)	(22.139)	(2.612)
875.000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,66 Läuft am 3. Mai 2022 ab	Barclays Bank	NZD	11.046	1.136	(9.910)
(2.585.000)	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,68 Läuft am 7. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	NZD	(11.904)	(758)	11.146
(4.020.000)	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,69 Läuft am 12. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	NZD	(32.059)	(9.855)	22.204
945.000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,69 Läuft am 7. Apr. 2022 ab	Citi Bank	NZD	8.959	1.902	(7.057)
(995.000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,80 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Bank of America	USD	(22.430)	(20.054)	2.376
(1.275.000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,21 Läuft am 8. Feb. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	(30.330)	(94.861)	(64.531)
184.000	Put auf Foreign Exchange USD/CAD Ausübungskurs 1,23 Läuft am 10. Mai 2022 ab	Goldman Sachs	USD	21.528	43.516	21.988
(2.549.000)	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,27 Läuft am 8. Aug. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(50.495)	(72.357)	(21.862)
1.170.000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,92 Läuft am 11. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	14.192	6.097	(8.095)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1.226.000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,92 Läuft am 27. Mai 2022 ab	Citi Bank	USD	16.800	11.441	(5.359)
(1.974.000)	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,93 Läuft am 21. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	USD	(9.969)	(17.795)	(7.826)
2.869.000	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 774,30 Läuft am 8. Sep. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	44.842	58.296	13.454
(2.869.000)	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 830,80 Läuft am 8. Sep. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(128.703)	(164.005)	(35.302)
2.163.000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,30 Läuft am 14. Sep. 2022 ab	Citi Bank	USD	10.912	10.752	(160)
1.444.000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,32 Läuft am 15. Sep. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	7.552	8.622	1.070
1.946.000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,36 Läuft am 22. Apr. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	14.473	5.655	(8.818)
2.070.000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,37 Läuft am 10. Jun. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	16.342	11.389	(4.953)
1.815.000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,44 Läuft am 10. Mrz. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	34.921	34.330	(591)
872.000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,47 Läuft am 13. Mrz. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	17.575	19.345	1.770
680.000	Put auf USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 22,18 Läuft am 4. Apr. 2022 ab	Bank of America	CZK	526	255	(271)
2.107.000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 328,54 Läuft am 22. Sep. 2022 ab	Citi Bank	USD	27.244	43.507	16.263
2.135.000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 330,65 Läuft am 26. Sep. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	27.503	50.138	22.635
(2.107.000)	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 348,95 Läuft am 22. Sep. 2022 ab	Citi Bank	USD	(82.858)	(114.935)	(32.077)
(2.135.000)	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 351,00 Läuft am 26. Sep. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(84.636)	(125.551)	(40.915)
776.000	Put auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14.390,00 Läuft am 23. Jun. 2022 ab	Citi Bank	USD	10.865	9.647	(1.218)
704.000	Put auf Foreign Exchange USD/IDR Ausübungskurs 14.460,00 Läuft am 6. Mai 2022 ab	Bank of America	USD	8.495	7.827	(668)
976.000	Put auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,19 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	USD	8.442	7.546	(896)
730.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 75,50 Läuft am 25. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	7.268	2.588	(4.680)
776.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 77,17 Läuft am 10. Jun. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	10.920	13.954	3.034
129.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 111,80 Läuft am 14. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	32.728	6	(32.722)
2.169.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 112,50 Läuft am 14. Jul. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	32.427	5.723	(26.704)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
818.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 114,49 Läuft am 27. Mai 2022 ab	Barclays Bank	USD	11.689	1.220	(10.469)
404.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 115,00 Läuft am 29. Sep. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	38.784	38.164	(620)
1.165.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 115,25 Läuft am 12. Apr. 2022 ab	Citi Bank	USD	14.105	180	(13.925)
1.274.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 115,29 Läuft am 31. Mrz. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	10.122	-	(10.122)
202.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 116,00 Läuft am 29. Jun. 2022 ab	Bank of America	USD	17.291	15.562	(1.729)
1.162.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 117,93 Läuft am 14. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	USD	10.655	990	(9.665)
(1.977.000)	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 121,50 Läuft am 26. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(10.656)	(18.331)	(7.675)
(993.000)	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 122,53 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(10.575)	(13.960)	(3.385)
800.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 95,99 Läuft am 17. Juni 2024 ab	BNP Paribas	USD	55.269	7.954	(47.315)
(1.444.000)	Put auf USD/KRW-Devisenkurs Ausübungskurs 1.190,00 Läuft am 15. Sep. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(13.350)	(20.406)	(7.056)
762.000	Put auf USD/KRW-Devisenkurs Ausübungskurs 1.192,50 Läuft am 23. Mai 2022 ab	Barclays Bank	USD	9.593	3.743	(5.850)
(1.423.000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,85 Läuft am 26. Sep. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	(15.938)	(23.840)	(7.902)
1.296.000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 20,30 Läuft am 2. Aug. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	14.036	33.300	19.264
(2.781.000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 20,65 Läuft am 12. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	(20.732)	(103.831)	(83.099)
1.423.000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 20,91 Läuft am 26. Sep. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	47.486	61.873	14.387
2.488.000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 21,23 Läuft am 2. Mai 2022 ab	Goldman Sachs	USD	74.453	156.860	82.407
(1.892.000)	Put auf USD/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 8,80 Läuft am 12. Apr. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	(10.709)	(17.351)	(6.642)
730.000	Put auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 51,72 Läuft am 22. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	8.791	3.313	(5.478)
800.000	Put auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 52,57 Läuft am 9. Jun. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	10.636	13.166	2.530
2.107.000	Put auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,11 Läuft am 22. Sep. 2022 ab	Citi Bank	USD	25.923	39.234	13.311
(2.107.000)	Put auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,36 Läuft am 22. Sep. 2022 ab	Citi Bank	USD	(79.261)	(106.224)	(26.963)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(2.135.000)	Put auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,39 Läuft am 26. Sep. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(82.825)	(118.551)	(35.726)
2.135.000	Put auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,42 Läuft am 26. Sep. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	26.568	47.177	20.609
782.000	Put auf USD/RUB-Devisenkurs Ausübungskurs 74,52 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	8.079	72.422	64.343
(1.299.000)	Put auf USD/RUB-Devisenkurs Ausübungskurs 77,81 Läuft am 12. Jul. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(56.123)	(173.391)	(117.268)
(782.000)	Put auf USD/RUB-Devisenkurs Ausübungskurs 79,59 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	(29.705)	(110.949)	(81.244)
(3.523.000)	Put auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 9,35 Läuft am 7. Apr. 2022 ab	Barclays Bank	USD	(23.956)	(16.707)	7.249
960.000	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Läuft am 11. Apr. 2022 ab	Bank of America	USD	7.178	2.175	(5.003)
880.000	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Läuft am 27. Mai 2022 ab	J.P. Morgan	USD	7.939	5.885	(2.054)
(4.289.000)	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 33,20 Läuft am 8. Jun. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	(69.208)	(53.222)	15.986
(1.998.000)	Put auf USD/TRY-Devisenkurs Ausübungskurs 15,15 Läuft am 20. Jul. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	(180.239)	(83.626)	96.613
995.000	Put auf USD/TRY-Devisenkurs Ausübungskurs 15,32 Läuft am 27. Apr. 2022 ab	Bank of America	USD	39.362	48.670	9.308
(1.442.000)	Put auf USD/TRY-Devisenkurs Ausübungskurs 18,06 Läuft am 14. Sep. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(146.041)	(210.201)	(64.160)
(1.423.000)	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 14,06 Läuft am 26. Sep. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	(21.261)	(24.262)	(3.001)
1.423.000	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 15,07 Läuft am 26. Sep. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	62.659	68.801	6.142
(814)	Put auf FTSE China A50 Index Ausübungskurs 11.570,00 Läuft am 30. Mai 2022 ab	Goldman Sachs	CNY	(10.970)	(7.291)	3.679
(1.430)	Put auf FTSE China A50 Index Ausübungskurs 11.570,00 Läuft am 30. Mai 2022 ab	J.P. Morgan	CNY	(18.244)	(12.809)	5.435
(55)	Put auf MSCI EAFE Index Ausübungskurs 1.850,00 Läuft am 20. Mai 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(68.292)	(58.025)	10.267
6	Put auf MSCI EAFE Index Ausübungskurs 1.930,00 Läuft am 14. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	42.902	1.065	(41.837)
55	Put auf MSCI EAFE Index Ausübungskurs 2.050,00 Läuft am 20. Mai 2022 ab	Morgan Stanley	USD	216.883	168.300	(48.583)
(99)	Put auf Pfizer, Inc. Ausübungskurs 50,00 Läuft am 14. Apr. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(9.295)	(4.406)	4.889
(9)	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.750,00 Läuft am 20. Mai 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(59.487)	(9.585)	49.902
9	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.150,00 Läuft am 20. Mai 2022 ab	Morgan Stanley	USD	133.752	31.320	(102.432)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
18	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.300,00 Läuft am 20. Mai 2022 ab	Morgan Stanley	USD	108.963	100.980	(7.983)
78	Put auf S&P Biotechnology Select Industry Index Ausübungskurs 8.939,00 Läuft am 17. Jun. 2022 ab	Barclays Bank	USD	51.393	154.217	102.824
18	Put auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 550,00 Läuft am 15. Jul. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	32.021	10.035	(21.986)
				USD	1.012.782	(1.161.463)

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 2022 wiesen die folgenden Teilfonds offene Swaptions auf Finanzindizes und international notierte Aktien auf:

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf	CDX „iTraxx Europe Series 36 20/12/2026“, Put, Ausübungskurs 65,00, 20. Apr. 2022	Bank of America	EUR	40.209	13.665.000	27.601	(12.608)
Kauf	CDX „iTraxx Europe Series 36 20/12/2026“, Put, Ausübungskurs 90,00, 20. Apr. 2022	Morgan Stanley	EUR	112.458	28.950.000	6.930	(105.528)
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 8,50 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028“, Put 8,50 %, 6. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	42.276	(53.649)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 8,50 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028“, Call 8,50 %, 6. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	44.465	(51.460)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 6,80 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Feb 2025“, Call, 6,80 %, 7. Feb. 2025	J.P. Morgan	MXN	541.676	228.495.000	64.697	(476.979)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 5,97 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2023“, Call 5,97 %, 30. Mrz. 2023	J.P. Morgan	MXN	69.383	46.495.000	413	(68.970)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 7,29 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2026“, Call, 7,29 %, 5. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	396.524	157.510.000	103.084	(293.440)
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 7,69 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2026“, Put 7,69 %, 13. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	384.124	157.510.000	219.339	(164.785)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 5,30 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2022“, Call 5,30 %, 26. Apr. 2022	J.P. Morgan	MXN	49.542	273.960.000	-	(49.542)
Verkauf	IRS „Erhält Festzinssatz 4,80 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2022“, Call 4,80 %, 26. Apr. 2022	J.P. Morgan	MXN	(14.729)	(273.960.000)	-	14.729

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Swaptions (Forts.)

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)								
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 2,00 % Erhält variablen Zinssatz USD SOFR Mar 2024“, Put 2,00 %, 21. Mrz. 2024	Citi Bank	USD	366.973	12.600.000	414.717	47.744	
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 2,09 % Erhält variablen Zinssatz USD SOFR Mar 2023“, Put, 2,09 %, 24. Mrz. 2023	Bank of America	USD	102.220	1.345.000	93.348	(8.872)	
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 2,09 % Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR Mar 2023“, Call 2,09 %, 24. Mrz. 2023	Bank of America	USD	96.521	1.345.000	109.603	13.082	
						USD	1.126.473	(1.210.278)

Total Return Swap-Kontrakte

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

Die Total Return Swaps wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Gewinn oder Verlust aus Total Return Swaps zum Ende des 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 Gesamtertragswert der Basiswerte beruht, dargestellt. Letzterer setzt sich aus dem aktuellen beizulegenden Zeitwert der Aktien und den für diese Aktien für das betreffende Swap-Jahr ausgeschütteten Dividenden zusammen. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Total-Return-Swaps“ aufgeführt.

Zum 31. März 2022 waren folgende Teilfonds in Total Return Swaps-Vereinbarungen engagiert:

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	19.114.220	6.281.774	5. Dez. 2022	8.626.863
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	EUR	16.707.199	(2.473.651)	21. Feb. 2023	(1.977.188)
Kauf Long	Automobilhersteller	J.P. Morgan	EUR	5.663.536	220.065	27. Jan. 2023	1.143.440
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	GBP	22.671.802	(6.589.885)	7. Aug. 2024	(6.617.766)
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	GBP	5.449.335	(626.020)	8. Dez. 2022	(295.503)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	CHF	15.382.227	(857.219)	18. Jun. 2024	(419.201)
Verkauf Short	Werbung	Morgan Stanley	GBP	1.676.783	29.516	8. Dez. 2022	29.516
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	6.632.455	165.241	27. Mrz. 2023	434.042
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	USD	1.232.262	19.110	2. Apr. 2025	19.110
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	1.621.211	(112.580)	25. Sep. 2023	(112.580)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	1.360.600	(688.930)	26. Apr. 2023	(738.917)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	3.777.141	544.377	6. Mrz. 2023	547.269
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	3.562.560	(113.557)	31. Okt. 2022	45.715
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	1.618.194	101.575	8. Dez. 2022	103.476
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	CHF	1.857.100	165.793	11. Dez. 2024	144.275
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	8.486.137	400.408	14. Jun. 2023	34.060
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	2.078.516	201.878	20. Nov. 2024	214.298
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	1.358.830	143.220	31. Jan. 2023	132.269
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	6.034.175	7.093	13. Jul. 2022	6.223
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	JPY	4.311.790	592.137	24. Okt. 2022	362.876
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.578.377	(168.680)	11. Mrz. 2025	(168.589)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	2.569.580	81.537	27. Feb. 2023	84.495

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1.639.599	(37.118)	31. Mrz. 2023	(33.356)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	3.544.366	(368.207)	5. Mrz. 2024	(253.338)
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	784.739	272.146	28. Feb. 2024	272.578
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	CHF	2.509.743	(45.422)	19. Feb. 2025	(46.021)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	3.658.369	(499.936)	16. Jan. 2024	(528.548)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	4.016.226	2.470.797	21. Mrz. 2024	2.472.758
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	2.169.972	213.361	17. Sep. 2024	213.275
Verkauf Short	Lebensmitteldienstleistungen	Goldman Sachs	USD	3.361.863	666.619	24. Jul. 2024	736.805
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	HKD	5.669.995	3.297.952	23. Dez. 2022	3.355.254
Verkauf Short	Gas	UBS	EUR	514.638	(55.228)	30. Apr. 2024	(39.291)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	DKK	3.724.111	1.064.252	15 Mai 2024	1.551.046
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	SEK	1.924.395	640.665	26. Apr. 2023	493.639
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Merrill Lynch	USD	2.037.870	500.673	31. Okt. 2022	658.561
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1.238.081	14.004	28. Apr. 2023	14.004
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Merrill Lynch	USD	1.728.284	(34.744)	31. Mrz. 2023	(34.744)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	USD	3.660.405	885.121	13. Jul. 2022	884.821
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Goldman Sachs	USD	4.946.609	709.446	31. Jul. 2024	819.206
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	USD	3.496.410	101.463	13. Jul. 2022	101.760
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	4.442.379	1.019.228	23. Jan. 2025	1.026.546
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	2.357.696	155.933	28. Feb. 2023	404.805
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	2.563.592	149.940	31. Mrz. 2023	149.940
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	USD	2.019.251	(132.831)	10. Apr. 2023	(132.521)
Verkauf Short	Maschinen - Bau u. Bergbau	Goldman Sachs	EUR	2.866.359	200.474	26. Sep. 2024	220.622
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	1.861.055	(47.698)	5. Dez. 2024	(48.355)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	CHF	3.096.399	183.454	24. Jul. 2024	191.942
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	3.113.443	313.710	27. Feb. 2023	330.920
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	2.047.171	7.210	6. Mrz. 2023	57.924
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	2.101.968	74.344	14. Mrz. 2023	75.996
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	EUR	3.220.076	1.282.664	5. Dez. 2022	1.476.510
Verkauf Short	Büro- und Geschäftsausstattung	J.P. Morgan	USD	2.142.901	400.071	3. Mrz. 2023	400.071
Verkauf Short	Büro- und Geschäftsausstattung	Morgan Stanley	JPY	3.793.448	(101.742)	24. Okt. 2022	(20.517)
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	J.P. Morgan	USD	2.864.347	(14.846)	21. Feb. 2023	(4.890)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	2.131.803	(397.186)	23. Jan. 2023	(360.293)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	4.145.811	(176.109)	25. Sep. 2023	(156.153)
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	5.261.255	(311.062)	31. Okt. 2022	37.372
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1.203.156	4.361	2. Apr. 2025	4.361
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	2.917.962	(235.237)	13. Feb. 2023	(282.160)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	1.271.927	(12.034)	13. Jul. 2022	(12.034)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	768.941	362.003	5. Sep. 2024	370.854
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	6.786.955	192.777	31 Mai 2022	473.144
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	2.805.443	(14.905)	28. Apr. 2023	(12.901)
Verkauf Short	Schiffbau	Goldman Sachs	EUR	3.748.996	542.348	12. Mrz. 2025	536.127
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	4.089.425	1.520.422	6. Nov. 2024	1.553.096
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	1.244.629	(264.682)	19. Mrz. 2025	(264.682)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	5.579.815	1.271.710	31. Okt. 2022	1.651.072
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	2.305.721	165.740	23. Jan. 2023	198.480
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	3.165.367	(375.425)	28. Mrz. 2023	(330.814)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	808.430	(43.034)	14. Apr. 2023	(43.034)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	2.875.118	(22.699)	31. Okt. 2022	82.646
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	7.950.934	(615.651)	28. Apr. 2023	(609.976)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	PLN	3.272.633	240.351	13. Jul. 2022	569.768
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	2.504.405	701.657	13. Jul. 2022	711.520
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	3.561.407	112.586	30. Okt. 2024	91.971
Verkauf Short	Diverse*	Morgan Stanley	EUR	4.198.437	3.700	29. Dez. 2023	79.298
Verkauf Short	Diverse*	Morgan Stanley	USD	32.993.723	(53.444)	17. Mrz. 2023	(77.603)
EUR							20.575.644
Schroder GAIA Helix							
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	EUR	43.491.921	(1.967.797)	6. Sep. 2022	(1.967.797)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	JPY	9.552.736	(189.610)	6. Sep. 2022	(189.610)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	225.988.617	1.230.837	6. Sep. 2022	1.230.837
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	EUR	4.272.061	55.163	6. Sep. 2022	55.163
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	GBP	50.640.007	(1.508.505)	6. Sep. 2022	(1.508.505)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	JPY	114.088.724	(1.959.983)	6. Sep. 2022	(1.959.983)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	322.872.374	(2.951.105)	6. Sep. 2022	(2.951.105)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	75.261.791	(4.524.965)	6. Sep. 2022	(4.524.965)
USD							(11.815.965)
Schroder GAIA Sirios US Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	2.256.320	32.400	27. Feb. 2023	32.400
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	1.010.780	(246.640)	14. Aug. 2023	(246.640)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	15.371.230	3.542.779	27. Feb. 2023	3.550.010
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	12.217.375	1.236.200	26. Mai 2022	1.236.200
Kauf Long	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	2.992.096	(286.330)	14. Mrz. 2023	(385.619)
Verkauf Short	Agrarwirtschaft	Merrill Lynch	USD	254.568	(201.533)	27. Dez. 2022	(201.533)
Verkauf Short	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	USD	17.859	(14.138)	26. Mai 2022	(14.138)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	1.013.243	(461.553)	14. Feb. 2023	(449.625)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	436.559	4.118	14. Mrz. 2023	4.118
Verkauf Short	Automobilhersteller	Merrill Lynch	USD	511.629	(44.164)	27. Dez. 2022	(44.164)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Merrill Lynch	USD	1.302.354	(79.646)	21. Feb. 2023	(73.202)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	1.489.256	(3.754)	12. Aug. 2022	(3.754)
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	1.896.474	79.878	27. Dez. 2022	79.878
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	238.505	5.730	21. Feb. 2023	5.730
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	239.828	72.675	15. Nov. 2022	72.675
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	USD	449.844	(41.346)	14. Jun. 2023	(41.346)
Verkauf Short	Chemie	Merrill Lynch	USD	221.571	(121.016)	27. Dez. 2022	(121.016)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	172.286	(14.157)	6. Feb. 2023	(14.157)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	2.572.136	(123.095)	21. Feb. 2023	(123.095)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	885.059	37.066	17. Jan. 2023	38.906
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	391.010	(8.887)	14. Mrz. 2023	(8.887)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	551.675	34.536	3. Apr. 2023	49.427
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1.694.372	39.855	14. Apr. 2023	39.855
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	946.877	44.435	24. Apr. 2023	44.435
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.633.816	(93.720)	26. Mai 2022	(93.720)
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	1.522.944	10.804	21. Feb. 2023	10.804
Verkauf Short	Umweltschutz	Goldman Sachs	USD	176.645	(70.411)	15. Nov. 2022	(70.411)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	7.691.274	204.950	17. Nov. 2022	204.950
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	10.683.678	(62.455)	14. Dez. 2022	(62.455)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	10.842.832	(218.179)	14. Mrz. 2023	(218.179)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	9.924.815	(48.584)	14. Jun. 2023	(48.731)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	6.784.079	(255.416)	7. Apr. 2022	(255.416)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	5.379.710	31.766	25. Jul. 2022	31.766
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	8.970.228	(498.802)	1. Aug. 2022	(498.802)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	5.425.256	(348.976)	28. Mrz. 2023	(348.976)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	677.749	(26.666)	14. Jun. 2023	(26.666)
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	1.945.848	37.017	27. Dez. 2022	35.899
Verkauf Short	Forstprodukte und Papier	Merrill Lynch	USD	522.944	(23.195)	27. Dez. 2022	(23.195)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Merrill Lynch	USD	595.798	(41.113)	9. Mrz. 2023	(41.113)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Merrill Lynch	USD	933.211	(56.837)	18. Apr. 2023	(56.837)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.471.629	(4.454)	14. Mrz. 2023	(4.454)
Verkauf Short	Versicherungen	Merrill Lynch	USD	485.366	(38.833)	27. Dez. 2022	(38.833)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	578.602	122.782	27. Dez. 2022	122.782
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	583.569	(68.945)	18. Apr. 2023	(68.945)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	348.017	970	1. Mrz. 2023	970
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Goldman Sachs	USD	442.896	11.053	12. Mai 2022	11.053
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	161.821	(5.830)	26. Mai 2022	(5.830)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	2.637.262	(203.982)	12. Mai 2022	(205.025)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	531.104	(1.488)	14. Mrz. 2023	(1.488)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	2.808.217	85.113	27. Dez. 2022	85.135
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	237.819	5.195	26. Mai 2022	5.195
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	315.423	17.675	14. Jun. 2023	17.675
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	586.064	(34.953)	17. Jan. 2023	(34.953)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	768.730	164.593	10. Apr. 2023	164.593
Verkauf Short	Telekommunikation	Merrill Lynch	USD	1.818.567	(283.027)	21. Feb. 2023	(283.332)
USD							1.729.919
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	700.621.177	18.214.622	21. Okt. 2022	18.214.622
USD							18.214.622
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf Long	Werbung	J.P. Morgan	EUR	284.480	34.189	9. Mrz. 2023	34.189
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	EUR	307.882	30.094	9. Mrz. 2023	30.094
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	GBP	224.231	(13.737)	24. Mai 2023	(13.737)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	J.P. Morgan	GBP	9.588	(747)	9. Mrz. 2023	(747)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	GBP	835.255	29.317	15. Mai 2029	29.317
Kauf Long	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	3.743	37	24. Mai 2023	37
Kauf Long	Automobilhersteller	J.P. Morgan	EUR	20.015	3.600	9. Mrz. 2023	3.600
Kauf Long	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	113.241	33.786	15. Mai 2029	33.786
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	AUD	133.637	98	24. Mai 2023	98
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	2.795.783	(29.171)	24. Mai 2023	(28.955)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	GBP	152.281	1.252	24. Mai 2023	1.252
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	JPY	582.470	(25.096)	24. Mai 2023	(25.096)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	SEK	235.248	(19.021)	24. Mai 2023	(19.021)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	4.232.969	(148.519)	24. Mai 2023	(148.519)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	1.129.184	(23.277)	9. Mrz. 2023	(23.277)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	ILS	577.966	5.663	9. Mrz. 2023	5.663
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	USD	270.903	8.519	9. Mrz. 2023	8.519
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	AUD	393.947	3.612	15. Mai 2029	3.612
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	EUR	313.547	(7.817)	15. Mai 2029	(7.817)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	SGD	437.569	21.437	15. Mai 2029	21.437
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	1.821.285	14.012	15. Mai 2029	14.012
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	CHF	6.080	(91)	24. Mai 2023	(91)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	220.762	2.730	24. Mai 2023	2.730
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	GBP	1.997	41	24. Mai 2023	41
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	6.057	230	24. Mai 2023	230
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	1.237.303	7.598	24. Mai 2023	7.598
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	CHF	122.788	(15.278)	9. Mrz. 2023	(15.278)
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	HKD	2.407	(273)	9. Mrz. 2023	(273)
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1.020.023	(31.475)	9. Mrz. 2023	(31.475)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	213.736	20.560	15. Mai 2029	20.560
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	GBP	88.093	9.700	15. Mai 2029	9.700
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	4.427.550	291.102	15. Mai 2029	291.102
Kauf Long	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	20.492	(100)	24. Mai 2023	(100)
Kauf Long	Baustoffe	Morgan Stanley	HKD	159.211	8.170	15. Mai 2029	8.170
Kauf Long	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	21.706	1.440	15. Mai 2029	1.440
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	USD	153.780	(4.105)	25. Mai 2023	(4.105)
Kauf Long	Chemie	J.P. Morgan	EUR	306.913	33.248	9. Mrz. 2023	33.248
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	130.620	(5.857)	24. Mai 2023	(5.857)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.876.872	25.133	24. Mai 2023	25.133
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	398.439	47.803	9. Mrz. 2023	47.803
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	HKD	187	(7)	9. Mrz. 2023	(7)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	430.211	54.661	9. Mrz. 2023	54.661
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	120.090	4.584	15. Mai 2029	4.584
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	795.499	59.346	15. Mai 2029	59.346
Kauf Long	Computer	Morgan Stanley	USD	170.986	(7.439)	31. Mrz. 2022	(7.439)
Kauf Long	Vertrieb/Großhandel	Goldman Sachs	USD	203.557	(1.840)	24. Mai 2023	(1.840)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	75.141	(105)	24. Mai 2023	(105)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	2.554.708	(78.191)	24. Mai 2023	(78.191)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	555.045	97.211	10. Apr. 2023	97.211
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.601.346	166.719	22. Feb. 2024	166.719
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	422.977	8.476	15. Mai 2029	8.476
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	861.729	61.740	15. Mai 2029	61.740
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	EUR	266.714	(8.135)	24. Mai 2023	(8.135)
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	USD	1.412.671	102.675	24. Mai 2023	102.675
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	EUR	285.865	26.664	9. Mrz. 2023	26.664
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	HKD	105.132	11.198	9. Mrz. 2023	11.198
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	USD	216.685	19.773	9. Mrz. 2023	19.773
Kauf Long	Elektrik	Morgan Stanley	EUR	262.319	7.267	15. Mai 2029	7.267
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	32.670	(364)	25. Mai 2023	(364)
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	J.P. Morgan	EUR	210.456	35.257	22. Jun. 2022	35.257
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	J.P. Morgan	USD	21.564	2.665	9. Mrz. 2023	2.665
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley	USD	2.609	298	15. Mai 2029	298
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	1.142.225	(32.279)	24. Mai 2023	(32.279)
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	737	(71)	25. Mai 2023	(71)
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	USD	460.622	7.033	9. Mrz. 2023	7.033
Kauf Long	Elektronik	Morgan Stanley	USD	140.156	(987)	15. Mai 2029	(987)
Kauf Long	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	181.408	(8.025)	25. Mai 2023	(8.025)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	69.666	3.781	24. Mai 2023	3.781
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	348.643	(5.855)	24. Mai 2023	(5.855)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	165.606	7.571	25. Mai 2023	7.571
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	2.118	32	15. Mai 2029	32
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	1.658	80	15. Mai 2029	80
Kauf Long	Aktienindex	J.P. Morgan	JPY	409.368	21.705	02. Mai 2022	21.705
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	935.423	84.776	15. Mai 2029	84.776
Kauf Long	Gas	Morgan Stanley	HKD	80.881	9.231	15. Mai 2029	9.231
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	CHF	6.829	204	24. Mai 2023	204
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	EUR	335.867	(3.094)	24. Mai 2023	(3.094)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	GBP	42.130	(904)	24. Mai 2023	(904)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	HKD	2.884	33	24. Mai 2023	33
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	3.865.458	70.119	24. Mai 2023	70.119
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	125.874	(2.385)	25. Mai 2023	(2.385)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	EUR	3.577	43	20. Jul. 2023	43
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	1.275.734	52.169	22. Aug. 2022	52.169
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	1.388.587	28.776	9. Mrz. 2023	28.776
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	3.468	(54)	22. Aug. 2023	(54)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	CHF	119.975	17.982	15. Mai 2029	17.982
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	EUR	99.739	(2.814)	15. Mai 2029	(2.814)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	GBP	733.462	53.398	15. Mai 2029	53.398
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	HKD	92.312	8.030	15. Mai 2029	8.030
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	USD	575.667	71.379	15. Mai 2029	71.379
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	CHF	17.243	57	24. Mai 2023	57
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	4.970.144	20.184	24. Mai 2023	20.184
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	CHF	114.909	11.780	22. Jun. 2022	11.780
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	872.958	41.418	22. Jun. 2022	41.418
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.347.442	21.314	9. Mrz. 2023	21.314
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	CHF	325.157	25.135	15. Mai 2029	25.135
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.731.185	75.352	15. Mai 2029	75.352
Kauf Long	Holdinggesellschaften - Diverse	Goldman Sachs	USD	88.796	2.440	24. Mai 2023	2.440
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	JPY	49.825	104	24. Mai 2023	104
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	USD	204.860	(4.472)	25. Mai 2023	(4.472)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	166.967	11.258	15. Mai 2029	11.258
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	CAD	141.833	(870)	25. Mai 2023	(870)
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	EUR	388.468	6.392	24. Mai 2023	6.392
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	GBP	342.767	16.359	24. Mai 2023	16.359
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	JPY	341.744	(14.967)	24. Mai 2023	(14.967)
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	872.585	21.031	24. Mai 2023	21.031
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	GBP	222.760	19.620	9. Mrz. 2023	19.620
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	HKD	166.486	(2.909)	9. Mrz. 2023	(2.909)
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	JPY	116.783	13.890	9. Mrz. 2023	13.890
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	USD	91.274	8.259	9. Mrz. 2023	8.259
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	JPY	353.468	11.331	15. Mai 2029	11.331
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	102.842	3.537	15. Mai 2029	3.537
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	USD	387.580	3.614	24. Mai 2023	3.614
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	HKD	140.274	1.298	9. Mrz. 2023	1.298
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	USD	105.301	9.535	9. Mrz. 2023	9.535

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	HKD	8.157	3.627	15. Mai 2029	3.627
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	361.754	27.635	15. Mai 2029	27.635
Kauf Long	Investmentgesellschaften	J.P. Morgan	ZAR	57.315	7.769	9. Mrz. 2023	7.769
Kauf Long	Investmentgesellschaften	Morgan Stanley	ZAR	624.298	95.277	15. Mai 2029	95.277
Kauf Long	Eisen / Stahl	J.P. Morgan	USD	221.722	6.237	9. Mrz. 2023	6.237
Kauf Long	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	USD	672.338	5.595	15. Mai 2029	5.595
Kauf Long	Maschinen - Bau u. Bergbau	Goldman Sachs	USD	331.259	(2.321)	25. Mai 2023	(2.321)
Kauf Long	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	EUR	308.000	(15.420)	24. Mai 2023	(15.420)
Kauf Long	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	399.193	5.123	24. Mai 2023	5.123
Kauf Long	Medien	Goldman Sachs	USD	196.188	2.511	24. Mai 2023	2.511
Kauf Long	Medien	J.P. Morgan	USD	186.781	13.817	9. Mrz. 2023	13.817
Kauf Long	Metallprodukte/Eisenwaren	Morgan Stanley	USD	370.058	50.170	15. Mai 2029	50.170
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	GBP	210.026	(1.912)	24. Mai 2023	(1.912)
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	HKD	108.653	8.689	24. Mai 2023	8.689
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	GBP	801.763	(16.384)	9. Mrz. 2023	(16.384)
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	CAD	289.109	(6.413)	15. Mai 2029	(6.413)
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	USD	509.156	34.864	15. Mai 2029	34.864
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	117.575	(13.088)	25. Mai 2023	(13.088)
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	EUR	135.000	(5.414)	24. Mai 2023	(5.414)
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	SEK	92.244	5.570	24. Mai 2023	5.570
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	USD	448.594	28.660	24. Mai 2023	28.660
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	CAD	152.875	(21.320)	9. Mrz. 2023	(21.320)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	JPY	3.937	(123)	21. Feb. 2024	(123)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	USD	1.498.356	18.047	9. Mrz. 2023	18.047
Kauf Long	Öl u. Gas	Morgan Stanley	CAD	316.074	18.316	15. Mai 2029	18.316
Kauf Long	Öl u. Gas	Morgan Stanley	USD	1.615.805	93.438	15. Mai 2029	93.438
Kauf Long	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	337.758	282	9. Mrz. 2023	282
Kauf Long	Öl- u. Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	104.262	8.287	15. Mai 2029	8.287
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	1.121.806	921	24. Mai 2023	921
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	425.132	17.573	24. Mai 2023	17.573
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	1.336.965	66.912	24. Mai 2023	66.912
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	HKD	6.854	84	24. Mai 2023	84
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	1.737.949	51.351	24. Mai 2023	51.351
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	2.982.292	(42.465)	24. Mai 2023	(42.465)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	141.788	8.161	20. Jul. 2023	8.161
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	6.963	902	9. Mrz. 2023	902
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	118.976	20.408	20. Okt. 2023	20.408
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	HUF	121.493	5.845	9. Mrz. 2023	5.845
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	212.647	24.711	9. Mrz. 2023	24.711
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	2.624.757	181.249	22. Aug. 2022	181.249
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	605.697	57.250	22. Nov. 2022	57.250
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1.174.312	(23.807)	9. Mrz. 2023	(23.807)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	157.473	13.718	15. Mai 2029	13.718
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	GBP	261.884	12.580	15. Mai 2029	12.580
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	272.947	8.115	15. Mai 2029	8.115
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2.071.546	134.227	15. Mai 2029	134.227
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	1.307.670	46.690	9. Mrz. 2023	46.690
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	804.229	78.739	15. Mai 2029	78.739

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Private Equity	Goldman Sachs	GBP	284.172	13.812	24. Mai 2023	13.812
Kauf Long	Private Equity	Goldman Sachs	USD	483.992	17.279	24. Mai 2023	17.279
Kauf Long	Private Equity	J.P. Morgan	GBP	55.092	15.962	9. Mrz. 2023	15.962
Kauf Long	Private Equity	J.P. Morgan	USD	1.365.393	267.330	9. Mrz. 2023	267.330
Kauf Long	Private Equity	Morgan Stanley	GBP	47.491	5.723	15. Mai 2029	5.723
Kauf Long	Private Equity	Morgan Stanley	USD	95.987	13.430	15. Mai 2029	13.430
Kauf Long	Immobilien	Morgan Stanley	USD	1.072	329	15. Mai 2029	329
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	USD	319.161	16.014	9. Mrz. 2023	16.014
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	453.826	32.798	15. Mai 2029	32.798
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	EUR	2.990	64	24. Mai 2023	64
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	JPY	66.684	3.493	24. Mai 2023	3.493
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	217.167	(625)	24. Mai 2023	(625)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	JPY	100.156	15.180	9. Mrz. 2023	15.180
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	503.892	24.070	31. Mai 2022	24.070
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	237.982	(15.938)	15. Mai 2029	(15.938)
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	2.589	5	24. Mai 2023	5
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	112.439	6.269	22. Aug. 2022	6.269
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	668.389	63.850	15. Mai 2029	63.850
Kauf Long	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	50.358	10.793	9. Mrz. 2023	10.793
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	EUR	303.292	37.597	15. Mai 2029	37.597
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	15.588.322	54.610	27. Mrz. 2023	54.610
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	15.766.318	54.516	15. Mai 2029	54.516
Kauf Long	Wasser	Morgan Stanley	USD	190.193	35.877	15. Mai 2029	35.877
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	54.447	(1.952)	24. Mai 2023	(1.952)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	EUR	37.841	(4.825)	9. Mrz. 2023	(4.825)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	24.841	(988)	15. Mai 2029	(988)
Verkauf Short	Fluggesellschaften	Morgan Stanley	USD	130.212	(22.961)	15. Mai 2029	(22.961)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	EUR	209.173	(6.578)	24. Mai 2023	(6.578)
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	USD	40.935	(20.095)	9. Mrz. 2023	(20.095)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	133.186	(15.670)	15. Mai 2029	(15.670)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	1.200.615	(320.574)	15. Mai 2029	(320.574)
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	EUR	72.942	1.802	24. Mai 2023	1.802
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	USD	231.283	(20.350)	24. Mai 2023	(20.350)
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	J.P. Morgan	EUR	11.462	(932)	9. Mrz. 2023	(932)
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	J.P. Morgan	USD	22.507	(1.237)	9. Mrz. 2023	(1.237)
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	EUR	10.960	(257)	15. Mai 2029	(257)
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	54.410	(2.092)	15. Mai 2029	(2.092)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	AUD	358.587	(10.569)	24. Mai 2023	(10.569)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CHF	1.029.467	32.668	24. Mai 2023	32.668
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	3.321.944	31.894	24. Mai 2023	31.894
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	HUF	438.933	11.111	24. Mai 2023	14.839
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	JPY	484.393	18.188	24. Mai 2023	18.188
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	NOK	373.432	1.479	24. Mai 2023	1.479
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SEK	2.010.369	152.426	24. Mai 2023	152.426
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SGD	310.830	(5.632)	24. Mai 2023	(5.632)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	10.435.261	177.013	24. Mai 2023	177.013
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	AUD	74.013	(8.650)	9. Mrz. 2023	(8.650)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	161.993	1.566	9. Mrz. 2023	1.566

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	415.820	(51.303)	22. Jan. 2024	(51.303)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	ILS	927.459	(41.010)	9. Mrz. 2023	(41.010)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	JPY	22.399	(1.205)	9. Mrz. 2023	(1.205)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	JPY	252.319	(13.496)	21. Feb. 2024	(13.496)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	713.960	3.326	20. Jul. 2023	3.326
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	2.167.466	(4.600)	9. Mrz. 2023	(4.600)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	AUD	503.913	(13.658)	15. Mai 2029	(13.658)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	EUR	225.405	1.143	15. Mai 2029	1.143
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	54.591	(358)	15. Mai 2029	(358)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	SEK	793.543	56.663	15. Mai 2029	56.663
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	SGD	451.472	(26.340)	15. Mai 2029	(26.340)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	5.695.437	243.110	15. Mai 2029	243.110
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	HKD	113.963	3.447	24. Mai 2023	3.447
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	HKD	1.108	205	9. Mrz. 2023	205
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	HKD	3.141	(542)	15. Mai 2029	(542)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	AUD	401.143	(1.784)	24. Mai 2023	(1.784)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	236.335	25.858	24. Mai 2023	25.858
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	693.694	24.521	24. Mai 2023	24.521
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	AUD	61.664	(4.704)	20. Mrz. 2024	(4.704)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	HKD	234.338	(25.875)	9. Mrz. 2023	(25.875)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1.716.270	(116.080)	9. Mrz. 2023	(116.080)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	AUD	71.737	(1.229)	15. Mai 2029	(1.229)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	HKD	62.239	(9.520)	15. Mai 2029	(9.520)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	NOK	211.675	(19.529)	15. Mai 2029	(19.529)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	1.631.868	(57.870)	15. Mai 2029	(57.870)
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	CHF	115.334	2.490	22. Sep. 2022	2.490
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	CHF	84.221	166	24. Mai 2023	166
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	EUR	84.887	7.819	24. Mai 2023	7.819
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	78.696	8.647	24. Mai 2023	8.647
Verkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	EUR	55.123	(859)	9. Mrz. 2023	(859)
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	CHF	20.342	(152)	15. Mai 2029	(152)
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	EUR	16.635	1.423	15. Mai 2029	1.423
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	61.235	4.676	15. Mai 2029	4.676
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	EUR	92.714	(418)	24. Mai 2023	(418)
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	GBP	34.833	110	24. Mai 2023	110
Verkauf Short	Chemie	J.P. Morgan	EUR	132.412	(8.256)	9. Mrz. 2023	(8.256)
Verkauf Short	Chemie	J.P. Morgan	GBP	57.225	(3.861)	15. Mai 2029	(3.861)
Verkauf Short	Chemie	Morgan Stanley	EUR	7.205	(413)	15. Mai 2029	(413)
Verkauf Short	Chemie	Morgan Stanley	GBP	14.440	(223)	15. Mai 2029	(223)
Verkauf Short	Chemie	Morgan Stanley	USD	179.286	(18.024)	15. Mai 2029	(18.024)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	60.394	(625)	24. Mai 2023	(625)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	123.860	2.305	22. Sep. 2022	2.305
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	94.121	(3.053)	24. Mai 2023	(3.053)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	11.968	(636)	5. Mrz. 2023	(636)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	465.707	(60.229)	9. Mrz. 2023	(60.229)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	19.416	(522)	22. Mrz. 2023	(522)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	56.806	(2.997)	15. Mai 2029	(2.997)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	2.158.857	(282.805)	15. Mai 2029	(282.805)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	445.133	(42.127)	15. Mai 2029	(42.127)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	JPY	2.627	(73)	24. Mai 2023	(73)
Verkauf Short	Rentenfonds	Morgan Stanley	EUR	1.861.826	(8.183)	15. Mai 2029	(8.183)
Verkauf Short	Rentenfonds	Morgan Stanley	USD	694.803	(22.714)	15. Mai 2029	(22.714)
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	J.P. Morgan	USD	157.999	(12.891)	9. Mrz. 2023	(12.891)
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Morgan Stanley	USD	1.594.667	(59.128)	15. Mai 2029	(59.128)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	510.731	15.192	24. Mai 2023	15.192
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	HKD	302.582	(13.243)	24. Mai 2023	(13.243)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	4.828.201	53.435	24. Mai 2023	53.435
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	ZAR	11.710	915	25. Mai 2023	915
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	75.225	(18.048)	9. Mrz. 2023	(18.048)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	56.601	(1.553)	9. Mrz. 2023	(1.553)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	HKD	580.856	(76.613)	20. Jul. 2022	(69.062)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	522.646	(65.029)	27. Feb. 2023	(65.029)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	908.196	(12.720)	9. Mrz. 2023	(12.720)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	73.152	(5.556)	15. Mai 2029	(5.556)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	268.692	(6.406)	15. Mai 2029	(6.406)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	HKD	213.339	(47.243)	15. Mai 2029	(47.243)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.456.482	(14.854)	15. Mai 2029	(14.854)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	ZAR	63.801	3.319	15. Mai 2029	3.319
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	CAD	214.269	(6.218)	22. Sep. 2022	(6.218)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	DKK	74.424	(3.713)	24. Mai 2023	(3.713)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	EUR	163.435	(8.239)	22. Sep. 2022	(8.239)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	EUR	347.667	(8.600)	24. Mai 2023	(8.600)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	870.502	(48.528)	22. Sep. 2022	(48.528)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	405.683	(17.314)	24. Mai 2023	(17.314)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	1.504.263	(59.233)	9. Mrz. 2023	(59.233)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	DKK	37.357	(2.139)	15. Mai 2029	(2.139)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	HKD	67.485	697	15. Mai 2029	697
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	888.673	(46.776)	15. Mai 2029	(46.776)
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	EUR	121.921	4.450	22. Sep. 2022	4.450
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	EUR	106.615	2.299	24. Mai 2023	2.299
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	201.591	(20.219)	24. Mai 2023	(20.219)
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	J.P. Morgan	USD	8.041	(1.432)	9. Mrz. 2023	(1.432)
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley	USD	35.381	(9.127)	15. Mai 2029	(9.127)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	JPY	846.204	(38.431)	24. Mai 2023	(38.431)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	SEK	102.062	3.748	22. Sep. 2022	3.748
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	194.229	732	24. Mai 2023	732
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	HKD	2.386	102	9. Mrz. 2023	102
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	JPY	3.767	(389)	9. Mrz. 2023	(389)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	SEK	18.467	(1.442)	22. Jun. 2022	(1.442)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	41.891	(5.458)	15. Mai 2029	(5.458)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	358.336	(35.178)	15. Mai 2029	(35.178)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	DKK	169.149	(6.403)	24. Mai 2023	(6.403)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	NOK	97.282	10.703	24. Mai 2023	10.703
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	SEK	41.764	(2.671)	24. Mai 2023	(2.671)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	493.341	(2.081)	24. Mai 2023	(2.081)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	SEK	108.155	(7.385)	9. Mrz. 2023	(7.385)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	100.927	(2.352)	9. Mrz. 2023	(2.352)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	SEK	2.662	(100)	15. Mai 2029	(100)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	USD	85.843	(13.095)	15. Mai 2029	(13.095)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	110.818	3.478	24. Mai 2023	3.478
Verkauf Short	Umweltschutz	Morgan Stanley	NOK	19.952	(2.444)	15. Mai 2029	(2.444)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	EUR	513.422	(2.751)	24. Mai 2023	(2.751)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	JPY	732.111	38.212	24. Mai 2023	38.212
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	5.282.105	(63.500)	24. Mai 2023	(63.537)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	16.566	(74)	25. Mai 2023	(74)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	4.318.625	(290.578)	9. Mrz. 2023	(290.578)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	1.592.968	(84.414)	15. Mai 2029	(84.414)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	22.205.250	(1.189.712)	15. Mai 2029	(1.189.808)
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	241.492	(3.249)	9. Mrz. 2023	(3.249)
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	JPY	4.997	58	9. Mrz. 2023	58
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	163.591	(7.954)	15. Mai 2029	(7.954)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	GBP	541.156	7.768	15. Mai 2029	7.768
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	124.656	(14.662)	15. Mai 2029	(14.662)
Verkauf Short	Gas	Goldman Sachs	EUR	110.117	(11.254)	24. Mai 2023	(11.254)
Verkauf Short	Gas	Goldman Sachs	USD	589.103	(5.678)	22. Sep. 2022	(5.678)
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Goldman Sachs	CHF	121.902	7.161	22. Sep. 2022	7.161
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	J.P. Morgan	CHF	20.851	73	9. Mrz. 2023	73
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	CHF	559.293	(34.129)	24. Mai 2023	(34.129)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	DKK	143.778	2.343	24. Mai 2023	2.343
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	HKD	21.546	309	24. Mai 2023	309
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	SEK	404.300	14.419	24. Mai 2023	14.419
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	1.279.878	(41.639)	24. Mai 2023	(41.639)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	DKK	508.044	51.874	9. Mrz. 2023	51.874
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	SEK	150.966	1.410	9. Mrz. 2023	1.410
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	787.354	(20.661)	9. Mrz. 2023	(20.661)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	HKD	266.053	(42.936)	15. Mai 2029	(42.936)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	SEK	157.938	(516)	15. Mai 2029	(516)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	USD	1.004.189	(72.281)	15. Mai 2029	(72.281)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	121.781	3.866	24. Mai 2023	3.866
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	JPY	165.067	(6.715)	24. Mai 2023	(6.715)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.079.281	(22.168)	24. Mai 2023	(22.168)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	3.424	(477)	9. Mrz. 2023	(477)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	32.130	(889)	9. Mrz. 2023	(889)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	116.444	(15.410)	22. Aug. 2022	(15.410)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	368.277	(26.770)	23. Feb. 2023	(26.770)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	336.987	(39.585)	9. Mrz. 2023	(39.585)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	621.707	(30.094)	15. Mai 2029	(30.094)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	160.529	(4.291)	15. Mai 2029	(4.291)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	373.347	(23.687)	15. Mai 2029	(23.687)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	USD	74.533	5.594	24. Mai 2023	5.594
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Goldman Sachs	USD	41.845	(789)	24. Mai 2023	(789)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	J.P. Morgan	USD	128.256	2.938	9. Mrz. 2023	2.938
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	USD	134.670	(185)	15. Mai 2029	(185)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	EUR	1.264.327	(42.958)	24. Mai 2023	(42.958)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	GBP	20.363	(1.094)	24. Mai 2023	(1.094)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	JPY	436.799	19.299	24. Mai 2023	19.299
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	171.391	(5.071)	22. Sep. 2022	(5.071)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	3.707.662	(126.861)	24. Mai 2023	(126.861)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	ZAR	52.902	(2.228)	25. Mai 2023	(2.228)
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	GBP	247.093	(46.811)	9. Mrz. 2023	(46.811)
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	JPY	25.758	(1.682)	9. Mrz. 2023	(1.682)
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	USD	151.576	(15.297)	9. Mrz. 2023	(15.297)
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	ZAR	201.458	(41.732)	9. Mrz. 2023	(41.732)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	672.612	(11.572)	15. Mai 2029	(11.572)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	JPY	641.573	(11.088)	15. Mai 2029	(11.088)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	1.657.844	(118.950)	15. Mai 2029	(118.950)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	ZAR	48.149	(2.209)	15. Mai 2029	(2.209)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	EUR	224.137	4.351	24. Mai 2023	4.351
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	EUR	215.905	5.583	9. Mrz. 2023	5.583
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	GBP	36.426	702	15. Mai 2029	702
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	97.496	5.080	15. Mai 2029	5.080
Verkauf Short	Eisen / Stahl	Goldman Sachs	USD	110.206	6.430	24. Mai 2023	6.430
Verkauf Short	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	USD	33.447	1.177	15. Mai 2029	1.177
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	USD	172.656	(3.703)	24. Mai 2023	(3.703)
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	10.033	812	15. Mai 2029	812
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	USD	261.371	(21.938)	9. Mrz. 2023	(21.938)
Verkauf Short	Maschinen - Bau u. Bergbau	J.P. Morgan	USD	16.741	4.462	9. Mrz. 2023	4.462
Verkauf Short	Maschinen - Bau u. Bergbau	Morgan Stanley	USD	4.391	1.179	15. Mai 2029	1.179
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	SEK	98.586	7.240	22. Sep. 2022	7.240
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	78.871	(2.058)	24. Mai 2023	(2.058)
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	J.P. Morgan	SEK	16.060	(816)	9. Mrz. 2023	(816)
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	132.969	(8.526)	15. Mai 2029	(8.526)
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	142.562	(7.869)	15. Mai 2029	(7.869)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	GBP	120.770	6.024	22. Sep. 2022	6.024
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	SEK	21.351	(443)	24. Mai 2023	(443)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	495.540	(19.041)	24. Mai 2023	(19.041)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	SEK	74.939	(6.811)	9. Mrz. 2023	(6.811)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	405.826	(27.330)	15. Mai 2029	(27.330)
Verkauf Short	Büro- und Geschäftsausstattung	Morgan Stanley	JPY	177.444	(11.401)	15. Mai 2029	(11.401)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	AUD	233.335	(3.697)	24. Mai 2023	(3.697)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	CAD	70.808	(9.147)	25. Mai 2023	(9.147)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	EUR	863.883	(17.842)	24. Mai 2023	(17.842)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	JPY	285.720	(990)	24. Mai 2023	(990)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	USD	1.553.600	21.362	24. Mai 2023	21.362
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	CAD	844.153	29.703	9. Mrz. 2023	29.703
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	EUR	285.270	670	9. Mrz. 2023	670
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	USD	6.746.060	(670.609)	9. Mrz. 2023	(670.181)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	AUD	26.002	(1.853)	15. Mai 2029	(1.853)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	CAD	15.004	(2.032)	31. Mrz. 2022	(2.032)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	CAD	1.536.895	(299.954)	15. Mai 2029	(299.954)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	USD	1.035.805	(64.410)	15. Mai 2029	(64.410)
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	74.192	(3.176)	24. Mai 2023	(3.176)
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	135.482	(1.704)	9. Mrz. 2023	(1.704)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	87.696	(5.133)	15. Mai 2029	(5.133)
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Goldman Sachs	USD	132.899	1.299	24. Mai 2023	1.299
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Morgan Stanley	USD	217.033	(1.282)	15. Mai 2029	(1.282)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	DKK	808.291	(3.154)	24. Mai 2023	(3.154)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	256.390	4.183	24. Mai 2023	4.183
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	32.998	1.256	24. Mai 2023	1.256
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	313.168	4.403	24. Mai 2023	4.403
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	466.891	3.031	24. Mai 2023	3.031
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	136.465	(4.949)	25. Mai 2023	(4.949)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	DKK	17.228	(1.398)	9. Mrz. 2023	(1.398)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	5.512	(312)	9. Mrz. 2023	(312)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	19.211	(828)	22. Jan. 2024	(828)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	248.778	(7.600)	9. Mrz. 2023	(7.600)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	13.444	(807)	9. Mrz. 2023	(807)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1.121.294	(113.017)	9. Mrz. 2023	(113.017)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	DKK	289.361	(23.906)	15. Mai 2029	(23.906)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	238.908	3.693	15. Mai 2029	3.693
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	HKD	156.687	(31.046)	15. Mai 2029	(31.046)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	493.348	(7.582)	15. Mai 2029	(7.582)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1.144.561	(9.994)	15. Mai 2029	(9.994)
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	614.362	(28.559)	24. Mai 2023	(28.559)
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	987.305	38.859	9. Mrz. 2023	38.859
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	USD	289.729	(26.598)	15. Mai 2029	(26.598)
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	USD	50.480	(2.685)	24. Mai 2023	(2.685)
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	USD	71.114	(14.577)	9. Mrz. 2023	(14.577)
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	EUR	350.970	11.048	24. Mai 2023	11.048
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	EUR	327.452	6.778	20. Sep. 2023	6.778
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	USD	2.713	114	9. Mrz. 2023	114
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	EUR	353.359	16.862	15. Mai 2029	16.862
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	EUR	24.132	(2.631)	24. Mai 2023	(2.631)
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	303.054	(13.801)	22. Sep. 2022	(13.801)
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	328.005	(18.222)	24. Mai 2023	(18.222)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	USD	55.500	(6.820)	5. Mrz. 2023	(6.820)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	USD	26.206	(1.477)	9. Mrz. 2023	(1.477)
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	668.205	(29.846)	15. Mai 2029	(29.846)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	JPY	2.433	(96)	24. Mai 2023	(96)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	106.781	(2.806)	24. Mai 2023	(2.806)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	45.119	4.074	5. Mrz. 2023	4.074
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	1.252.693	64.761	9. Mrz. 2023	64.761
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	JPY	532	(22)	15. Mai 2029	(22)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	SEK	62.619	7.069	15. Mai 2029	7.069
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	936.849	54.477	15. Mai 2029	54.477
Verkauf Short	Spar- und Darlehensgeschäft	Goldman Sachs	USD	130.710	3.391	24. Mai 2023	3.391
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	10.580	128	24. Mai 2023	128
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	677.073	(52.725)	15. Mai 2029	(52.725)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	CHF	252.302	14.413	24. Mai 2023	14.413
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	GBP	64.198	1.784	24. Mai 2023	1.784
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	509.163	(2.452)	24. Mai 2023	(2.452)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	CHF	28.797	(4.373)	22. Nov. 2023	(4.373)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	72.044	(4.918)	15. Mai 2029	(4.918)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	CHF	4.810	(300)	15. Mai 2029	(300)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	EUR	79.802	(463)	15. Mai 2029	(463)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	567.362	(43.000)	15. Mai 2029	(43.000)
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	1.730	(17)	24. Mai 2023	(17)
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	JPY	171.443	(39.286)	22. Jun. 2022	(39.286)
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	341.161	(5.787)	15. Mai 2029	(5.787)
Verkauf Short	Spielwaren / Spiele / Hobbys	Goldman Sachs	USD	73.040	6.111	24. Mai 2023	6.111
Verkauf Short	Spielwaren / Spiele / Hobbys	Morgan Stanley	USD	14.557	1.204	15. Mai 2029	1.204
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	CHF	11.074	343	24. Mai 2023	343
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	USD	143.647	10.685	24. Mai 2023	10.685
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	DKK	272.990	(3.873)	9. Mrz. 2023	(3.873)
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	USD	355.988	14.443	5. Mrz. 2023	14.443
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	USD	568.840	18.169	9. Mrz. 2023	18.169
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	CHF	87.596	3.268	15. Mai 2029	3.268
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	DKK	71.977	8.838	15. Mai 2029	8.838
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	HKD	24.514	(2.443)	15. Mai 2029	(2.443)
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	USD	148.079	(8.843)	15. Mai 2029	(8.843)
USD							(1.449.821)

Differenzkontrakte

Differenzkontrakte 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 2022 wiesen die folgenden Teilfonds Differenzkontrakte auf Finanzindizes und Futures-Kontrakte auf:

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD auf den Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Credit Suisse	(113)	(72.139)	(1.527)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Credit Suisse	(96)	(14.516)	134
CFD auf den Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Credit Suisse	299	235.054	31.284
CFD auf den Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Credit Suisse	24	33.011	216
CFD auf den Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Credit Suisse	(17)	(10.755)	199
CFD auf den Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Credit Suisse	67	51.067	3.518
CFD auf den Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Credit Suisse	105	94.150	(288)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Credit Suisse	516	607.569	7.555
CFD auf den Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Index	Credit Suisse	(35)	(26.770)	(283)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Credit Suisse	334	120.804	458
CFD auf den Stoxx Europe 600 Media Price Index	Credit Suisse	386	150.851	(809)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Credit Suisse	683	238.654	8.142
CFD auf den Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Credit Suisse	(32)	(34.295)	(470)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Retail Price Index	Credit Suisse	(367)	(130.413)	7.617
CFD auf den Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Credit Suisse	(134)	(99.457)	(3.770)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)				
CFD auf den Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Credit Suisse	1.118	287.677	402
CFD auf den Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Credit Suisse	(1.099)	(252.588)	22.243
CFD auf den Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Credit Suisse	108	46.599	(184)
CFD auf den S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	44	64.358	(2.195)
CFD auf den S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	1.316	1.041.573	8.774
CFD auf den S&P 500 Energy Sector Index	Goldman Sachs	345	200.765	20.453
CFD auf den S&P 500 Financials Sector Index	Goldman Sachs	802	511.365	(18.898)
CFD auf den S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	740	1.180.156	10.087
CFD auf den S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	965	839.992	(6.081)
CFD auf den S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	133	371.613	(1.538)
CFD auf den S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	1.607	889.397	(2.056)
CFD auf den S&P 500 Utilities Sector Index	Goldman Sachs	2.200	831.874	58.131
			USD 7.155.596	141.114
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
CFD auf australische Aktien	Morgan Stanley	(65.230)	(244.058)	(244.058)
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	(117.861)	452.588	452.588
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	(27.688)	(183.848)	(183.848)
CFD auf deutsche Aktien	Morgan Stanley	279.978	1.321.732	1.321.732
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	(711.120)	(1.714.115)	(1.714.115)
CFD auf japanische Aktien	Morgan Stanley	(95.572)	(591.928)	(591.928)
CFD auf norwegische Aktien	Morgan Stanley	513.610	443.378	443.378
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	(96.566)	(312.874)	(312.874)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(1.281.128)	(7.154.354)	(7.440.591)
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(1.913.305)	(13.788.463)	(13.788.463)
			USD (21.771.942)	(22.058.179)
Schroder GAIA Helix				
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	1.760.249	516.618	516.618
CFD auf australische Aktien	J.P. Morgan	2.308.917	761.582	761.582
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	45.558	233.842	233.842
CFD auf belgische Aktien	J.P. Morgan	7.741	27.176	27.176
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	27.365.347	3.603.291	3.601.178
CFD auf britische Aktien	J.P. Morgan	2.950.743	152.748	147.243
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	26.767	(1.886)	(1.886)
CFD auf kanadische Aktien	J.P. Morgan	76.576	(91.609)	(91.609)
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	19.463.547	(2.170.047)	(2.171.170)
CFD auf chinesische Aktien	J.P. Morgan	6.241.600	335.905	335.905
CFD auf dänische Aktien	Goldman Sachs	21.232	214.283	214.283
CFD auf dänische Aktien	J.P. Morgan	79.102	(101.758)	(101.758)
CFD auf niederländische Aktien	Goldman Sachs	849.416	477.310	477.289
CFD auf niederländische Aktien	J.P. Morgan	247.420	351.400	351.400
CFD auf finnische Aktien	J.P. Morgan	27.920	4.505	4.505
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	246.284	657.451	648.445
CFD auf französische Aktien	J.P. Morgan	117.952	105.659	105.659
CFD auf georgische Aktien	Goldman Sachs	(38.462)	9.095	9.095
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	297.073	827.309	822.693
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	192.473	(438.701)	(438.701)
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	6.409.189	(78.268)	(78.268)
CFD auf Aktien aus Hongkong	J.P. Morgan	2.901.100	174.241	174.241
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	108.578	192.478	192.478

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Helix (Forts.)					
CFD auf indische Aktien	J.P. Morgan	138.304	(174.908)	(174.908)	
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	39.524	124.305	115.906	
CFD auf irische Aktien	J.P. Morgan	40.549	449	449	
CFD auf Aktien von der Insel Man	Goldman Sachs	(394.740)	278.841	278.841	
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	311.400	98.162	98.162	
CFD auf italienische Aktien	J.P. Morgan	509.930	312.233	312.233	
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	760.600	358.950	358.950	
CFD auf japanische Aktien	J.P. Morgan	8.377.450	1.792.117	1.796.573	
CFD auf Aktien aus Jersey	Goldman Sachs	218	(30)	(30)	
CFD auf luxemburgische Aktien	Goldman Sachs	(7.457)	(2.970)	(2.970)	
CFD auf Aktien aus Macau	Goldman Sachs	170.000	47.072	47.072	
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	80.374	(12.812)	(12.812)	
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P. Morgan	734.047	(76.310)	(76.310)	
CFD auf norwegische Aktien	Goldman Sachs	77.323	70.288	70.288	
CFD auf norwegische Aktien	J.P. Morgan	161.527	88.388	88.388	
CFD auf portugiesische Aktien	J.P. Morgan	55.422	7.112	7.112	
CFD auf russische Aktien	Goldman Sachs	6.978	-	-	
CFD auf saudi-arabische Aktien	J.P. Morgan	496.430	61.197	61.197	
CFD auf Aktien aus Singapur	Goldman Sachs	4.431.058	394.728	394.728	
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	1.903.100	429.541	429.541	
CFD auf südafrikanische Aktien	Goldman Sachs	60.839	12.400	12.400	
CFD auf südkoreanische Aktien	Goldman Sachs	(10.242)	(173.553)	(173.553)	
CFD auf spanische Aktien	Goldman Sachs	7.234	(90.274)	(90.274)	
CFD auf spanische Aktien	J.P. Morgan	108.668	20.729	20.729	
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	(429.126)	(110.230)	(110.230)	
CFD auf schwedische Aktien	J.P. Morgan	697.280	(180.248)	(180.248)	
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	(5.722)	(14.919)	(14.919)	
CFD auf Schweizer Aktien	J.P. Morgan	98.078	(182.825)	(182.825)	
CFD auf taiwanische Aktien	Goldman Sachs	3.416	22.926	22.926	
CFD auf taiwanische Aktien	J.P. Morgan	(1.892.481)	(8.645)	(8.645)	
CFD auf Aktien aus den Vereinigten Arabischen Emiraten	J.P. Morgan	67.147	26.551	26.551	
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	1.827.446	676.348	679.052	
CFD auf US-Aktien	J.P. Morgan	1.339.214	847.450	847.450	
CFD auf FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(477)	(96.191)	(96.191)	
CFD auf den HXE Defence Index	Goldman Sachs	68.752	575.036	632.504	
CFD auf den HXE Miners Index	Goldman Sachs	50.131	265.230	246.221	
CFD auf den HXE Pharma Index	Goldman Sachs	59.523	363.234	328.460	
CFD auf den HXE Shipping Index	Goldman Sachs	113.412	(465.618)	(365.850)	
CFD auf den HXE Staples Index	Goldman Sachs	77.105	182.609	102.589	
CFD auf MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(69.899)	1.330.877	1.330.877	
			USD	12.559.864	12.559.674
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund					
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	947.539	163.435	163.575	
CFD auf niederländische Aktien	Morgan Stanley	35.067	30.859	30.859	
CFD auf Aktien von der Insel Man	Morgan Stanley	(162.722)	88.593	88.593	
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(41.103)	(22.031)	(22.031)	
CFD auf FTSE 250 Index	Bank of America	(191)	(29.320)	(29.320)	
CFD auf den MSBEUK01 Index	Morgan Stanley	(19.440)	(1.555)	(1.555)	
			GBP	229.981	230.121

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Credit Default Index-Swaps

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

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

Am 31. März 2022 waren die folgenden Teilfonds Credit Default Index-Kontrakte auf Finanzindizes eingegangen:

Schutz- position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Zinsen (bezahlt/ erhalten %	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 37 20/06/2027	J.P. Morgan	EUR	4.000.000	5,00	20. Jun. 2027	(33.462)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 37 20/06/2027	J.P. Morgan	EUR	21.000.000	1,00	20. Jun. 2027	(246.781)
Verkauf	CDX North America High Yield Series 38 20/06/2027	J.P. Morgan	USD	5.000.000	5,00	20. Jun. 2027	(28.748)
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 38 20/06/2027	J.P. Morgan	USD	28.000.000	1,00	20. Jun. 2027	(21.390)
						USD	(330.381)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 37 20/06/2027	Citi Bank	EUR	10.000.000	1,00	20. Jun. 2027	(17.067)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 37 20/06/2027	Citi Bank	EUR	16.000.000	1,00	20. Jun. 2027	26.932
Verkauf	CDX North America High Yield Series 38 20/06/2027	Citi Bank	USD	20.000.000	5,00	20. Jun. 2027	172.676
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 38 20/06/2027	Citi Bank	USD	30.000.000	1,00	20. Jun. 2027	(34.847)
						USD	147.694
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	EUR	6.100.000	5,00	20. Dez. 2026	63.679
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 37 20/06/2027	Morgan Stanley	EUR	4.012.000	5,00	20. Jun. 2027	(18.342)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	EUR	7.510.000	1,00	20. Dez. 2026	(25.642)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 37 20/06/2027	Morgan Stanley	EUR	46.180.000	1,00	20. Jun. 2027	(127.173)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	EUR	24.345.000	1,00	20. Dez. 2026	(40.345)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 37 20/06/2027	Morgan Stanley	EUR	27.830.000	1,00	20. Jun. 2027	77.595
Verkauf	CDX iTraxx Europe Subordinated Financial Series 37 20/06/2027	Morgan Stanley	EUR	3.195.000	1,00	20. Jun. 2027	(7.204)
Verkauf	CDX North America High Yield Series 38 20/06/2027	Morgan Stanley	USD	6.470.000	5,00	20. Jun. 2027	(37.545)
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 38 20/06/2027	Morgan Stanley	USD	24.530.000	1,00	20. Jun. 2027	(45.975)
						USD	(160.952)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Credit Default Swaps

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

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

Zum 31. März 2022 war der folgende Teilfonds Credit-Default-Swap-Kontrakte eingegangen:

Schutz- position	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	Australien	Bergbau	Morgan Stanley	EUR	510.000	20. Dez. 2026	21.667
Verkauf	Österreich	Telekommunikation	Morgan Stanley	EUR	3.505.000	20. Jun. 2027	(16.594)
Verkauf	Belgien	Chemie	Morgan Stanley	EUR	1.050.000	20. Jun. 2027	(3.719)
Verkauf	Brasilien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.627.000	20. Dez. 2026	19.142
Verkauf	Chile	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2.989.000	20. Dez. 2026	(33.640)
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.495.430	20. Dez. 2026	33
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	549.000	20. Jun. 2027	(89)
Verkauf	Kolumbien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.607.000	20. Dez. 2026	3.114
Verkauf	Finnland	Elektrik	Morgan Stanley	EUR	600.000	20. Dez. 2026	7.694
Verkauf	Finnland	Elektrik	Morgan Stanley	EUR	640.000	20. Jun. 2027	(3.534)
Verkauf	Finnland	Forstprodukte und Papier	Morgan Stanley	EUR	1.925.000	20. Jun. 2027	(18.148)
Verkauf	Frankreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	925.000	20. Jun. 2027	(3.304)
Verkauf	Frankreich	Bekleidung	Morgan Stanley	EUR	2.895.000	20. Jun. 2027	(3.349)
Verkauf	Frankreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	2.385.000	20. Jun. 2027	(35.252)
Kauf	Frankreich	Banken	Barclays Bank	EUR	4.348.750	20. Dez. 2026	63.276
Verkauf	Frankreich	Banken	Morgan Stanley	EUR	232.500	20. Dez. 2026	(127)
Verkauf	Frankreich	Getränke	Morgan Stanley	EUR	1.040.000	20. Jun. 2027	(2.428)
Kauf	Frankreich	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	275.000	20. Dez. 2026	19.392
Verkauf	Frankreich	Vertrieb/Großhandel	Morgan Stanley	EUR	605.000	20. Jun. 2027	(2.808)
Verkauf	Frankreich	Elektrik	Morgan Stanley	EUR	2.180.000	20. Jun. 2027	(2.752)
Verkauf	Frankreich	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	4.155.000	20. Jun. 2027	(29.580)
Verkauf	Frankreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	1.580.000	20. Jun. 2027	(2.468)
Verkauf	Frankreich	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	EUR	1.355.000	20. Jun. 2027	(7.263)
Verkauf	Frankreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	2.610.000	20. Jun. 2027	(6.784)
Verkauf	Deutschland	Fluggesellschaften	Morgan Stanley	EUR	665.000	20. Jun. 2027	(7.849)
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	7.126.000	20. Jun. 2027	(39.326)
Verkauf	Deutschland	Chemie	Morgan Stanley	EUR	3.805.000	20. Jun. 2027	3.634
Verkauf	Deutschland	Elektrik	Morgan Stanley	EUR	1.665.000	20. Jun. 2027	(15.747)
Verkauf	Deutschland	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	EUR	2.105.000	20. Jun. 2027	(5.765)
Verkauf	Indonesien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2.069.000	20. Dez. 2026	26.797
Verkauf	Indonesien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.103.000	20. Jun. 2027	5.858
Kauf	Italien	Banken	BNP Paribas	EUR	1.040.000	20. Jun. 2027	(3.618)
Kauf	Luxemburg	Chemie	Credit Suisse	EUR	805.000	20. Jun. 2027	(10.099)
Verkauf	Luxemburg	Chemie	J.P. Morgan	EUR	775.000	20. Dez. 2024	(30.905)
Verkauf	Luxemburg	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	EUR	720.000	20. Jun. 2027	(11.320)
Kauf	Luxemburg	Medien	Barclays Bank	EUR	340.000	20. Dez. 2024	24.252
Verkauf	Malaysia	Öffentliche Hand	Goldman Sachs	USD	335.000	20. Dez. 2026	(4.383)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Credit Default Swaps (Forts.)

Schutz- position	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Wäh- rung	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf	Malaysia	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	EUR	1.065.000	20. Jun. 2027	(5.402)
Verkauf	Mexiko	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	442.000	20. Jun. 2027	943
Verkauf	Mexiko	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.062.000	20. Dez. 2026	(15.869)
Verkauf	Niederlande	Chemie	Morgan Stanley	EUR	1.025.000	20. Jun. 2027	(2.334)
Verkauf	Niederlande	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	1.045.000	20. Jun. 2027	(5.262)
Verkauf	Niederlande	Transport	Morgan Stanley	EUR	1.000.000	20. Jun. 2027	(2.728)
Verkauf	Peru	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	503.170	20. Dez. 2026	3.841
Verkauf	Philippinen	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	485.000	20. Jun. 2027	(340)
Verkauf	Philippinen	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	514.000	20. Dez. 2026	1.836
Verkauf	Saudi-Arabien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	557.000	20. Jun. 2027	234
Verkauf	Saudi-Arabien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	460.000	20. Dez. 2026	(121)
Verkauf	Südafrika	Bergbau	Morgan Stanley	EUR	580.000	20. Dez. 2026	21.871
Verkauf	Südafrika	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.647.000	20. Dez. 2026	21.851
Verkauf	Südkorea	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2.855.000	20. Dez. 2024	33.596
Verkauf	Südkorea	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.512.000	20. Dez. 2026	773
Verkauf	Spanien	Bau- und Ingenieurwesen	Credit Suisse	EUR	345.000	20. Dez. 2026	5.138
Verkauf	Spanien	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	345.000	20. Dez. 2026	5.269
Verkauf	Spanien	Pharmazeutika	Credit Suisse	EUR	340.000	20. Dez. 2026	16.404
Verkauf	Spanien	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	205.000	20. Dez. 2026	1.857
Verkauf	Spanien	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	255.000	20. Dez. 2026	14.934
Verkauf	Schweiz	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	2.735.000	20. Jun. 2027	4.819
Verkauf	Türkei	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	667.000	20. Jun. 2027	(9.556)
Verkauf	Vereinigte Arabische Emirate	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.400.000	20. Jun. 2027	238
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1.020.000	20. Jun. 2027	(3.337)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Luft- und Raumfahrt/ Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	295.000	20. Jun. 2027	(10.891)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Bank of America	EUR	235.000	20. Jun. 2025	(3.942)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	410.000	20. Dez. 2025	(17.549)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1.820.000	20. Jun. 2027	(30.756)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Banken	Bank of America	EUR	1.450.000	20. Jun. 2027	(8.059)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Banken	J.P. Morgan	EUR	1.520.000	20. Jun. 2027	(4.626)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Banken	Morgan Stanley	EUR	1.615.000	20. Jun. 2027	(7.017)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	275.000	20. Dez. 2026	997
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	6.315.000	20. Jun. 2027	(19.022)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	2.265.000	20. Jun. 2027	(4.189)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Unterhaltung	Morgan Stanley	EUR	205.000	20. Dez. 2026	9.558
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	3.680.000	20. Jun. 2027	(25.013)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	550.000	20. Dez. 2026	(18.389)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	275.000	20. Dez. 2024	(5.365)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmitteldienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	1.005.000	20. Jun. 2027	(2.866)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	2.205.000	20. Dez. 2026	43.262
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	3.315.000	20. Jun. 2027	(12.449)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	985.000	20. Jun. 2027	(1.362)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Einzelhandel	Bank of America	EUR	325.000	20. Dez. 2026	6.298
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	1.400.000	20. Jun. 2027	(2.693)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	612.500	20. Dez. 2026	6.433
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Telekommunikation	Morgan Stanley	EUR	3.350.000	20. Jun. 2027	(9.455)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	955.000	20. Jun. 2027	(5.661)
Kauf	Vereinigte Staaten	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	500.000	20. Dez. 2024	9.815

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Credit Default Swaps (Forts.)

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf	Vereinigte Staaten	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	335.000	20. Dez. 2026	(65.300)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	910.000	20. Jun. 2025	(38.867)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	1.895.000	20. Jun. 2027	(19.538)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Medien	Morgan Stanley	USD	1.155.000	20. Dez. 2024	1.343
Kauf	Vereinigte Staaten	Immobilien	J.P. Morgan	USD	705.000	20. Jun. 2024	(59.290)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Immobilien	Morgan Stanley	USD	340.000	20. Dez. 2026	(10.556)
USD							(322.486)

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-Kontrakten 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 2022 war der folgende Teilfonds in Cross-Currency Swap-Kontrakten 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	26.185.000	USD	4.072.444	21. Sep. 2024	3,11 %	USD SOFR 1 Day	(47.065)
Citibank	CNH	22.204.000	USD	3.446.595	21. Sep. 2024	3,07 %	USD SOFR 1 Day	(43.889)
Goldman Sachs	TRY	15.378.000	USD	1.043.992	21. Sep. 2023	35,35 %	USD SOFR 1 Day	(19.812)
HSBC	CNH	21.843.000	USD	3.396.781	21. Sep. 2024	3,21 %	USD SOFR 1 Day	(46.292)
Morgan Stanley	USD	17.045.552	GBP	12.796.000	15. Jun. 2027	USD SOFR 1 Day	GBP SONIA 1 Day	(196.174)
Morgan Stanley	USD	17.752.628	AUD	24.322.000	21. Sep. 2027	USD SOFR 1 Day	AUD BBR 3 Months	467.251
Morgan Stanley	USD	17.978.479	CAD	22.723.000	21. Sep. 2027	USD SOFR 1 Day	CAD BA 3 Months	185.423
Morgan Stanley	USD	18.034.602	NOK	159.590.000	21. Sep. 2027	USD SOFR 1 Day	NOK NIBOR 3 Months	91.197
Morgan Stanley	USD	17.679.576	NZD	26.030.000	21. Sep. 2027	USD SOFR 1 Day	NZD BBR 3 Months	360.066
Morgan Stanley	USD	18.124.464	SEK	175.443.000	21. Sep. 2027	USD SOFR 1 Day	SEK STIBOR 3 Months	551.015
USD								1.301.720

Inflationsswaps

Ein Inflationsswap ermöglicht die Übertragung des Inflationsrisikos. Eine Vertragspartei versucht, ihr Risiko (durch Absicherung) zu reduzieren, während die andere das Risikoengagement (durch Spekulation) erhöht. Die Partei, die ihr Inflationsrisiko absichern möchte, zahlt einen variablen Zinssatz, der an einen Inflationsindex gekoppelt ist, und erhält dafür feste Cashflows. Durch das Tauschen von variablen gegen feste Zinssätze verringert sich das Inflationsrisiko der absichernden Partei und die Sicherheit der zukünftigen Cashflows wird erhöht. Die Inflationsswaps 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 Inflationsswaps“ aufgeführt.

Zum 31. März 2022 war der folgende Teilfonds in Inflationsswaps engagiert:

Nennbetrag	Währung	Kontrahent	Wertpapierbeschreibung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
3.235.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 3,28 %, Erhält variablen Zinssatz HICPX 5 Year	15. Mrz. 2027	(16.675)
755.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,61 %, Erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Year	15. Mrz. 2032	8.604
760.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,71 %, Erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Year	15. Mrz. 2032	(959)
USD					(9.030)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps

Zur Absicherung gegen Zinsschwankungen kann die Gesellschaft Zins-Swap-Geschäfte abschließen, sofern

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

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

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

Zum 31. März 2022 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Zinssätze engagiert:

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Zahlt Festzinssatz 6,33 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	49.474.298	BRL	2. Jan. 2023	568.374
Erhält Festzinssatz 11,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	20.976.406	BRL	2. Jan. 2024	7.359
Zahlt Festzinssatz 6,79 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	20.976.406	BRL	2. Jan. 2024	415.388
Erhält Festzinssatz 12,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	49.474.298	BRL	2. Jan. 2023	74.128
Zahlt Festzinssatz 10,94 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	40.000.000	BRL	2. Jan. 2025	(500)
Erhält Festzinssatz 10,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	40.000.000	BRL	2. Jan. 2025	(19.759)
Zahlt Festzinssatz 10,62 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	60.786.035	BRL	2. Jan. 2024	105.097
Erhält Festzinssatz 11,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	60.786.035	BRL	2. Jan. 2024	1.003
Erhält Festzinssatz 2,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	744.765	USD	15. Jun. 2026	313
Zahlt Festzinssatz 0,88 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	9.744.765	USD	15. Jun. 2026	559.382
Zahlt Festzinssatz 1,98 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	2.000.000	USD	15. Jun. 2042	40.529
Zahlt Festzinssatz 0,24 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	6.000.000	CHF	15. Jun. 2032	446.803
Erhält Festzinssatz 2,42 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	5.444.626	USD	15. Jun. 2024	(2.914)
Zahlt Festzinssatz 0,59 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	20.444.626	USD	15. Jun. 2024	757.762
Zahlt Festzinssatz 1,98 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	1.000.000	USD	15. Jun. 2042	20.265
Zahlt Festzinssatz -0,21 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	8.133.333	CHF	15. Jun. 2027	357.045
Zahlt Festzinssatz 0,24 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	1.000.000	CHF	15. Jun. 2032	74.467
Zahlt Festzinssatz 2,03 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	2.500.000	USD	15. Jun. 2047	6.784
Erhält Festzinssatz 0,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	133.333	CHF	15. Jun. 2027	(866)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 1,65 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	4.000.000	USD	15. Jun. 2029	140.356
Zahlt Festzinssatz 1,65 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	2.000.000	USD	15. Jun. 2029	70.178
Zahlt Festzinssatz 0,46 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	100.000.000	JPY	15. Jun. 2042	14.158
Zahlt Festzinssatz 0,46 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	700.000.000	JPY	15. Jun. 2042	99.105
Zahlt Festzinssatz 7,62 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	27.848.102	MXN	2. Jun. 2032	57.345
Zahlt Festzinssatz 7,64 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	22.151.898	MXN	2. Jun. 2032	44.072
Zahlt Festzinssatz 2,77 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	2.000.000	NZD	15. Jun. 2032	77.955
Erhält Festzinssatz 2,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	2.000.000	NZD	15. Jun. 2032	(93.824)
Erhält Festzinssatz 3,09 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	117.878	NZD	15. Jun. 2024	(660)
Zahlt Festzinssatz 2,58 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	117.878	NZD	15. Jun. 2024	1.461
Erhält Festzinssatz 6,43 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	91.745.195	ZAR	15. Jun. 2027	(193.332)
Zahlt Festzinssatz 7,55 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	141.745.195	ZAR	15. Jun. 2027	(156.055)
Zahlt Festzinssatz 6,71 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	255.784.116	ZAR	15. Jun. 2024	(127.207)
Erhält Festzinssatz 5,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	155.784.116	ZAR	15. Jun. 2024	(122.003)
Zahlt Festzinssatz -0,46 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	26.921.730	EUR	15. Jun. 2024	694.577
Erhält Festzinssatz 0,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	16.921.730	EUR	15. Jun. 2024	(73.398)
Zahlt Festzinssatz 0,84 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	40.000.000	SEK	15. Jun. 2032	431.478
Zahlt Festzinssatz 0,63 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	82.300.566	SEK	15. Jun. 2027	531.576
Erhält Festzinssatz 1,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	22.300.566	SEK	15. Jun. 2027	(11.583)
Erhält Festzinssatz 1,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	36.797.988	SEK	15. Jun. 2024	(15.716)
Zahlt Festzinssatz 0,20 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	136.797.988	SEK	15. Jun. 2024	401.464
Zahlt Festzinssatz 7,23 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	121.202.979	MXN	12. Jun. 2024	168.552
Zahlt Festzinssatz 7,78 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	167.903.548	MXN	9. Jun. 2027	200.206

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 7,44 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	67.903.548	MXN	9. Jun. 2027	(127.308)
Erhält Festzinssatz 8,99 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	121.202.979	MXN	12. Jun. 2024	26.076
Erhält Festzinssatz 0,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	100.000.000	JPY	15. Jun. 2042	24.150
Erhält Festzinssatz 1,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	50.000.000	SEK	15. Jun. 2024	10.365
Erhält Festzinssatz 2,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	20.000.000	SEK	15. Jun. 2027	12.692
				USD	5.495.340
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Zahlt Festzinssatz 7,10 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	128.441	BRL	4. Jan. 2027	4.677
Zahlt Festzinssatz 7,71 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	11.711.490	BRL	4. Jan. 2027	350.606
Zahlt Festzinssatz 8,01 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	8.960.782	BRL	4. Jan. 2027	239.207
Zahlt Festzinssatz 8,07 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	9.794.388	BRL	4. Jan. 2027	254.623
Zahlt Festzinssatz 7,75 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	2.818.214	BRL	4. Jan. 2027	83.721
Zahlt Festzinssatz 7,74 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	464.072	BRL	4. Jan. 2027	13.961
Erhält Festzinssatz 6,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Citi Bank	717.869.000	COP	16. Sep. 2031	(3.168)
Erhält Festzinssatz 7,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	5.960.351.000	COP	16. Sep. 2031	(11.996)
Erhält Festzinssatz 0,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	2.224.000	GBP	21. Dez. 2023	(56.388)
Erhält Festzinssatz 6,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	4.094.833.000	COP	16. Dez. 2031	(19.798)
Zahlt Festzinssatz 1,67 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	1.459.988.000	KRW	16. Dez. 2031	45.092
Erhält Festzinssatz 1,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	4.663.000	ILS	16. Dez. 2031	(34.379)
Erhält Festzinssatz 0,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	24.810.000	ILS	15. Mrz. 2024	(107.493)
Zahlt Festzinssatz 10,50 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Goldman Sachs	3.792.064	BRL	4. Jan. 2027	20.449
Zahlt Festzinssatz 3,20 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Bank of America	12.513.000	MYR	20. Mrz. 2027	46.663
Zahlt Festzinssatz 2,10 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.580.423.000	KRW	17. Mrz. 2032	25.495
Zahlt Festzinssatz 6,79 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	BNP Paribas	5.182.227.000	COP	20. Dez. 2026	33.297

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 0,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.468.000	EUR	17. Mrz. 2032	(111.848)
Zahlt Festzinssatz 5,53 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	2.787.436.000	CLP	21. Dez. 2023	64.096
Zahlt Festzinssatz 5,61 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Bank of America	3.682.727.000	CLP	21. Dez. 2023	59.763
Zahlt Festzinssatz 12,18 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Goldman Sachs	2.379.766	BRL	4. Jan. 2027	(29.296)
Zahlt Festzinssatz 12,15 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	3.026.271	BRL	4. Jan. 2027	(36.235)
Zahlt Festzinssatz 12,11 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	3.031.854	BRL	4. Jan. 2027	(34.942)
Zahlt Festzinssatz 3,02 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.178.000	PLN	15. Mrz. 2024	35.609
Zahlt Festzinssatz 1,01 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4.410.000	USD	15. Mrz. 2024	71.434
Zahlt Festzinssatz 1,38 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3.741.000	USD	20. Mrz. 2027	48.981
Erhält Festzinssatz 5,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	221.195.000	MXN	5. Mai 2022	(10.549)
Erhält Festzinssatz 7,29 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.488.772.000	COP	16. Dez. 2031	78
Zahlt Festzinssatz 11,33 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	778.022	BRL	4. Jan. 2027	(1.696)
Zahlt Festzinssatz 2,06 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	17.763.000	CAD	15. Jun. 2027	403.032
Zahlt Festzinssatz 1,00 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	1.772.000	GBP	15. Jun. 2024	33.871
Erhält Festzinssatz 0,91 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	675.000	GBP	15. Jun. 2027	5.896
Zahlt Festzinssatz 5,43 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	126.297.000	ZAR	15. Jun. 2023	24.697
Erhält Festzinssatz 1,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10.320.000	USD	20. Mrz. 2026	(198.199)
Zahlt Festzinssatz 1,45 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.185.000	USD	20. Mrz. 2034	118.443
Erhält Festzinssatz 1,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10.370.000	USD	20. Mrz. 2026	(198.865)
Zahlt Festzinssatz 1,46 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.190.000	USD	20. Mrz. 2034	117.272
Erhält Festzinssatz 1,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10.300.000	USD	20. Mrz. 2026	(188.936)
Zahlt Festzinssatz 1,48 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.180.000	USD	20. Mrz. 2034	113.835
Zahlt Festzinssatz 1,47 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.177.000	USD	20. Mrz. 2034	114.284

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 1,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10.299.000	USD	20. Mrz. 2026	(192.232)
Zahlt Festzinssatz 1,49 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	440.000	USD	20. Mrz. 2034	22.480
Erhält Festzinssatz 1,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6.240.000	USD	20. Mrz. 2026	(117.121)
Erhält Festzinssatz 1,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.080.000	USD	20. Mrz. 2026	(38.961)
Zahlt Festzinssatz 1,48 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.320.000	USD	20. Mrz. 2034	68.252
Erhält Festzinssatz 1,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10.400.000	USD	20. Mrz. 2026	(200.524)
Zahlt Festzinssatz 1,47 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.200.000	USD	20. Mrz. 2034	115.684
Zahlt Festzinssatz 1,45 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.200.000	USD	20. Mrz. 2034	120.651
Erhält Festzinssatz 1,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10.400.000	USD	20. Mrz. 2026	(213.772)
Zahlt Festzinssatz 10,30 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	816.984	BRL	4. Jan. 2027	7.035
Erhält Festzinssatz 1,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	12.476.000	USD	20. Mrz. 2026	(262.650)
Zahlt Festzinssatz 1,41 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.642.000	USD	20. Mrz. 2034	154.108
Erhält Festzinssatz 5,62 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	265.567.000	CLP	17. Mrz. 2032	(585)
Erhält Festzinssatz 2,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	17.766.000	NOK	16. Sep. 2031	(65.784)
Erhält Festzinssatz 1,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3.565.000	USD	10. Jan. 2033	(152.601)
Zahlt Festzinssatz 1,72 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.810.000	USD	20. Mrz. 2034	85.538
Erhält Festzinssatz 1,62 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	13.110.000	USD	20. Mrz. 2026	(185.099)
Zahlt Festzinssatz 1,73 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.815.000	USD	20. Mrz. 2034	84.081
Erhält Festzinssatz 1,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	13.110.000	USD	20. Mrz. 2026	(181.486)
Zahlt Festzinssatz 1,77 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.390.000	USD	20. Mrz. 2034	37.156
Erhält Festzinssatz 1,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6.510.000	USD	20. Mrz. 2026	(84.221)
Zahlt Festzinssatz 9,30 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13.245.000	ZAR	17. Jun. 2032	2.136
Zahlt Festzinssatz 9,22 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	11.339.000	ZAR	17. Jun. 2032	3.731

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 6,16 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	186.645.000	INR	19. Jun. 2027	27.459
Zahlt Festzinssatz 6,25 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Bank of America	57.301.200	INR	19. Jun. 2027	5.940
Erhält Festzinssatz 1,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Citi Bank	1.635.000	SGD	15. Jun. 2024	(23.030)
Zahlt Festzinssatz 1,69 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3.395.000	USD	6. Jan. 2033	149.445
Zahlt Festzinssatz 1,63 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.745.000	USD	6. Feb. 2028	5.531
Zahlt Festzinssatz 5,65 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.431.565.000	CLP	15. Jun. 2027	71.597
Zahlt Festzinssatz 0,59 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	4.102.000	GBP	16. Jun. 2032	(366)
Zahlt Festzinssatz 7,48 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	35.660.000	MXN	9. Jun. 2027	63.763
Zahlt Festzinssatz 3,41 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.600.000	CZK	15. Jun. 2032	11.685
Zahlt Festzinssatz 5,95 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Standard Chartered Bank	230.550.000	INR	15. Jun. 2027	8.950
Zahlt Festzinssatz 11,13 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Deutsche Bank	8.957.149	BRL	4. Jan. 2027	6.846
Zahlt Festzinssatz 1,75 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.725.000	USD	15. Jun. 2027	43.653
Zahlt Festzinssatz 4,50 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	286.428.000	HUF	16. Jun. 2032	14.631
Erhält Festzinssatz 1,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	5.631.000	SGD	21. Jun. 2024	(35.162)
Zahlt Festzinssatz 4,11 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.826.000	PLN	15. Jun. 2027	61.761
Erhält Festzinssatz 8,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	9.388.193.000	COP	15. Jun. 2024	(20.876)
Zahlt Festzinssatz 5,79 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.086.801.000	HUF	15. Jun. 2024	92.627
Erhält Festzinssatz 4,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	22.505.000	PLN	15. Jun. 2024	(109.956)
Zahlt Festzinssatz 4,72 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14.251.000	PLN	15. Jun. 2024	68.382
Zahlt Festzinssatz 3,94 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.374.000	PLN	15. Jun. 2032	50.661
Zahlt Festzinssatz 3,93 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.384.000	PLN	15. Jun. 2032	21.080
Zahlt Festzinssatz 4,61 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	531.087.000	HUF	16. Jun. 2032	21.394
Erhält Festzinssatz 0,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.681.000	EUR	19. Jun. 2027	(39.866)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,87 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	21.527.000	PLN	15. Jun. 2024	88.710
Erhält Festzinssatz 8,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	58.807.000	MXN	12. Jun. 2024	(31.906)
Erhält Festzinssatz 8,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	83.584.000	MXN	12. Jun. 2024	(45.800)
Erhält Festzinssatz 1,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	1.780.000	SGD	15. Jun. 2024	(19.980)
Erhält Festzinssatz 2,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	3.263.669.000	KRW	15. Jun. 2027	(48.730)
Erhält Festzinssatz 1,55 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	2.462.000	SGD	15. Jun. 2024	(26.191)
Erhält Festzinssatz 1,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	2.358.000	SGD	15. Jun. 2024	(24.674)
Erhält Festzinssatz 2,30 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	1.551.031.000	KRW	15. Jun. 2024	(10.258)
Erhält Festzinssatz 1,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	3.002.000	SGD	15. Jun. 2024	(35.110)
Zahlt Festzinssatz 1,65 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.550.000	USD	4. Mrz. 2034	95.465
Erhält Festzinssatz 1,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	11.960.000	USD	4. Mrz. 2026	(204.673)
Zahlt Festzinssatz 1,66 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.860.000	USD	4. Mrz. 2034	104.679
Erhält Festzinssatz 1,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	13.395.000	USD	4. Mrz. 2026	(222.614)
Erhält Festzinssatz 1,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6.697.740	USD	4. Mrz. 2026	(110.839)
Zahlt Festzinssatz 1,66 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.428.070	USD	4. Mrz. 2034	51.325
Erhält Festzinssatz 1,52 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	15.787.200	USD	4. Mrz. 2026	(257.721)
Zahlt Festzinssatz 1,66 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3.365.000	USD	4. Mrz. 2034	120.792
Erhält Festzinssatz 1,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	2.120.000	SGD	15. Jun. 2024	(24.794)
Zahlt Festzinssatz 5,96 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	J.P. Morgan	171.845.000	INR	15. Jun. 2027	5.079
Erhält Festzinssatz 1,44 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4.100.000	USD	15. Jun. 2024	(56.212)
Zahlt Festzinssatz 1,77 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	1.026.000	SGD	21. Sep. 2027	25.790
Zahlt Festzinssatz 12,05 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	BNP Paribas	10.078.292	BRL	4. Jan. 2027	(82.391)
Erhält Festzinssatz 1,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	783.000	GBP	21. Sep. 2032	(656)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 2,00 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	21.386.000	USD	21. Sep. 2027	217.565
Erhält Festzinssatz 2,09 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	8.469.000	USD	21. Sep. 2024	(87.473)
Erhält Festzinssatz 2,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	7.708.000	USD	21. Sep. 2032	(92.678)
Zahlt Festzinssatz 12,11 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	5.229.167	BRL	4. Jan. 2027	(45.635)
Zahlt Festzinssatz 12,13 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Barclays Bank	6.884.873	BRL	4. Jan. 2027	(61.964)
Zahlt Festzinssatz 12,18 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Barclays Bank	5.292.575	BRL	4. Jan. 2027	(49.870)
Erhält Festzinssatz 2,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	5.655.000	USD	25. Mrz. 2029	6.025
Zahlt Festzinssatz 6,07 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Standard Chartered Bank	123.655.000	INR	15. Jun. 2027	(4.155)
Erhält Festzinssatz 5,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Standard Chartered Bank	282.150.000	INR	15. Jun. 2024	5.947
Erhält Festzinssatz 2,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.475.000	ILS	21. Sep. 2027	1.972
Zahlt Festzinssatz 5,32 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	82.345.000	CZK	21. Sep. 2024	(15.110)
Erhält Festzinssatz 11,17 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	7.981.391	BRL	4. Jan. 2027	(2.999)
Erhält Festzinssatz 11,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	33.515.799	BRL	2. Jan. 2024	(12.481)
Zahlt Festzinssatz 2,35 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	1.352.000	SGD	21. Sep. 2027	6.826
Erhält Festzinssatz 11,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Goldman Sachs	12.512.959	BRL	2. Jan. 2024	(7.101)
Erhält Festzinssatz 11,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Citi Bank	12.565.388	BRL	2. Jan. 2024	(6.914)
Zahlt Festzinssatz 5,68 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Standard Chartered Bank	525.077.000	INR	21. Sep. 2024	(19.551)
Erhält Festzinssatz 0,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.933.000	NZD	21. Dez. 2025	(180.599)
Erhält Festzinssatz 3,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.082.000	CLP	18. Mrz. 2031	(88)
Erhält Festzinssatz 3,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	6.005.000	CLP	18. Mrz. 2031	(510)
Zahlt Festzinssatz 1,33 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.082.000	NOK	21. Jun. 2026	50.001
Erhält Festzinssatz 4,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	1.066.645.000	CLP	16. Sep. 2031	(49.609)
Erhält Festzinssatz 4,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	749.149.000	CLP	16. Sep. 2031	(28.965)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 4,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	226.559.000	CLP	16. Sep. 2031	(8.679)
Erhält Festzinssatz 4,95 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	280.811.000	CLP	16. Sep. 2031	(8.522)
Erhält Festzinssatz 6,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	70.982.000	MXN	20. Dez. 2023	(95.314)
Erhält Festzinssatz 3,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.145.857.930	CLP	21. Dez. 2023	(43.331)
Erhält Festzinssatz 7,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	11.240.000	MXN	16. Mrz. 2041	(66.797)
Erhält Festzinssatz 1,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	1.304.000	CAD	20. Dez. 2026	(30.728)
Erhält Festzinssatz 0,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	38.172.000	SEK	20. Sep. 2026	(163.987)
Erhält Festzinssatz 1,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	2.986.000	ILS	16. Dez. 2031	(12.564)
Erhält Festzinssatz 0,42 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	BNP Paribas	8.454.000	ILS	21. Dez. 2023	(35.841)
Erhält Festzinssatz 0,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	6.752.000	ILS	21. Dez. 2023	(28.051)
Zahlt Festzinssatz 1,84 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	46.212.000	NOK	20. Dez. 2026	172.074
Zahlt Festzinssatz 2,18 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	51.095.000	CZK	20. Dez. 2026	105.011
Erhält Festzinssatz 0,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.654.000	EUR	16. Dez. 2031	(189.316)
Erhält Festzinssatz 1,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	824.829.000	KRW	20. Dez. 2026	(21.713)
Erhält Festzinssatz 6,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18.847.500	MXN	25. Jul. 2023	(29.263)
Erhält Festzinssatz 7,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	11.400.000	MXN	5. Jul. 2041	(63.128)
Erhält Festzinssatz 5,89 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	65.827.500	MXN	31. Jul. 2023	(107.866)
Erhält Festzinssatz 6,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	65.825.000	MXN	7. Aug. 2023	(104.572)
Zahlt Festzinssatz 2,34 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	239.000	NZD	16. Dez. 2031	6.823
Zahlt Festzinssatz 1,62 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	1.001.676.000	KRW	16. Dez. 2031	32.721
Zahlt Festzinssatz 1,72 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	1.206.425.000	KRW	16. Dez. 2031	35.439
Zahlt Festzinssatz -0,05 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	284.787.000	JPY	21. Mrz. 2027	12.830
Zahlt Festzinssatz 0,09 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	69.211.000	JPY	17. Mrz. 2032	7.426

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 5,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	172.315.000	ZAR	15. Mrz. 2024	(107.384)
Erhält Festzinssatz 1,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	5.309.000	CAD	15. Mrz. 2024	(78.455)
Erhält Festzinssatz 1,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	10.265.119.000	KRW	15. Dez. 2026	(372.843)
Zahlt Festzinssatz 2,42 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.457.000	NZD	16. Dez. 2031	38.548
Erhält Festzinssatz 2,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	7.051.000	CAD	17. Mrz. 2032	(67.562)
Erhält Festzinssatz 6,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	202.695.000	MXN	26. Sep. 2023	(308.964)
Zahlt Festzinssatz 6,68 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	17.035.000	MXN	24. Sep. 2024	36.182
Zahlt Festzinssatz 1,45 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	J.P. Morgan	3.144.000	ILS	20. Dez. 2026	17.924
Erhält Festzinssatz 6,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	104.115.000	MXN	20. Okt. 2023	(118.269)
Zahlt Festzinssatz 2,04 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	1.082.943.000	KRW	17. Mrz. 2032	19.752
Zahlt Festzinssatz 2,04 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.024.080.000	KRW	17. Mrz. 2032	18.506
Erhält Festzinssatz 2,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	HSBC	22.982.000	CNY	20. Mrz. 2027	13.459
Zahlt Festzinssatz 2,47 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	9.536.140	AUD	17. Mrz. 2032	274.735
Zahlt Festzinssatz 5,02 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.627.892.000	CLP	15. Mrz. 2024	40.489
Zahlt Festzinssatz 9,13 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20.689.000	ZAR	17. Mrz. 2032	8.461
Zahlt Festzinssatz 1,91 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	1.078.074.000	KRW	17. Mrz. 2032	24.153
Zahlt Festzinssatz 3,23 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	11.477.000	PLN	15. Mrz. 2024	61.084
Zahlt Festzinssatz 3,29 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	18.218.000	PLN	15. Mrz. 2024	94.410
Erhält Festzinssatz 3,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.158.000	NZD	15. Mrz. 2024	(31.936)
Zahlt Festzinssatz 9,14 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	9.904.000	ZAR	17. Mrz. 2032	3.855
Erhält Festzinssatz 0,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	J.P. Morgan	6.272.000	ILS	15. Mrz. 2024	(24.445)
Zahlt Festzinssatz 9,22 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13.120.000	ZAR	17. Mrz. 2032	2.805
Zahlt Festzinssatz 9,07 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13.121.000	ZAR	17. Mrz. 2032	6.686

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 0,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	J.P. Morgan	17.370.000	ILS	15. Mrz. 2024	(64.914)
Zahlt Festzinssatz 9,32 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	23.177.000	ZAR	17. Mrz. 2032	568
Zahlt Festzinssatz 2,02 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	2.220.281.000	KRW	17. Mrz. 2032	42.181
Zahlt Festzinssatz 4,54 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.849.984.000	HUF	15. Mrz. 2024	215.069
Zahlt Festzinssatz 4,35 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.018.668.000	HUF	15. Mrz. 2024	82.131
Zahlt Festzinssatz 4,48 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.471.536.000	HUF	15. Mrz. 2024	113.384
Erhält Festzinssatz 1,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	7.160.000	ILS	17. Mrz. 2032	(50.646)
Zahlt Festzinssatz 1,73 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	J.P. Morgan	2.432.000	SGD	17. Mrz. 2032	57.371
Zahlt Festzinssatz 5,08 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3.656.777.000	CLP	15. Jun. 2024	151.150
Zahlt Festzinssatz 5,07 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.567.190.000	CLP	15. Jun. 2024	64.997
Zahlt Festzinssatz 5,09 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.817.932.000	CLP	15. Jun. 2027	286.654
Zahlt Festzinssatz 5,10 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.377.950.000	CLP	15. Jun. 2027	140.074
Zahlt Festzinssatz 5,07 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.075.247.000	CLP	15. Jun. 2027	65.041
Zahlt Festzinssatz 4,66 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.253.493.000	HUF	15. Jun. 2024	183.135
Zahlt Festzinssatz 4,79 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.611.885.000	HUF	15. Jun. 2023	126.681
Zahlt Festzinssatz 4,56 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.677.676.000	HUF	15. Jun. 2023	142.340
Zahlt Festzinssatz 0,53 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	J.P. Morgan	23.116.000	ILS	15. Jun. 2024	154.045
Erhält Festzinssatz 3,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Citi Bank	7.487.000	MYR	15. Jun. 2027	(33.912)
Zahlt Festzinssatz 2,99 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	91.130.000	CZK	15. Jun. 2027	257.024
Zahlt Festzinssatz 1,96 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	4.238.234.000	KRW	21. Jun. 2024	35.002
Zahlt Festzinssatz 7,31 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27.144.000	MXN	9. Jun. 2027	58.716
Erhält Festzinssatz 7,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	24.062.000	MXN	19. Jun. 2024	(13.941)
Zahlt Festzinssatz 1,59 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	92.398.000	NOK	15. Jun. 2024	128.477

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 1,85 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	1.205.508.000	KRW	16. Jun. 2032	29.315
Erhält Festzinssatz 2,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	13.300.000	NZD	15. Jun. 2027	(332.786)
Zahlt Festzinssatz 2,64 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4.199.000	NZD	15. Jun. 2032	193.579
Erhält Festzinssatz 0,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	53.737.611	SEK	15. Jun. 2027	(209.575)
Zahlt Festzinssatz 1,03 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	65.541.000	SEK	16. Jun. 2032	135.616
Erhält Festzinssatz 7,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	41.968.000	ZAR	15. Jun. 2032	(49.025)
Erhält Festzinssatz 5,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	45.759.000	ZAR	15. Jun. 2024	(21.739)
Zahlt Festzinssatz 3,09 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.728.000	PLN	15. Jun. 2032	52.934
Erhält Festzinssatz 1,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	13.183.000	AUD	15. Jun. 2024	(184.778)
Erhält Festzinssatz 1,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	29.650.000	AUD	15. Jun. 2027	(1.129.085)
Erhält Festzinssatz 5,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	550.861.000	CLP	16. Jun. 2032	(1.806)
Erhält Festzinssatz 2,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10.943.000	CZK	15. Jun. 2032	(47.784)
Erhält Festzinssatz 5,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	550.866.000	CLP	17. Mrz. 2032	(1.741)
Erhält Festzinssatz 7,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	139.500.000	MXN	2. Jan. 2024	(132.171)
Zahlt Festzinssatz 7,06 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.297.448.000	COP	15. Jun. 2027	14.317
Zahlt Festzinssatz 9,27 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13.827.000	ZAR	17. Jun. 2032	3.030
Zahlt Festzinssatz 9,33 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	21.123.000	ZAR	17. Jun. 2032	2.367
Zahlt Festzinssatz 4,08 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.976.000	PLN	15. Jun. 2032	36.902
Zahlt Festzinssatz 3,99 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.463.000	PLN	15. Jun. 2032	62.738
Zahlt Festzinssatz 4,00 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.319.000	PLN	15. Jun. 2032	46.045
Zahlt Festzinssatz 2,89 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.130.000	NZD	15. Jun. 2032	36.075
Zahlt Festzinssatz 2,88 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	907.000	NZD	15. Jun. 2032	29.222
Erhält Festzinssatz 2,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.170.000	NZD	15. Jun. 2027	(46.673)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 2,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.722.000	NZD	15. Jun. 2027	(37.610)
Zahlt Festzinssatz 2,94 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	455.000	NZD	15. Jun. 2032	13.055
Erhält Festzinssatz 2,85 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	865.000	NZD	15. Jun. 2027	(17.385)
Erhält Festzinssatz 2,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.735.000	NZD	15. Jun. 2027	(35.145)
Zahlt Festzinssatz 2,94 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	920.000	NZD	15. Jun. 2032	26.667
Zahlt Festzinssatz 1,39 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	6.310.000	ILS	19. Jun. 2027	40.028
Zahlt Festzinssatz 1,36 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	13.095.000	ILS	19. Jun. 2027	86.640
Erhält Festzinssatz 8,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	59.106.000	ZAR	15. Jun. 2032	(22.609)
Erhält Festzinssatz 7,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	62.694.000	MXN	2. Jun. 2032	(92.143)
Erhält Festzinssatz 4,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	16.257.000	PLN	15. Jun. 2032	(264.507)
Erhält Festzinssatz 4,62 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	285.885.000	HUF	15. Jun. 2032	(74.155)
Erhält Festzinssatz 2,89 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	32.702.000	CZK	16. Jun. 2032	(24.156)
Zahlt Festzinssatz 7,62 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	28.731.000	MXN	9. Jun. 2027	43.224
Zahlt Festzinssatz 9,17 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	26.487.000	ZAR	17. Jun. 2032	11.015
Zahlt Festzinssatz 9,29 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13.245.000	ZAR	17. Jun. 2032	2.570
Zahlt Festzinssatz 9,17 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	8.423.000	ZAR	17. Jun. 2032	3.584
Zahlt Festzinssatz 9,21 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	28.356.000	ZAR	17. Jun. 2032	9.495
Erhält Festzinssatz 7,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	39.394.000	ZAR	15. Jun. 2027	(12.549)
Erhält Festzinssatz 7,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	121.623.000	MXN	14. Jun. 2023	(64.488)
Erhält Festzinssatz 7,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	71.565.000	MXN	12. Jun. 2024	(70.056)
Erhält Festzinssatz 6,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	68.424.000	ZAR	15. Jun. 2024	(14.463)
Zahlt Festzinssatz 7,60 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	57.260.000	MXN	12. Jan. 2032	114.224
Zahlt Festzinssatz 7,61 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	38.150.000	MXN	12. Jan. 2032	74.438

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 2,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	1.126.449.000	KRW	15. Jun. 2032	(34.208)
Zahlt Festzinssatz 7,51 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	38.315.000	MXN	15. Jan. 2032	87.796
Zahlt Festzinssatz 3,93 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.862.000	PLN	15. Jun. 2032	73.809
Erhält Festzinssatz 7,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	155.957.500	MXN	1. Feb. 2024	(147.555)
Erhält Festzinssatz 7,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	155.957.500	MXN	26. Jan. 2024	(136.085)
Zahlt Festzinssatz 7,11 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	89.080.000	MXN	2. Feb. 2023	34.960
Zahlt Festzinssatz 7,14 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	89.080.000	MXN	27. Jan. 2023	30.872
Zahlt Festzinssatz 7,49 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	53.407.500	MXN	30. Jan. 2025	71.036
Zahlt Festzinssatz 7,53 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	53.407.500	MXN	24. Jan. 2025	66.997
Zahlt Festzinssatz 4,75 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.143.000	PLN	15. Jun. 2024	24.004
Zahlt Festzinssatz 4,28 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	28.786.000	PLN	21. Jun. 2024	70.788
Zahlt Festzinssatz 7,60 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	37.485.000	MXN	21. Jan. 2032	74.656
Erhält Festzinssatz 1,29 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Bank of America	855.000	ILS	15. Jun. 2027	(7.896)
Erhält Festzinssatz 1,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	1.710.000	ILS	15. Jun. 2027	(15.995)
Zahlt Festzinssatz 7,47 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	23.735.000	MXN	9. Jun. 2027	43.358
Zahlt Festzinssatz 7,46 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	23.775.000	MXN	9. Jun. 2027	43.771
Erhält Festzinssatz 3,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	28.555.000	CZK	16. Jun. 2032	(13.703)
Zahlt Festzinssatz 2,96 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	943.000	NZD	16. Jun. 2032	10.340
Zahlt Festzinssatz 5,72 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.482.275.000	CLP	15. Jun. 2027	64.487
Erhält Festzinssatz 6,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.871.940.000	CLP	15. Jun. 2024	(53.347)
Erhält Festzinssatz 5,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	698.445.000	CLP	15. Jun. 2032	(14.514)
Zahlt Festzinssatz 7,46 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.101.745.000	COP	15. Jun. 2032	19.424
Zahlt Festzinssatz 7,47 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	4.111.715.000	COP	15. Jun. 2032	25.004

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 7,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	5.268.395.000	COP	15. Jun. 2027	(34.935)
Erhält Festzinssatz 7,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6.983.685.000	COP	15. Jun. 2027	(48.185)
Erhält Festzinssatz 6,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.901.265.000	CLP	15. Jun. 2024	(1.230)
Zahlt Festzinssatz 6,02 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.508.630.000	CLP	15. Jun. 2027	24.373
Erhält Festzinssatz 5,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	708.760.000	CLP	15. Jun. 2032	(2.806)
Zahlt Festzinssatz 7,88 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.438.923.000	COP	15. Jun. 2027	7.550
Erhält Festzinssatz 2,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2.497.857.000	KRW	15. Jun. 2027	(28.158)
Zahlt Festzinssatz 7,54 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	146.840.000	MXN	15. Feb. 2023	34.896
Zahlt Festzinssatz 7,38 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	146.835.000	MXN	10. Feb. 2023	43.232
Erhält Festzinssatz 7,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	146.302.500	MXN	14. Feb. 2024	(78.037)
Erhält Festzinssatz 7,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	146.302.500	MXN	9. Feb. 2024	(102.774)
Zahlt Festzinssatz 7,91 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	49.910.000	MXN	12. Feb. 2025	39.333
Zahlt Festzinssatz 7,71 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	49.915.000	MXN	7. Feb. 2025	52.266
Zahlt Festzinssatz 3,60 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	4.697.000	MYR	19. Jun. 2027	6.326
Erhält Festzinssatz 1,58 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	J.P. Morgan	3.220.000	SGD	15. Jun. 2024	(32.668)
Zahlt Festzinssatz 8,01 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.263.049.000	COP	15. Jun. 2027	1.881
Zahlt Festzinssatz 7,98 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.130.936.000	COP	15. Jun. 2027	1.268
Zahlt Festzinssatz 8,01 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.452.155.000	COP	15. Jun. 2027	1.933
Erhält Festzinssatz 2,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	8.235.000	NZD	16. Mrz. 2032	(186.851)
Zahlt Festzinssatz 9,01 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	26.411.000	ZAR	16. Jun. 2032	19.386
Zahlt Festzinssatz 2,37 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	1.795.506.000	KRW	16. Jun. 2032	12.386
Zahlt Festzinssatz 9,05 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16.655.000	ZAR	17. Jun. 2032	10.942
Zahlt Festzinssatz 4,32 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	359.780.000	HUF	16. Jun. 2032	24.735

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,34 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	240.158.000	HUF	16. Jun. 2032	16.039
Erhält Festzinssatz 1,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	3.943.000	ILS	15. Jun. 2027	(29.215)
Erhält Festzinssatz 7,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	33.405.000	MXN	12. Feb. 2027	(43.899)
Erhält Festzinssatz 7,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	11.743.780.000	CLP	15. Jun. 2024	175.390
Zahlt Festzinssatz 6,19 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	8.709.595.000	CLP	15. Jun. 2027	6.597
Erhält Festzinssatz 5,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.887.420.000	CLP	15. Jun. 2032	(47.185)
Erhält Festzinssatz 8,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	29.056.480.000	COP	15. Jun. 2027	69.468
Zahlt Festzinssatz 8,30 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	16.316.710.000	COP	15. Jun. 2032	(145.968)
Zahlt Festzinssatz 0,47 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.575.000	EUR	15. Jun. 2027	79.635
Zahlt Festzinssatz 3,87 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	17.655.000	PLN	15. Jun. 2032	285.902
Zahlt Festzinssatz 6,08 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	271.120.000	ZAR	15. Jun. 2023	(62.252)
Zahlt Festzinssatz 6,02 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	90.375.000	ZAR	15. Jun. 2023	(17.068)
Erhält Festzinssatz 6,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	204.535.000	ZAR	15. Jun. 2024	62.175
Erhält Festzinssatz 6,61 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	282.450.000	ZAR	15. Jun. 2024	105.107
Zahlt Festzinssatz 6,86 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32.220.000	ZAR	15. Jun. 2025	(12.867)
Zahlt Festzinssatz 6,89 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	96.670.000	ZAR	15. Jun. 2025	(44.820)
Zahlt Festzinssatz 7,06 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	263.070.000	ZAR	15. Jun. 2027	73.263
Erhält Festzinssatz 8,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	11.300.000	ZAR	15. Jun. 2032	(2.127)
Erhält Festzinssatz 9,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	30.015.000	ZAR	17. Jun. 2032	5.755
Zahlt Festzinssatz 3,61 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7.868.000	PLN	16. Jun. 2032	42.248
Erhält Festzinssatz 8,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	45.252.000	MXN	12. Jun. 2024	(26.183)
Erhält Festzinssatz 1,43 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	4.037.000	ILS	15. Jun. 2027	(28.893)
Erhält Festzinssatz 0,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.155.000	EUR	15. Sep. 2031	(147.526)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 6,08 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.536.435.000	CLP	15. Jun. 2027	17.204
Erhält Festzinssatz 7,17 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.929.460.000	CLP	15. Jun. 2024	21.595
Erhält Festzinssatz 5,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	711.890.000	CLP	15. Jun. 2032	(19.118)
Erhält Festzinssatz 9,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	43.586.000	ZAR	17. Jun. 2032	622
Erhält Festzinssatz 9,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32.106.000	ZAR	17. Jun. 2032	737
Zahlt Festzinssatz 3,33 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	3.381.600	NZD	19. Jun. 2027	8.426
Zahlt Festzinssatz 3,27 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.965.000	NZD	19. Jun. 2027	6.975
Erhält Festzinssatz 9,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	39.060.000	ZAR	17. Jun. 2032	(874)
Zahlt Festzinssatz 3,98 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.915.000	PLN	15. Jun. 2027	58.719
Zahlt Festzinssatz 2,32 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	2.995.367.000	KRW	16. Jun. 2032	25.981
Zahlt Festzinssatz 6,23 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	202.346.000	HUF	15. Jun. 2027	4.017
Zahlt Festzinssatz 5,55 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	566.546.000	HUF	15. Jun. 2027	58.801
Zahlt Festzinssatz 5,60 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	540.752.000	HUF	15. Jun. 2027	53.098
Zahlt Festzinssatz 6,26 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	356.669.000	HUF	15. Jun. 2027	5.750
Zahlt Festzinssatz 6,52 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	468.834.000	HUF	15. Jun. 2024	21.418
Zahlt Festzinssatz 6,86 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	632.452.000	HUF	15. Jun. 2024	17.283
Zahlt Festzinssatz 4,86 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	36.271.000	PLN	15. Jun. 2024	151.846
Zahlt Festzinssatz 3,60 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	18.462.000	PLN	16. Jun. 2032	100.425
Erhält Festzinssatz 3,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	7.447.000	MYR	15. Jun. 2027	(25.151)
Erhält Festzinssatz 3,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	7.447.000	MYR	15. Jun. 2027	(25.564)
Zahlt Festzinssatz 2,74 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	16.790.000	MYR	15. Jun. 2024	15.033
Zahlt Festzinssatz 2,76 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	16.790.000	MYR	15. Jun. 2024	14.175
Zahlt Festzinssatz 4,44 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	23.171.000	PLN	15. Jun. 2027	168.148

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,16 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.348.000	PLN	18. Sep. 2027	30.810
Zahlt Festzinssatz 4,45 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.244.000	PLN	21. Sep. 2032	48.507
Zahlt Festzinssatz 6,40 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	102.048.000	ZAR	21. Sep. 2023	(11.962)
Zahlt Festzinssatz 6,94 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.721.319.000	HUF	21. Sep. 2024	32.532
Zahlt Festzinssatz 5,94 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	488.382.000	HUF	21. Sep. 2027	21.249
Zahlt Festzinssatz 5,94 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	841.830.000	HUF	21. Sep. 2027	36.628
Erhält Festzinssatz 5,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	276.741.000	HUF	21. Sep. 2032	(11.373)
Zahlt Festzinssatz 3,87 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	48.673.000	CZK	21. Sep. 2027	38.836
Zahlt Festzinssatz 1,52 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	8.261.000	ILS	21. Sep. 2024	14.462
Erhält Festzinssatz 1,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.868.000	ILS	21. Sep. 2027	(7.239)
Erhält Festzinssatz 2,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	9.385.000	ILS	15. Sep. 2032	(18.156)
Erhält Festzinssatz 8,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	86.334.000	MXN	18. Sep. 2024	(13.904)
Zahlt Festzinssatz 8,41 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	67.365.000	MXN	15. Sep. 2027	(3.601)
Zahlt Festzinssatz 8,37 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	70.070.000	MXN	8. Sep. 2032	(32.079)
Erhält Festzinssatz 3,29 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	HSBC	7.857.000	MYR	21. Sep. 2027	(22.086)
Zahlt Festzinssatz 8,31 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	43.190.000	MXN	25. Feb. 2032	(21.774)
Erhält Festzinssatz 8,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	169.680.000	MXN	6. Mrz. 2024	(28.232)
Erhält Festzinssatz 1,61 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	4.505.000	ILS	15. Jun. 2027	(20.205)
Zahlt Festzinssatz 2,36 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	HSBC	1.208.340.000	KRW	15. Sep. 2032	8.663
Erhält Festzinssatz 2,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	3.216.761.000	KRW	21. Sep. 2032	(69.680)
Zahlt Festzinssatz 4,86 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	25.514.000	PLN	15. Jun. 2027	75.895
Zahlt Festzinssatz 6,08 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	314.286.000	HUF	15. Jun. 2027	11.906
Zahlt Festzinssatz 7,32 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	771.731.000	HUF	15. Jun. 2024	2.132
Zahlt Festzinssatz 8,02 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	9.880.398.000	CLP	21. Sep. 2023	(32.642)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 7,13 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	14.296.843.000	CLP	21. Sep. 2024	(193.465)
Zahlt Festzinssatz 7,05 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	6.423.219.000	CLP	21. Sep. 2024	(75.166)
Zahlt Festzinssatz 6,02 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3.214.390.000	CLP	21. Sep. 2027	6.897
Erhält Festzinssatz 5,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.206.227.000	CLP	15. Sep. 2032	(18.238)
Erhält Festzinssatz 2,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	13.097.000	AUD	21. Sep. 2024	(103.401)
Erhält Festzinssatz 2,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.193.000	AUD	18. Sep. 2027	(19.475)
Erhält Festzinssatz 2,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	2.936.000	AUD	21. Sep. 2032	(9.596)
Erhält Festzinssatz 3,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.231.000	NZD	21. Sep. 2024	(4.196)
Erhält Festzinssatz 2,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	81.017.000	NOK	21. Sep. 2027	(150.392)
Zahlt Festzinssatz 1,63 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	5.415.000	SEK	21. Sep. 2032	18.048
Erhält Festzinssatz 5,95 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	25.300.000	PLN	15. Jun. 2024	15.184
Erhält Festzinssatz 2,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	8.576.000	CAD	21. Sep. 2032	(246.401)
Zahlt Festzinssatz 2,41 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	2.492.258.000	KRW	16. Jun. 2032	14.061
Erhält Festzinssatz 2,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Standard Chartered Bank	39.052.000	CNY	15. Jun. 2024	(10.920)
Erhält Festzinssatz 8,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	169.020.000	MXN	12. Mrz. 2024	15.399
Zahlt Festzinssatz 8,16 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	168.825.000	MXN	14. Mrz. 2023	1.935
Zahlt Festzinssatz 8,65 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	57.910.000	MXN	11. Mrz. 2025	(10.980)
Zahlt Festzinssatz 5,95 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10.469.000	PLN	15. Jun. 2024	(6.169)
Erhält Festzinssatz 9,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20.453.000	ZAR	16. Jun. 2032	12.314
Zahlt Festzinssatz 8,64 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	31.826.000	MXN	9. Jun. 2027	(18.353)
Zahlt Festzinssatz 8,65 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	42.437.500	MXN	9. Jun. 2027	(25.470)
Zahlt Festzinssatz 8,64 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	47.744.000	MXN	9. Jun. 2027	(27.747)
Erhält Festzinssatz 1,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.843.000	EUR	21. Sep. 2032	(25.680)
Erhält Festzinssatz 8,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	38.215.000	MXN	10. Mrz. 2027	15.423

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 5,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	16.980.000	PLN	15. Jun. 2024	4.067
Zahlt Festzinssatz 5,30 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	45.579.000	PLN	21. Jun. 2024	13.541
Zahlt Festzinssatz 4,55 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.419.000	PLN	15. Jun. 2032	24.029
Zahlt Festzinssatz 4,95 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.815.000	PLN	15. Jun. 2027	17.908
Erhält Festzinssatz 5,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	25.390.000	PLN	15. Jun. 2024	(3.075)
Erhält Festzinssatz 6,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	171.523.000	HUF	15. Jun. 2032	14.095
Erhält Festzinssatz 5,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	310.301.000	HUF	15. Jun. 2032	(4.882)
Erhält Festzinssatz 5,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	633.159.000	HUF	15. Jun. 2032	(1.508)
Erhält Festzinssatz 5,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	322.184.000	HUF	15. Jun. 2032	(9.370)
Zahlt Festzinssatz 6,81 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	309.959.000	HUF	15. Jun. 2027	(16.394)
Zahlt Festzinssatz 6,13 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	560.714.000	HUF	15. Jun. 2027	17.756
Zahlt Festzinssatz 6,29 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.116.496.000	HUF	15. Jun. 2027	13.142
Zahlt Festzinssatz 6,20 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	547.552.000	HUF	15. Jun. 2027	12.573
Zahlt Festzinssatz 6,81 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	229.696.000	HUF	15. Jun. 2027	(12.220)
Erhält Festzinssatz 6,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	132.175.000	HUF	15. Jun. 2032	10.788
Zahlt Festzinssatz 7,38 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.167.514.000	HUF	15. Jun. 2024	(557)
Zahlt Festzinssatz 7,55 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	838.053.000	HUF	15. Jun. 2024	(8.317)
Erhält Festzinssatz 1,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	93.249.500	SEK	15. Jun. 2027	(32.411)
Zahlt Festzinssatz 3,37 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.945.000	NZD	15. Jun. 2027	7.044
Erhält Festzinssatz 3,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	664.000	NZD	15. Jun. 2032	2.042
Erhält Festzinssatz 3,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.050.000	NZD	15. Jun. 2032	(2.047)
Erhält Festzinssatz 3,43 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.050.000	NZD	15. Jun. 2032	(72)
Zahlt Festzinssatz 2,45 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	HSBC	3.465.982.000	KRW	16. Jun. 2032	14.156
Erhält Festzinssatz 4,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	124.740.000	CZK	15. Jun. 2024	(42.938)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 3,43 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.050.000	NZD	15. Jun. 2032	(72)
Zahlt Festzinssatz 3,40 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.945.000	NZD	15. Jun. 2027	4.887
Zahlt Festzinssatz 8,48 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	13.023.000	MXN	9. Jun. 2027	(3.193)
Zahlt Festzinssatz 8,86 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.135.752.000	COP	15. Jun. 2027	(17.722)
Zahlt Festzinssatz 8,52 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.572.165.000	COP	15. Jun. 2027	(11.868)
Zahlt Festzinssatz 8,73 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.572.136.000	COP	15. Jun. 2027	(17.863)
Zahlt Festzinssatz 8,10 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.118.559.000	COP	15. Jun. 2032	(5.916)
Zahlt Festzinssatz 7,88 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.247.566.000	COP	15. Jun. 2032	(3.016)
Zahlt Festzinssatz 8,91 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.293.830.000	COP	15. Jun. 2027	(11.431)
Zahlt Festzinssatz 8,67 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	37.146.000	MXN	9. Jun. 2027	(23.739)
Zahlt Festzinssatz 8,48 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	31.767.000	MXN	9. Jun. 2027	(7.586)
Zahlt Festzinssatz 8,47 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	25.458.000	MXN	9. Jun. 2027	(5.975)
Zahlt Festzinssatz 8,68 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	26.587.000	MXN	9. Jun. 2027	(17.481)
Zahlt Festzinssatz 8,65 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	24.763.000	MXN	9. Jun. 2027	(14.802)
Zahlt Festzinssatz 3,40 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.945.000	NZD	15. Jun. 2027	4.887
Zahlt Festzinssatz 3,54 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	3.890.000	NZD	15. Jun. 2027	(7.482)
Erhält Festzinssatz 3,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.100.000	NZD	15. Jun. 2032	11.951
Zahlt Festzinssatz 3,50 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.945.000	NZD	15. Jun. 2027	(1.214)
Zahlt Festzinssatz 6,67 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	879.485.000	CLP	15. Jun. 2027	(21.844)
Zahlt Festzinssatz 6,68 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.785.615.000	CLP	15. Jun. 2027	(45.016)
Erhält Festzinssatz 8,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.009.285.000	CLP	15. Jun. 2024	26.934
Erhält Festzinssatz 8,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.049.160.000	CLP	15. Jun. 2024	54.685
Erhält Festzinssatz 6,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	246.800.000	CLP	15. Jun. 2032	4.097
Erhält Festzinssatz 6,18 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	501.080.000	CLP	15. Jun. 2032	9.488

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 5,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	83.945.000	CZK	15. Jun. 2024	(17.577)
Erhält Festzinssatz 3,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.095.000	NZD	15. Jun. 2032	10.630
Zahlt Festzinssatz 3,50 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.945.000	NZD	15. Jun. 2027	(1.214)
Zahlt Festzinssatz 8,33 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	45.957.000	MXN	9. Jun. 2032	(21.500)
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	18.257.000	MXN	9. Jun. 2032	(8.193)
Zahlt Festzinssatz 8,33 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	27.621.000	MXN	9. Jun. 2032	(13.001)
Erhält Festzinssatz 3,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.050.000	NZD	15. Jun. 2032	4.062
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	27.469.000	MXN	9. Jun. 2032	(12.472)
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	18.353.000	MXN	9. Jun. 2032	(8.283)
Zahlt Festzinssatz 8,28 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	27.374.000	MXN	9. Jun. 2032	(11.000)
Zahlt Festzinssatz 8,23 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	36.569.000	MXN	9. Jun. 2032	(12.014)
Zahlt Festzinssatz 8,29 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	27.417.000	MXN	9. Jun. 2032	(11.115)
Erhält Festzinssatz 3,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.050.000	NZD	15. Jun. 2032	4.062
Zahlt Festzinssatz 3,50 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.945.000	NZD	15. Jun. 2027	(1.214)
Erhält Festzinssatz 3,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.050.000	NZD	15. Jun. 2032	4.062
Zahlt Festzinssatz 3,48 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.229.040	NZD	15. Jun. 2027	(27)
Zahlt Festzinssatz 8,28 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	18.270.000	MXN	9. Jun. 2032	(7.347)
Zahlt Festzinssatz 8,28 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	27.475.000	MXN	9. Jun. 2032	(10.745)
Zahlt Festzinssatz 8,25 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	18.286.000	MXN	9. Jun. 2032	(6.495)
Zahlt Festzinssatz 8,20 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	18.286.000	MXN	9. Jun. 2032	(5.100)
Erhält Festzinssatz 5,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	128.370.000	CZK	15. Jun. 2024	34.938
Zahlt Festzinssatz 4,79 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	87.245.000	CZK	15. Jun. 2027	(75.328)
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	19.666.000	MXN	8. Sep. 2032	(8.107)
Zahlt Festzinssatz 8,32 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIEE 28 Days	Morgan Stanley	19.708.000	MXN	8. Sep. 2032	(8.124)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 8,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29.921.000	MXN	8. Sep. 2032	(17.693)
Zahlt Festzinssatz 8,47 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29.778.000	MXN	8. Sep. 2032	(18.575)
Zahlt Festzinssatz 2,64 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	1.473.832.000	KRW	15. Sep. 2032	(3.168)
Zahlt Festzinssatz 2,59 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	1.018.279.000	KRW	17. Sep. 2032	(409)
Zahlt Festzinssatz 5,23 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	20.500.000	PLN	15. Jun. 2027	(16.876)
				USD	(1.127.176)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

Zum 31. März 2022 gestaltete sich die Exponierung bei in Bezug auf Derivatkontrakte zu erhaltenden Sicherheiten je Kontrahent folgendermaßen:

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA BlueTrend				
	Credit Suisse	Barmittel	EUR	12
	Credit Suisse	Barmittel	HKD	69
	Credit Suisse	Barmittel	USD	3.828.837
	HSBC	Barmittel	USD	1.910.000
	J.P. Morgan	Barmittel	CAD	671.438
	J.P. Morgan	Barmittel	CHF	673.969
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	482.878
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	43.179.992
	J.P. Morgan	Barmittel	MXN	9.860.412
	J.P. Morgan	Barmittel	SEK	12.610.826
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	11.530.620
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	140.137
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	310.353
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	17.317.510
			USD	21.852.228
Schroder GAIA Egerton Equity				
	HSBC	Barmittel	EUR	8.439.640
	Merrill Lynch	Barmittel	CAD	4
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	3
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	10.518.998
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	7
			EUR	18.958.648
Schroder GAIA Helix				
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	2.013.825
	Goldman Sachs	Barmittel	GBP	3.407.815
	Goldman Sachs	Barmittel	HKD	967.140
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	7.020.452
	J.P. Morgan	Barmittel	CAD	12.641
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	5.506.479
	J.P. Morgan	Barmittel	GBP	355
	J.P. Morgan	Barmittel	HKD	2.572.469

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA Helix (Forts.)	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	20.827.573
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	19.263.565
			USD	39.713.556
Schroder GAIA Sirios US Equity	Bank of America	Barmittel	USD	1.630.000
			USD	1.630.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	Barmittel	EUR	1.614.943
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	151.513
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	26.752.141
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	117.779.007
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	35.478.094
	Societe Generale	Barmittel	AUD	10.178.420
	Societe Generale	Barmittel	CAD	124.326
	Societe Generale	Barmittel	GBP	8.876.024
	Societe Generale	Barmittel	SEK	12.519.939
	Societe Generale	Barmittel	SGD	344.364
	Societe Generale	Barmittel	USD	1.950.125
	Societe Generale	Barmittel	ZAR	284.815
			USD	90.879.049
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	HSBC	Barmittel	GBP	60.000
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	342.131
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	10
			GBP	402.139
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Barclays Bank	Barmittel	USD	460.000
	BNP Paribas	Barmittel	USD	720.000
	Deutsche Bank	Barmittel	USD	40.000
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	30.000
	HSBC	Barmittel	USD	1.830.000
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	1.500.000
	Merrill Lynch	Barmittel	USD	160.000
	Morgan Stanley	Barmittel	CZK	3.700
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	1.194.591
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	269.164
	Morgan Stanley	Barmittel	HUF	386.146
	Morgan Stanley	Barmittel	NOK	316
	Morgan Stanley	Barmittel	PLN	4.743
	Morgan Stanley	Barmittel	SEK	14
	Morgan Stanley	Barmittel	THB	95.588
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	790.000
	Morgan Stanley	Barmittel	ZAR	1.075
	Standard Chartered Bank	Barmittel	USD	230.000
	UBS	Barmittel	USD	280.000
			USD	7.720.549

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Ausweis von Transaktionskosten

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

Die Transaktionskosten für den Berichtszeitraum fielen wie folgt aus:

Teilfonds	Währung	Provisionen
Schroder GAIA BlueTrend	USD	32.447
Schroder GAIA Cat Bond	USD	20.910
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	303.114
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	196.238
Schroder GAIA Helix	USD	970.085
Schroder GAIA Oaktree Credit	USD	-
Schroder GAIA Sirius US Equity	USD	371.583
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	139.920
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	GBP	25.767
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	553.239

Dividenden

Während des Berichtszeitraums haben die folgenden Teilfonds Dividendenausschüttungen vorgenommen:

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
8. Okt. 2021	15. Okt. 2021	22. Okt. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	134,81	USD	0,834065
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	529,76	SGD	1,110581
12. Nov. 2021	19. Nov. 2021	26. Nov. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	585,44	USD	3,622100
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.304,03	SGD	4,830049
10. Dez. 2021	17. Dez. 2021	27. Dez. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	484,26	USD	2,996102
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.906,62	SGD	3,996693
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	191.961,17	USD	9,970574
14. Jan. 2022	21. Jan. 2022	28. Jan. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	616,43	USD	3,813834
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.406,79	SGD	5,044839
11. Feb. 2022	18. Feb. 2022	25. Feb. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	474,09	USD	2,933181
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.000,14	SGD	3,915513
11. Mrz. 2022	18. Mrz. 2022	25. Mrz. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	503,52	USD	3,115263
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.070,03	SGD	4,188658
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	259.273,09	USD	13,155949

Wechselkurs

Der folgende Wechselkurs wurde für die Berechnung des im Abschluss zum 31. März 2022 in EUR ausgewiesenen Gesamtbetrags verwendet:

1 Euro = 1,10625 US-Dollar

1 Euro = 0,84212 Pfund Sterling

Wesentliche Ereignisse während des Berichtszeitraums

Die Verwahr- und Verwaltungsstelle der Gesellschaft, Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. („BBH“), hat mit der State Street Corporation („State Street“) eine Vereinbarung getroffen, nach der State Street das Investor-Services-Geschäft von BBH übernehmen wird, das die Bereiche Verwahrung, Fondsbuchhaltung und -verwaltung, Transferstelle, Verwahrstelle, Devisen, Treuhänder und Wertpapierleihe umfasst. Der Abschluss der Transaktion unterliegt den üblichen Abschlussbedingungen und behördlichen Genehmigungen.

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Ukraine/Russland-Sanktionen

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

Der folgende Teilfonds ist in russischen und ukrainischen Wertpapieren engagiert:

Schroder GAIA Helix

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Am 11. Mai 2022 wurden die folgenden Anteilsklassen des Schroder GAIA Oaktree Credit aufgelegt:

Klasse A2 Aussch., Klasse A2 Aussch. (in CHF abgesichert), Klasse A2 Aussch. (in GBP abgesichert), Klasse C Aussch., Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert), Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert), Klasse E Aussch., Klasse E Aussch. (in CHF abgesichert) und Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert).

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2022 (Forts.)

Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse (Forts.)

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Sirios US Equity		
Klasse A Thes.	630.316	0,58 %
Klasse A Thes. In CHF abgesichert	1.630	0,15 %
Klasse A Thes. In EUR abgesichert	56.721	0,25 %
Klasse C Thes.	570.153	0,60 %
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	14.082	0,54 %
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	313.303	0,58 %
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	72.414	0,63 %
Klasse C Aussch. In GBP abgesichert	3.434	0,67 %
Klasse E Thes.	412	0,41 %
Klasse E Thes. In EUR abgesichert	11.201	0,29 %
Klasse I Thes.	Entfällt#	Entfällt#
Klasse X Thes.	11	0,67 %
Klasse X Thes. In EUR abgesichert	22.189	0,96 %

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

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 I Thes.	Entfällt#	Entfällt#
Klasse K Thes.	0	0,00 %
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00 %
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %

Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund

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 USD abgesichert	0	0,00 %
Klasse I Thes.	Entfällt#	Entfällt#
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00 %
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	0	0,00 %
Klasse R Thes.	0	0,00 %
Klasse R Thes. In EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse R Thes. In USD abgesichert	0	0,00 %

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Wellington Pagosa		
Klasse A Thes.	112.701	0,84 %
Klasse A Thes. In CHF abgesichert	1.820	0,74 %
Klasse A Thes. In EUR abgesichert	98.106	0,72 %
Klasse A Thes. In SGD abgesichert	16.447	0,83 %
Klasse A1 Thes.	0	0,00 %
Klasse C Thes.	1.769.466	0,86 %
Klasse C Thes. In BRL abgesichert	191.326	0,93 %
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	25.757	0,80 %
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	616.627	0,78 %
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	455.396	0,85 %
Klasse C Thes. In SGD abgesichert	0	0,00 %
Klasse C1 Thes.	0	0,00 %
Klasse C1 Thes. In CHF abgesichert	240	0,79 %
Klasse C1 Thes. In EUR abgesichert	16.270	0,81 %
Klasse E Thes.	44.217	0,73 %
Klasse E Thes. In CHF abgesichert	7.493	0,62 %
Klasse E Thes. In EUR abgesichert	115.520	0,64 %
Klasse E Thes. In GBP abgesichert	57.254	0,68 %
Klasse E Thes. In SGD abgesichert	0	0,00 %
Klasse I Thes.	Entfällt#	Entfällt#

Für den Schroder GAIA Cat Bond und den Schroder GAIA Oaktree Credit wird keine Performancegebühr berechnet.

Für die Anteilsklasse werden keine Performancegebühren erhoben.

Gesamtkostenquote („TER“)

für den Berichtszeitraum zum 31. März 2022

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA BlueTrend	
Klasse A Thes.	2,00 %
Klasse A Thes. In CHF abgesichert	2,03 %
Klasse A Thes. In EUR abgesichert	2,03 %
Klasse A Thes. In SGD abgesichert	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. CHF	1,33 %
Klasse E Thes. In CHF abgesichert	1,43 %
Klasse E Thes. In EUR abgesichert	1,43 %
Klasse E Thes. GBP	1,38 %
Klasse E Thes. In GBP abgesichert	1,43 %
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	1,43 %
Klasse I Thes.	0,07 %
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	1,43 %
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	1,43 %
Schroder GAIA Cat Bond	
Klasse A Thes.	1,78 %
Klasse A Thes. In EUR abgesichert	1,85 %
Klasse A Thes. In SEK abgesichert	1,82 %
Klasse C Thes.	1,38 %
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	1,40 %
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	1,40 %
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	1,41 %
Klasse F Thes.	1,72 %
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	1,73 %
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	1,73 %
Klasse F Aussch.	1,73 %
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1,73 %
Klasse I Thes.	0,14 %
Klasse I Thes. In CHF abgesichert	0,15 %
Klasse I Thes. In EUR abgesichert	0,16 %
Klasse I Thes. In JPY abgesichert	0,17 %
Klasse IF Thes.	1,32 %
Klasse IF Thes. In CHF abgesichert	1,33 %
Klasse IF Thes. In EUR abgesichert	1,33 %
Klasse IF Thes. In SEK abgesichert	1,33 %
Klasse IF Aussch.	1,32 %
Schroder GAIA Contour Tech Equity	
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 A1 Thes.	2,92 %

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)	
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	1,71 %
Klasse C Thes. In SEK abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes. In SGD abgesichert	1,69 %
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 GBP abgesichert	1,45 %
Klasse E Thes. In SEK abgesichert	1,46 %
Klasse E Thes. In SGD abgesichert	1,45 %
Klasse I Thes.	0,10 %
Schroder GAIA Egerton Equity	
Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse A Thes. In GBP abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes. In USD abgesichert	2,46 %
Klasse A Aussch. GBP	2,43 %
Klasse A1 Thes.	2,93 %
Klasse A1 Thes. In USD abgesichert	2,96 %
Klasse C Thes.	1,67 %
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes. In USD abgesichert	1,70 %
Klasse C Aussch.	1,67 %
Klasse C Aussch. GBP	1,68 %
Klasse E Thes.	1,67 %
Klasse I Thes.	0,15 %
Klasse I Thes. In USD abgesichert	0,15 %
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	2,46 %
Klasse A Thes. In SEK abgesichert	2,45 %
Klasse A Thes. In SGD abgesichert	2,45 %
Klasse C Thes.	1,38 %
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	1,41 %
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	1,41 %
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	1,42 %
Klasse C Thes. In SEK abgesichert	1,45 %
Klasse C Thes. In SGD abgesichert	1,41 %
Klasse C1 Thes.	1,35 %
Klasse C1 Thes. In CHF abgesichert	1,39 %
Klasse C1 Thes. In EUR abgesichert	1,39 %
Klasse E Thes.	1,00 %
Klasse E Thes. In CHF abgesichert	0,99 %
Klasse E Thes. In EUR abgesichert	1,00 %
Klasse E Thes. In GBP abgesichert	0,99 %
Klasse E Thes. In SGD abgesichert	0,99 %

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

Gesamtkostenquote (TER)

für den Berichtszeitraum zum 31. März 2022 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Helix (Forts.)	
Klasse I Thes.	0,14 %
Klasse I Thes. In JPY abgesichert	0,17 %
Klasse IZ Thes. In GBP abgesichert	1,17 %
Klasse S Aussch.	0,85 %
Klasse S Aussch. In EUR abgesichert	0,89 %
Klasse S Aussch. In GBP abgesichert	0,95 %
Klasse X Thes. In EUR abgesichert	0,77 %
Schroder GAIA Oaktree Credit	
Klasse A2 Thes.	1,33 %
Klasse A2 Thes. In CHF abgesichert	1,60 %
Klasse A2 Thes. In EUR abgesichert	1,59 %
Klasse C Thes.	0,95 %
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	1,10 %
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	1,08 %
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	1,08 %
Klasse E Thes.	0,91 %
Klasse E Thes. In CHF abgesichert	0,94 %
Klasse E Thes. In EUR abgesichert	0,93 %
Klasse E Thes. In GBP abgesichert	0,92 %
Klasse I Thes.	0,14 %
Schroder GAIA Sirios US Equity	
Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse A Thes. In CHF abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes. In EUR abgesichert	2,46 %
Klasse C Thes.	1,67 %
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	1,71 %
Klasse C Aussch. In GBP abgesichert	1,70 %
Klasse E Thes.	1,36 %
Klasse E Thes. In EUR abgesichert	1,40 %
Klasse I Thes.	0,16 %
Klasse X Thes.	1,49 %
Klasse X Thes. In EUR abgesichert	1,60 %
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	
Klasse C Thes.	1,83 %
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	1,85 %
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	1,86 %
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	1,86 %
Klasse I Thes.	0,09 %
Klasse K Thes.	2,33 %
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	2,36 %
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	2,36 %

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	
Klasse C Thes.	1,22 %
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	1,16 %
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	1,16 %
Klasse C Thes. In USD abgesichert	1,16 %
Klasse I Thes.	0,07 %
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	1,66 %
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	1,71 %
Klasse R Thes.	1,13 %
Klasse R Thes. In EUR abgesichert	1,16 %
Klasse R Thes. In USD abgesichert	1,16 %
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 A1 Thes.	2,90 %
Klasse C Thes.	1,68 %
Klasse C Thes. In BRL abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes. In CHF abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes. In EUR abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes. In GBP abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes. In SGD abgesichert	1,69 %
Klasse C1 Thes.	1,68 %
Klasse C1 Thes. In CHF abgesichert	1,71 %
Klasse C1 Thes. In EUR abgesichert	1,72 %
Klasse E Thes.	1,18 %
Klasse E Thes. In CHF abgesichert	1,20 %
Klasse E Thes. In EUR abgesichert	1,21 %
Klasse E Thes. In GBP abgesichert	1,21 %
Klasse E Thes. In SGD abgesichert	1,20 %
Klasse I Thes.	0,11 %

Beachten Sie bitte, dass die Transaktionskosten – wie in den Anmerkungen zum Abschluss 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 2022 nachfolgend detailliert aufgeführt:

Schroder GAIA Egerton Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte - Long-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
17.048.614	2,03 %
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
27.840.742	3,33 %
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt EUR	% des verwalteten Vermögens
44.889.356	5,36 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2022 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	20.300.010
Morgan Stanley	15.311.620
J.P. Morgan	7.108.992
Merrill Lynch	2.113.506
UBS	55.228
	44.889.356

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert EUR
Barmittel	10.519.003
	10.519.003

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert EUR
weniger als 1 Tag	10.519.003
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	10.519.003

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert EUR
EUR	10.519.003
	10.519.003

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen EUR	Short-Positionen EUR	Summe EUR
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	192.777	192.777
3 bis 12 Monate	9.601.510	12.868.885	22.470.395
mehr als 1 Jahr	7.447.104	14.779.080	22.226.184
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	17.048.614	27.840.742	44.889.356

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
UBS	Schweiz

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert EUR
Morgan Stanley	10.519.003
	10.519.003

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	27.982.538
Gepoolt	-
Sonstige	-
	27.982.538

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 Egerton Equity (Forts.)

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2022 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite EUR*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettogewinn	73,78 %	30.907.296
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	26,22 %	10.982.366
	100,00 %	41.889.662

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in „Nettoertrag 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 Helix

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte - Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
–	–
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
17.871.439	2,55 %
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
17.871.439	2,55 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2022 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	7.337.608
Goldman Sachs	6.008.866
Morgan Stanley	4.524.965
	17.871.439

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	8.940.000
	8.940.000

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	8.940.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	8.940.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	8.940.000
	8.940.000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	-	17.871.439	17.871.439
mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	-	17.871.439	17.871.439

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
J.P. Morgan	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.

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Goldman Sachs	4.610.000
J.P. Morgan	4.330.000
	8.940.000

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Gestellte Sicherheiten

Zum 31. März 2022 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu 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 2022 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettogewinn	76,90 %	132.629.087
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	23,10 %	39.831.226
	100,00 %	172.460.313

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in „Nettoertrag 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 Sirios US Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
5.344.349	2,31 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
5.465.614	2,37 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
10.809.963	4,68 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2022 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	5.660.920
Goldman Sachs	2.659.000
Morgan Stanley	2.490.043
	10.809.963

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 31. März 2022 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Zum 31. März 2022 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Währung von Sicherheiten

Zum 31. März 2022 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	255.416	255.416
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	1.236.200	333.918	1.570.118
3 bis 12 Monate	3.861.509	3.735.896	7.597.405
mehr als 1 Jahr	246.640	1.140.384	1.387.024
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	5.344.349	5.465.614	10.809.963

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Merrill Lynch	USA
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.

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 31. März 2022 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	1.470.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	1.470.000

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.

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2022 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettogewinn	76,15 %	15.705.957
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	23,85 %	4.919.030
	100,00 %	20.624.987

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in „Nettoertrag 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	% des verwalteten Vermögens
18.214.622	2,17 %
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
–	–
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
18.214.622	2,17 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2022 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	18.214.622
	18.214.622

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	9.500.000
	9.500.000

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert EUR
weniger als 1 Tag	9.500.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	9.500.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert EUR
USD	9.500.000
	9.500.000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	18.214.622	-	18.214.622
mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	18.214.622	-	18.214.622

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Morgan Stanley	USA

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	9.500.000
	9.500.000

Gestellte Sicherheiten

Zum 31. März 2022 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu 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 Two Sigma Diversified (Forts.)

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2022 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettogewinn	66,91 %	56.633.350
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	33,09 %	28.005.016
	100,00 %	84.638.366

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in „Nettoertrag 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 Wellington Pagosa

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
5.044.113	1,09 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
8.677.740	1,87 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
13.721.853	2,96 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2022 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	6.165.262
J.P. Morgan	4.412.397
Goldman Sachs	3.144.194
	13.721.853

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	1.160.000
	1.160.000

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	1.160.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	1.160.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	1.160.000
	1.160.000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	7.439	2.032	9.471
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	134.230	40.728	174.958
3 bis 12 Monate	351.547	314.609	666.156
mehr als 1 Jahr	4.550.897	8.320.371	12.871.268
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	5.044.113	8.677.740	13.721.853

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
J.P. Morgan	810.000
Morgan Stanley	350.000
	1.160.000

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	4.499.032
Gepoolt	-
Sonstige	-
	4.499.032

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 2022 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	-	-
Realisierter Nettogewinn	45,65 %	810.041
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	54,35 %	964.522
	100,00 %	1.774.563

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in „Nettoertrag 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.



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 2022 DEDE