



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Geprüfter Jahresbericht

30. September 2022

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

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

Inhalt

Schroder GAIA	5
Informationen für Investoren in der Schweiz	6
Verwaltungsrat	7
Verwaltung	8
Bericht des Verwaltungsrats	9
Bericht des Anlageverwalters	11
Prüfbericht	13
Nettovermögensaufstellung	16
Ertrags- und Aufwandsrechnung	30
Veränderung des Nettovermögens	32
Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen	34
Anlageportfolio	38
Schroder GAIA BlueTrend	38
Schroder GAIA Cat Bond	39
Schroder GAIA Contour Tech Equity	44
Schroder GAIA Egerton Equity	44
Schroder GAIA Helix	45
Schroder GAIA Oaktree Credit	49
Schroder GAIA Sirius US Equity	56
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	57
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	58
Schroder GAIA Wellington Pagosa	59
Anmerkungen zum Abschluss	69
Gesamtkostenquote („TER“)	153
Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)	155
Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)	157
Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft)	168
Anhang IV – Fondsperformance (ungeprüft)	191

Die Gesellschaft

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

Dieser Bericht betrifft das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2021 bis zum 30. September 2022. Der 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 30. September 2022, der letzte Arbeitstag im Berichtsjahr. 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.

Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

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

Informationen für Investoren in der Schweiz

Schweizer Vertreter:

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

Schweizer Zahlstelle:

Schroder & Co Bank AG
Central 2
CH-8001 Zürich
Schweiz

Ort, an dem die relevanten Dokumente erhältlich sind

Der Prospekt für die Schweiz, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung der Gesellschaft, die Jahres- und Halbjahresberichte sowie die Liste der Käufe und Verkäufe während des Berichtszeitraums sind kostenlos beim Schweizer Vertreter erhältlich.

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsvorsitzender

- **Eric Bertrand**

Head of Schroders GAIA

Vaults 13-16
Valletta Waterfront
1914 FRN
Malta

Weitere Mitglieder

- **Carla Bergareche**

Head of Iberian Business

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

- **Mike Champion¹**

Head of Product Development

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

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

Independent Director

12, rue de la Sapinière, 8150 Bridel
Grossherzogtum Luxemburg

- **Bernard Herman**

Independent Director

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

- **Achim Küssner²**

Country Head Germany, Austria & CEE

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

- **Hugh Mullan**

Independent Director

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Grossherzogtum Luxemburg

- **Alexander Prawitz³**

Head of Central and Emerging Europe Distribution

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

- **Neil Walton**

Head of Investment Solutions

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

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

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

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

Verwaltung

Eingetragener Sitz

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Grossherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft, Register- und Domizilstelle

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Grossherzogtum Luxemburg

Hauptzahlstelle und Transferstelle

HSBC Continental Europe, Luxembourg¹

16, boulevard d'Avranches, 1160 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.²

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

Contour Asset Management, LLC

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

Egerton Capital (UK) LLP

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

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

- Egerton Capital (US), LP.

Oaktree Capital Management, L.P.

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

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

- Oaktree Capital Management (UK) LLP

Schroder Investment Management Limited

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

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

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

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

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

Sirios Capital Management LP

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

Systematica Investments Limited

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

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

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

Two Sigma Advisers LP

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

Wellington Management International Limited

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

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

- Wellington Management Company LLP.

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

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

Bericht des Verwaltungsrats

Einleitung

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

Aktivitäten während des Geschäftsjahres

Zum 30. September 2022 belief sich das Nettovermögen der Gesellschaft insgesamt auf 5 333 186 258 EUR, was im Vergleich zu 5 674 359 712 EUR zum 30. September 2021 einem Rückgang um 6,01% entspricht.

1. Neue Anteilsklassen

Die folgenden Anteilsklassen wurden im Berichtsjahr aufgelegt:

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

Bericht des Verwaltungsrats (Forts.)

2. Auflösungen von Anteilsklassen

Während des Berichtsjahrs wurden die folgenden Anteilsklassen aufgelöst:

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

Der Verwaltungsrat

Schroder GAIA
30. September 2022

Bericht des Anlageverwalters

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

Wirtschaftlicher Rückblick

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

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

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

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

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

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

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

Überblick über die Entwicklung am Aktienmarkt

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

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

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

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

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

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

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

Bericht des Anlageverwalters (Forts.)

Überblick über die Entwicklung am Anleihemarkt

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Ausblick

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

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

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

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

Die Anlageverwalter

Schroder GAIA

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



Prüfbericht

An die Anteilhaber von
Schroder GAIA

Unser Prüfungsurteil

Unseres Erachtens zeigt der beiliegende Jahresabschluss ein wahrheitsgetreues und angemessenes Bild der Finanzlage des Schroder GAIA (der «Fonds») und jedes seiner Teilfonds zum 30. September 2022 sowie ihrer Betriebsergebnisse und Veränderungen des Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr im Einklang mit den in Luxemburg geltenden rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen in Bezug auf die Erstellung und Darstellung des Jahresabschlusses.

Umfang unserer Prüfung

Der Abschluss des Fonds umfasst:

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

Grundlage des Bestätigungsvermerks

Wir haben unsere Prüfung im Einklang mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über das Prüfungswesen (Gesetz vom 23. Juli 2016) und den internationalen Prüfungsstandards (International Standards on Auditing, ISAs), die von der «Commission de Surveillance du Secteur Financier» (CSSF) für Luxemburg übernommen wurden, durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten im Rahmen des Gesetzes vom 23. Juli 2016 und der von der CSSF für Luxemburg übernommenen ISAs sind im Abschnitt «Verantwortung des «Réviseur d'entreprises agréé» für die Prüfung des Abschlusses» unseres Berichts näher ausgeführt.

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

Wir sind im Einklang mit dem von der CSSF für Luxemburg übernommenen International Code of Ethics for Professional Accountants, einschliesslich der International Independence Standards, des International Ethics Standards Board for Accountants (IESBA Code) zusammen mit den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Abschlusses gelten, unabhängig vom Fonds. Wir haben unsere sonstigen ethischen Verantwortlichkeiten im Rahmen dieser ethischen Anforderungen erfüllt.

Sonstige Angaben

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die sonstigen Angaben verantwortlich. Die sonstigen Angaben umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Angaben, jedoch nicht den Jahresabschluss und unser Prüfungsurteil zu diesem Jahresabschluss.

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

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



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

In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses liegt es in unserer Verantwortung, die vorstehend identifizierten sonstigen Angaben zu lesen und dabei zu erwägen, ob die sonstigen Angaben wesentliche Widersprüche zum Abschluss oder unseren im Rahmen der Prüfung erworbenen Kenntnisse enthalten oder anderweitig wesentlich fehlerhaft zu sein scheinen. Wenn wir auf der Grundlage unserer durchgeführten Arbeit feststellen, dass diese sonstigen Angaben wesentliche Falschaussagen enthalten, sind wir verpflichtet, dies zu berichten. Wir haben in dieser Hinsicht nichts zu berichten.

Verantwortung des Verwaltungsrats des Fonds für den Abschluss

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

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

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

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

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

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher Falschaussagen im Abschluss aufgrund von Betrug oder Irrtum, wir konzipieren auf diese Risiken ausgerichtete Prüfungsverfahren und führen diese durch und wir verschaffen uns Prüfungsnachweise, die als Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk ausreichend und geeignet sind. Das Risiko, dass eine auf Betrug zurückzuführende wesentliche Falschaussage nicht aufgedeckt wird, ist höher als im Fall von Irrtümern, da im Betrugsfall Absprachen, Fälschungen, absichtliche Auslassungen, Falschdarstellungen oder das Ausschalten interner Kontrollmassnahmen vorliegen können;
- verschaffen wir uns ein Verständnis der für die Prüfung relevanten internen Kontrollmassnahmen, um Prüfverfahren zu konzipieren, die für die jeweilige Situation geeignet sind, jedoch nicht zum Zweck der Äusserung einer Ansicht darüber, ob die internen Kontrollmassnahmen des Fonds wirksam sind oder nicht;

Prüfbericht (Forts.)



- beurteilen wir die Eignung der verwendeten Rechnungslegungsmethoden und die Angemessenheit der rechnungslegungsbezogenen Schätzungen und der diesbezüglichen Angaben des Verwaltungsrats des Fonds;
- die Schlussfolgerung, ob der vom Verwaltungsrat des Fonds bei der Erstellung des Abschlusses angewandte Grundsatz der Unternehmensfortführung angemessen ist und ob auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise eine wesentliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen besteht, die die Fähigkeit des Fonds oder eines seiner Teilfonds zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit ernsthaft in Zweifel stellen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine erhebliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Prüfungsbericht auf die entsprechenden Angaben im Abschluss aufmerksam zu machen oder unseren Bestätigungsvermerk zu ändern, wenn diese Angaben unzulänglich sind. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den Ergebnissen aus unserer Prüfung bis zum Datum unseres Prüfungsberichts. Zukünftige Ereignisse oder Bedingungen können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds nicht fortgeführt wird;
- beurteilen wir die allgemeine Darstellung, die Struktur und den Inhalt des Abschlusses einschliesslich der Offenlegungen, und wir beurteilen, ob der Abschluss die zugrunde liegenden Transaktionen und Ereignisse angemessen darstellt.

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

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Vertreten durch

Luxemburg, 26. Januar 2023

Karim Bara

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
VERMÖGENSWERTE					
Anlagen					
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	265 700 355	2 179 139 807	165 744 016	477 637 625	468 380 959
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	(9 697 344)	(270 506 005)	(34 663 131)	35 726 926	(67 085 423)
Wertpapiere zum Marktwert	256 003 011	1 908 633 802	131 080 885	513 364 551	401 295 536
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)					
aus Devisenterminkontrakten	11 012 105	7 736 272	191 631	(4 179 985)	(7 002 938)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	7 313 025	-	-	2 219 883	13 861 093
aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit-Default-Index-Kontrakten	1 489 913	-	-	-	-
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	7 700 521	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	35 550 217	35 507 327
aus Differenzkontrakten	578 711	-	16 429 571	-	(29 916 932)
	28 094 275	7 736 272	16 621 202	33 590 115	12 448 550
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	298 242	1 969 715	19 880 845	23 022 900	68 063 492
Bankguthaben	76 475 853	36 251 868	62 889 029	29 212 491	43 028 335
Termineinlagen	-	-	-	-	-
Forderung aus Broker-Einschusskonto	890 952	-	-	2 078 170	-
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	12 997 260	51740000	10077783	11442008	17864781
Forderungen aus Zeichnungen	13 792 392	-	210 536	91 765	1 047 011
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	-	1 061 823
Dividenden und Zinsforderungen	409 583	22 495 027	236 233	1 042 826	6 782 303
Erstattungsforderung des Fonds	173 603	-	-	-	6 566
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	1 180 000	-
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	3 130 000	16 240 000	1 280 000	1 430 000	6 590 000
Sonstige Forderungen	-	-	-	2 347 715	-
SUMME VERMÖGENSWERTE	392 265 171	2 045 066 684	242 276 513	618 802 541	558 188 397
VERBINDLICHKEITEN					
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	2 329	-	3 722 834	10 332 001	17 012 268
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	1 031 997	-	13 315 948	15 193 712	11 793 516
Fällige Managementgebühren	303 001	1 723 318	251 170	756 834	272 044
Fällige Performancegebühren	6 790 392	-	11 590	-	118
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	39 099	-	1 033 782	483 069	1 426 836
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	-	7 927 368
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	-	-	-
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	1 540 000	6 890 000	710 000	-	4 180 000
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	1 590 000	9 350 000	570 000	2 610 000	2 410 000
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	9 517 187	50 249 655	3 126 157	829 153	22 802 532
SUMME VERBINDLICHKEITEN	20 814 005	68 212 973	22 741 481	30 204 769	67 824 682
SUMME NETTOVERMÖGEN	371 451 166	1 976 853 711	219 535 032	588 597 772	490 363 715

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
VERMÖGENSWERTE						
Anlagen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	52 815 059	187 604 270	5 164 828	37 404 095	508 087 186	4 430 905 432
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	(7 377 735)	(9 269 251)	(50 519)	(2 843 271)	(21 688 985)	(396 407 207)
Wertpapiere zum Marktwert	45 437 324	178 335 019	5 114 309	34 560 824	486 398 201	4 034 498 225
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	1 067 144	694 725	2 002 218	90 379	5 123 037	17 171 076
aus Kassageschäften	-	-	12 432	-	-	12 685
aus Terminkontrakten	43 173	-	3 736 982	138 600	(601 740)	27 226 043
aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	1 422 646	1 451 606
aus Credit-Default-Index-Kontrakten	-	-	536 107	-	248 695	2 321 019
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(5 968)	(6 089)
aus Inflations-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	9 777	9 976
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(1 308 497)	6 522 141
aus Total Return Swaps	-	7 695 581	18 017 797	-	12 526 162	110 798 285
aus Differenzkontrakten	-	-	-	263 253	-	(12 871 502)
	1 110 317	8 390 306	24 305 536	492 232	17 414 112	152 635 240
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	2 197 535	1 390 825	278 569	189 870	31 199 611	151 068 240
Bankguthaben	2 215 406	6 712 071	465 714 145	2 882 972	57 150 139	798 209 834
Termineinlagen	-	-	338 925 000	-	-	345 824 201
Forderung aus Broker-Einschusskonto	85 397	-	26 874 668	-	37 239 804	68 493 988
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	110 000	-	28 623 738	2 058 905	47 466 464	186 105 444
Forderungen aus Zeichnungen	118 467	349 294	7 868 681	8 797	4 040 936	28 087 418
Optionen und Swaptions zum Marktwert	775	-	-	-	2 417 299	3 550 734
Dividenden und Zinsforderungen	606 636	325 930	75 109	135 076	1 530 549	34 318 873
Erstattungsforderung des Fonds	-	-	-	-	-	183837
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	70 000	-	1 259 750
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	50 000	750 000	5 470 000	90 000	3 750 000	39 551 004
Sonstige Forderungen	-	-	-	531 061	-	2 952 742
SUMME VERMÖGENSWERTE	51 931 857	196 253 445	903 249 755	41 019 737	688 607 115	5 846 739 530
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	4 095 159	2 878 475	185 408 773	128 323	48 661 664	277 588 556
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	124 198	643 421	1 559 338	10 386	6 860 508	51 253 631
Fällige Managementgebühren	15 016	269 495	863 553	25 133	651 412	5 223 005
Fällige Performancegebühren	-	480 767	331	-	3 407 256	10 908 070
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	-	173 358	737 639	45 342	1 039 377	5 075 404
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	-	-	8 088 739
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	910 000	-	-	-	928 524
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	30 000	440 000	3 600 000	-	2 100 000	19 886 741
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	20 000	310 000	1 870 000	160 000	1 650 000	20 924 013
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	131 071	1 678 863	14 364 106	25 284	8 698 325	113 676 589
SUMME VERBINDLICHKEITEN	4 415 444	7 784 379	208 403 740	394 468	73 068 542	513 553 272
SUMME NETTOVERMÖGEN	47 516 413	188 469 066	694 846 015	40 625 269	615 538 573	5 333 186 258

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert					
zum 30. September 2022	371 451 166	1 976 853 711	219 535 032	588 597 772	490 363 715
zum 30. September 2021	206 090 340	2 363 039 525	441 703 360	949 465 017	731 532 901
zum 30. September 2020	87 937 926	1 243 442 808	229 295 450	1 015 453 805	404 188 534
Im Umlauf befindliche Anteile*					
zum 30. September 2022					
Klasse A Thes.	123 093	2 401	176 071	361 114	4 847
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2 122	-	2 838	-	100
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	431 750	2 913	39 126	-	129 763
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	10 884	-
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	-	100	-	-	151
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	5 342	-	140
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	344 709	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	813	-
Klasse A1 Thes.	-	-	15 885	22 018	-
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	91 701	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	447 257	7 052	953 745	1 021 683	10 917
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	296 014	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	14 183	1 937	22 773	-	369
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	351 354	8 204	530 090	-	71 105
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	720 276	2 000	179 245	294 604	39 997
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	94 048	-	11
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	140
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	624 156	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	5 866	-
Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	3 711	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	13 040	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	1
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	50 801	-	9 594	6	450 656
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	2 509	-	56 356
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	5 000	-	37 980	-	1 392 317
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	86 926
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	50 117	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	120 008	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	14 858	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	1 262	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	7 655	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	162	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	256	-	-	-
Klasse I Thes.	-	148 883	-	-	164 951
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	27 091	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	9	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	120	-	-	103
Klasse IF Thes.	-	200 458	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	114 953	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	451 410	-	-	-
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	-	7 383 343	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	11 709	-	-	-
Klasse IZ Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	92

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Im Umlauf befindliche Anteile* (Forts.)					
zum 30. September 2022					
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	68 900	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	1 250	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in SEK abgesichert)	40 059	-	-	-	-
Klasse PI Thes. (in CHF abgesichert)	-	27 100	-	-	-
Klasse PI Thes. (in EUR abgesichert)	-	40 030	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	56 230	-	-	-
Klasse PI Aussch. (in GBP abgesichert)	-	79 439	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	120 427
Klasse S Aussch. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	27 910
Klasse S Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	1 334 152
Klasse X Thes.	-	-	-	144 100	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	655 490
Klasse Y Thes.	-	2	-	-	-
Klasse Y Thes. (in CHF abgesichert)	-	10	-	-	-
Klasse Y Thes. (in EUR abgesichert)	-	10	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	2	-	-	-
Klasse Y1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	10	-	-	-
Klasse Y1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	10	-	-	-

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert					
zum 30. September 2022	47 516 413	188 469 066	694 846 015	40 625 269	615 538 573
zum 30. September 2021	28 626 911	338 622 600	908 388 830	32 208 486	411 679 496
zum 30. September 2020	-	496 429 129	1 437 139 563	53 232 443	551 890 372
Im Umlauf befindliche Anteile*					
zum 30. September 2022					
Klasse A Thes.	-	601 060	-	-	142 940
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	-	4 775	-	-	5 707
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	-	105 281	-	-	202 353
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	16 885
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	15	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. (in CHF abgesichert)	100	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. (in EUR abgesichert)	100	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	15	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch. (in CHF abgesichert)	101	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch. (in EUR abgesichert)	100	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch. (in GBP abgesichert)	101	-	-	-	-
Klasse C Thes.	10 131	319 476	2 247 282	132 532	2 708 890
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	-	139 846
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	620	11 677	37 517	2 569	79 016
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	100	208 845	1 234 520	94 001	1 300 358
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	100	53 093	1 409 403	-	616 372
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	5 072	-
Klasse C Aussch.	15	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert)	101	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in EUR abgesichert)	100	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	101	300	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	23
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	365
Klasse E Thes.	264 913	170	-	-	47 943
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	100	-	-	-	8 532
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	49 404	11 132	-	-	128 136
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	100	-	-	-	64 002
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	15	-	-	-	-
Klasse E Aussch. (in CHF abgesichert)	101	-	-	-	-
Klasse E Aussch. (in EUR abgesichert)	100	-	-	-	-
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	101	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	200 015	-	-	15	-
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Im Umlauf befindliche Anteile* (Forts.)					
zum 30. September 2022					
Klasse K Thes.	-	-	567 192	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	885	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	68 884	87	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	77	-
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	95 767	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	26 142	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	4 574	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	15	-	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	68	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

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

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

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

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

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

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

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

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil*					
zum 30. September 2021					
Klasse A Thes.	104,27	1 467,46	132,18	220,80	115,45
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	90,88	-	121,95	-	109,23
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	93,88	-	124,41	-	110,04
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	206,94	-
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	-	913,91	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	142,43	-	181,62	-	114,68
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	218,87	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	210,98	-
Klasse A1 Thes.	-	-	131,99	207,06	-
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	210,90	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	107,08	1 476,56	136,52	237,81	118,46
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	105,88	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	93,82	1 160,58	127,56	-	112,83
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	96,05	1 221,98	128,16	-	113,22
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	102,06	104,90	105,55	221,12	115,81
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	1 065,45	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	188,93	-	117,41
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	236,05	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	237,14	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	227,65	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	101,08	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5 851,33
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	5 641,43
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	5 671,85
Klasse E Thes.	110,23	-	137,92	236,00	120,71
Klasse E Thes. CHF	96,45	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	94,54	-	128,05	-	114,22
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	98,76	-	129,31	-	115,35
Klasse E Thes. GBP	108,56	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	105,36	-	105,52	-	117,81
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	1065,91	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	190,34	-	119,58
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	104,12	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	1 466,48	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	1 155,70	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	1 214,16	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	1 173,41	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	1 569,30	-	-	-
Klasse I Thes.	121,74	1 662,84	157,11	341,27	125,92
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	1 407,79	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	1 484,33	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	10 608,63	-	-	12903,29
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	275,98	-
Klasse IF Thes.	-	1 514,07	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	1 281,57	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	1 351,44	-	-	-
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	-	922,66	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	1 396,47	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	95,01	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	105,16	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	-	236,36	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	114,60

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

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

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil*					
zum 30. September 2020					
Klasse A Thes.	86,58	1 420,12	123,26	211,77	107,16
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	76,51	-	115,69	-	102,22
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	78,76	-	116,88	-	102,77
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	197,45	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	118,40	-	171,31	-	105,54
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	208,39	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	213,86	-
Klasse A1 Thes.	-	-	123,20	199,36	-
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	201,60	-
Klasse C Thes.	88,63	1 423,33	126,38	226,74	108,09
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	78,43	1 132,03	119,86	-	103,83
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	80,11	1 187,75	119,68	-	104,43
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	84,81	101,39	97,89	209,80	106,30
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	29 258,43	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	990,58	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	174,53	-	107,19
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	223,17	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	226,00	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	229,37	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	84,95	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5 333,77
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	5 191,66
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	5 208,67
Klasse E Thes.	91,56	-	126,84	224,98	109,18
Klasse E Thes. CHF	79,53	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	79,92	-	119,03	-	104,69
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	82,36	-	119,96	-	105,46
Klasse E Thes. GBP	94,68	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	88,59	-	97,47	-	106,98
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	986,64	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	175,49	-	108,18
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	87,47	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	1 418,48	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	1 130,75	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	1 185,11	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	1 170,10	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	1 566,30	-	-	-
Klasse I Thes.	98,72	1 583,23	139,84	317,22	110,86
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	1 355,82	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	1 426,13	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	10 145,79	-	-	11 409,09
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	254,12	-
Klasse IF Thes.	-	1 458,67	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	1 248,94	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	1 313,54	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	1 392,31	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	87,63	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	-	225,24	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	104,73

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2022 (Forts.)

	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil*				
zum 30. September 2020				
Klasse A Thes.	135,15	-	-	102,30
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	162,66	-	-	94,81
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	122,38	-	-	95,77
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	140,69
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	100,92
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse C Thes.	140,52	117,57	96,28	104,32
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	102,62
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	167,07	107,12	122,31	96,62
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	126,91	108,95	108,76	97,67
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	131,62	112,57	-	80,23
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	143,51
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	128,91	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	131,54	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	5 218,57
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	4 836,18
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	4 882,00
Klasse E Thes.	149,91	-	-	105,52
Klasse E Thes. CHF	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	97,89
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	135,83	-	-	98,89
Klasse E Thes. GBP	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	81,26
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	145,42
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse I Thes.	178,21	134,70	98,74	108,36
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	115,46	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	105,16	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	106,80	107,71	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	127,17	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	96,30	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	108,77	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	128,94	-
Klasse X Thes.	93,01	-	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	134,99	-	-	-

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

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

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
ERTRÄGE					
Nettoausschüttungen [^]	5 660	-	-	3 198 194	31 003 789
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	1 173 440	28 913 079	-	-	851 314
Nettoertrag aus Swaps	402 815	-	-	-	248 979
Bankzinsen	172 989	439 892	335 280	900	218 997
Sonstige Erträge	10 510	26 166	-	25 542	-
Erträge insgesamt	1 765 414	29 379 137	335 280	3 224 636	32 323 079
AUFWAND					
Performancegebühren	6 790 392	-	11 590	854 333	117
Managementgebühren	2 863 828	22 477 113	4 510 598	11 588 745	4 230 815
Nettodividendenaufwand [^]	-	-	3 727 789	-	-
Nettoaufwand aus Swaps	-	14 075	869 096	1 290 952	-
Verwahrstellengebühren	217 615	587 143	89 188	210 845	221 239
Verwaltungsgebühren	806 805	3 560 261	1 076 842	2 525 116	873 891
Taxe d'abonnement	139 406	235 469	154 880	349 767	251 352
Vertriebsgebühren	-	-	13 756	117 449	-
Bank- und Zinskosten	8 300	-	927	497 312	51 049
Sonstige Aufwendungen	160 776	723 237	178 167	1 352 786	378 173
Aufwendungen insgesamt	10 987 122	27 597 298	10 632 833	18 787 305	6 006 636
Abzüglich: Kostenzuschüsse	(173 603)	-	-	-	(6 566)
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	(9 048 105)	1 781 839	(10 297 553)	(15 562 669)	26 323 009

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

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

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
ERTRÄGE						
Nettoausschüttungen [^]	13 887	1 543 896	20 734	243 454	2 311 861	39 085 808
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	1 797 812	105 593	2 328 959	199 043	1 611 821	37 757 523
Nettoertrag aus Swaps	-	-	-	-	-	665 062
Bankzinsen	14 028	72 097	867 318	12 791	408 411	2 595 965
Sonstige Erträge	414	115	-	-	8 503	72 181
Erträge insgesamt	1 826 141	1 721 701	3 217 011	455 288	4 340 596	80 176 539
AUFWAND						
Performancegebühren	-	480 767	331	-	3 407 257	11 762 403
Managementgebühren	105 806	4 097 156	11 631 959	271 242	6 454 898	69 417 458
Nettodividendenaufwand [^]	-	-	-	-	-	3 803 672
Nettoaufwand aus Swaps	-	1 273 197	10 772 847	322 467	2 810 293	17 718 235
Verwahrstellengebühren	30 774	65 454	212 379	8 704	357 173	2 037 980
Verwaltungsgebühren	43 378	800 219	2 514 586	95 963	1 600 536	14 140 509
Taxe d'abonnement	10 053	119 889	371 008	17 779	261 200	1 944 694
Vertriebsgebühren	-	-	-	-	3	131 488
Bank- und Zinskosten	31 186	-	104 550	24	100 726	800 118
Sonstige Aufwendungen	11 299	120 578	446 763	18 525	266 055	3 705 454
Aufwendungen insgesamt	232 496	6 957 260	26 054 423	734 704	15 258 141	125 462 011
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	-	-	-	-	(183 837)
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	1 593 645	(5 235 559)	(22 837 412)	(279 416)	(10 917 545)	(45 101 635)

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Veränderung des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)**	(9 048 105)	1 781 839	(10 297 553)	(15 562 669)	26 323 009
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)					
aus verkauften Wertpapieren	25 192 567	(14 218 711)	(113 414 552)	23 183 527	(39 735 420)
aus Devisenterminkontrakten	(12 632 475)	(326 756 007)	(30 767 424)	(51 204 276)	(114 763 314)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	22 482 081	-	-	4 760 933	16 439 687
aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit-Default-Index-Kontrakten	9 832 496	-	-	-	-
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	4 860 980	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	73 150 460	230 036 864
aus Differenzkontrakten	-	-	99 991 152	-	(145 038 981)
aus Versicherungsprämien	-	104 714 377	-	-	-
aus Optionen und Swaptions	1 356 495	-	(108 000)	-	1 289 001
aus Devisen	(1 510 719)	(857 050)	(146 731)	26 903 367	(31 850 080)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)	49 581 425	(237 117 391)	(44 445 555)	76 794 011	(83 622 243)
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)					
aus Anlagen	(17 234 380)	(268 442 067)	(54 831 745)	(143 916 303)	(107 700 615)
aus Devisenterminkontrakten	13 278 934	25 964 451	2 781 303	8 438 205	817 730
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	8 126 906	-	-	(1 170 366)	10 682 279
aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit-Default-Index-Kontrakten	(12 636 447)	-	-	-	-
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	9 961 515	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	3 992 207	7 492 066
aus Differenzkontrakten	1 039 530	-	3 116 216	-	(10 509 037)
aus Optionen und Swaptions	(2 564)	-	-	-	378 139
aus Devisen	63 581	485 838	46 315	(291 689)	141 049
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	2 597 075	(241 991 778)	(48 887 911)	(132 947 946)	(98 698 389)
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	43 130 395	(477 327 330)	(103 631 019)	(71 716 604)	(155 997 623)
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	203 122 323	547 127 393	120 527 317	124 513 744	549 360 274
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(80 891 892)	(454 837 140)	(239 064 626)	(413 664 385)	(627 774 600)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	(1 148 737)	-	-	(6 757 237)
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Geschäftsjahres	165 360 826	(386 185 814)	(222 168 328)	(360 867 245)	(241 169 186)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	206 090 340	2 363 039 525	441 703 360	949 465 017	731 532 901
Nennwährungsanpassung***	-	-	-	-	-
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	371 451 166	1 976 853 711	219 535 032	588 597 772	490 363 715

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

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

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)**	1 593 645	(5 235 559)	(22 837 412)	(279 416)	(10 917 545)	(45 101 635)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	(394 060)	13 769 451	513 554	(886 231)	4 782 916	(103 844 461)
aus Devisenterminkontrakten	540 963	(6 851 102)	(76 409 720)	306 507	(10 195 602)	(640 452 237)
aus Kassageschäften	-	-	(2 005 447)	-	-	(2 046 270)
aus Terminkontrakten	10 728	-	(7 127 564)	(276 262)	11 699 909	48 836 625
aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	2 386 568	2 435 149
aus Credit-Default-Index-Kontrakten	-	-	(1 880 673)	-	(52 813)	8 059 803
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	5 556 199	5 669 302
aus Inflations-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	111 247	113 511
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	8 732 552	13 870 244
aus Total Return Swaps	-	21 906 494	63 109 633	-	4 666 562	399 378 265
aus Differenzkontrakten	-	-	-	3 745 333	-	(41 697 850)
aus Versicherungsprämien	-	-	-	-	-	106 845 956
aus Optionen und Swaptions	(1 182)	622 662	-	(48 531)	(6 042 871)	(2 997 890)
aus Devisen	(222 228)	(1 801 381)	(6 625)	535	(12 174 917)	(22 654 446)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)	(65 779)	27 646 124	(23 806 842)	2 841 351	9 469 750	(228 484 299)
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)						
aus Anlagen	(7 090 507)	(44 905 710)	(161 555)	(3 434 957)	(38 620 420)	(697 788 364)
aus Devisenterminkontrakten	927 982	1 276 498	7 687 625	32 406	6 078 522	68 485 376
aus Kassageschäften	-	-	330	-	-	337
aus Terminkontrakten	43 173	-	16 032 461	163 800	(1 416 497)	33 165 855
aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	1 409 862	1 438 561
aus Credit-Default-Index-Kontrakten	-	-	626 291	-	242 370	(12 007 332)
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	988 953	1 009 084
aus Inflations-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	9 777	9 976
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(2 788 381)	7 319 151
aus Total Return Swaps	-	1 046 632	27 808 191	-	13 011 461	54 355 302
aus Differenzkontrakten	-	-	-	190 900	-	(6 265 131)
aus Optionen und Swaptions	422	(421 626)	-	5 889	426 466	395 299
aus Devisen	(36 636)	(22 286)	237 057	3 341	(1 540 792)	(926 497)
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	(6 155 566)	(43 026 492)	52 230 400	(3 038 621)	(22 198 679)	(550 808 383)
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	(4 627 700)	(20 615 927)	5 586 146	(476 686)	(23 646 474)	(824 394 317)
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	32 886 583	40 374 987	116 607 983	14 977 433	402 520 066	2 195 071 396
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(9 367 952)	(169 912 594)	(335 736 944)	(6 083 964)	(175 014 515)	(2 555 793 218)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	(1 429)	-	-	-	-	(8 068 367)
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Geschäftsjahres	18 889 502	(150 153 534)	(213 542 815)	8 416 783	203 859 077	(1 193 184 506)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	28 626 911	338 622 600	908 388 830	32 208 486	411 679 496	5 674 359 712
Nennwährungsanpassung***	-	-	-	-	-	852 011 052
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	47 516 413	188 469 066	694 846 015	40 625 269	615 538 573	5 333 186 258

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

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen

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

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

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

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

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

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

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

Anlageportfolio zum 30. September 2022

Schroder GAIA BlueTrend

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Vereinigte Staaten				
14 000 000	USD	United States Treasury Note 15/10/22, 1,38%	13 993 881	3,77
16 000 000	USD	United States Treasury Note 15/11/22, 1,63%	15 971 584	4,30
16 000 000	USD	United States Treasury Note 15/12/22, 1,63%	15 952 039	4,29
15 200 000	USD	United States Treasury Note 15/01/23, 1,50%	15 115 631	4,07
14 300 000	USD	United States Treasury Note 15/02/23, 1,38%	14 172 339	3,82
14 500 000	USD	United States Treasury Note 15/03/23, 0,50%	14 283 949	3,85
10 000 000	USD	United States Treasury Note 15/04/23, 0,25%	9 805 334	2,64
10 000 000	USD	United States Treasury Note 15/05/23, 0,13%	9 761 233	2,63
6 000 000	USD	United States Treasury Note 15/06/23, 0,25%	5 840 356	1,57
9 500 000	USD	United States Treasury Note 15/07/23, 0,13%	9 203 107	2,48
17 500 000	USD	United States Treasury Note 15/08/23, 0,13%	16 887 532	4,54
13 000 000	USD	United States Treasury Note 15/10/23, 0,13%	12 457 270	3,35
10 000 000	USD	United States Treasury Note 15/11/23, 0,25%	9 560 938	2,57
14 500 000	USD	United States Treasury Note 15/12/23, 0,13%	13 802 754	3,72
15 000 000	USD	United States Treasury Note 15/01/24, 0,13%	14 221 289	3,83
10 500 000	USD	United States Treasury Note 15/02/24, 0,13%	9 922 500	2,67
14 500 000	USD	United States Treasury Note 15/03/24, 0,25%	13 678 711	3,68
10 000 000	USD	United States Treasury Note 15/04/24, 0,38%	9 419 531	2,54
12 500 000	USD	United States Treasury Note 15/05/24, 0,25%	11 715 332	3,15
Summe Anleihen			235 765 310	63,47
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			235 765 310	63,47

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Irland				
212 580 894	USD	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	20 237 701	5,45
Summe Anleihen			20 237 701	5,45
Summe sonstige Wertpapiere			20 237 701	5,45
Summe Kapitalanlagen			256 003 011	68,92
Sonstiges Nettovermögen			115 448 155	31,08
Nettoinventarwert			371 451 166	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien									
Supranational									
550	USD	Voussoir Re SideCar	2 954 050	0,15	12 000 000	USD	Kilimanjaro III Re Series A1 19/12/23, variabel	9 000 000	0,46
697	USD	Voussoir Re SideCar-Preference	7 202 798	0,36	10 250 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/23, variabel	9 980 938	0,50
530	USD	Voussoir Re SideCar-Preference	53 767 440	2,72	5 250 000	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variabel	3 937 500	0,20
Summe Aktien									
63 924 288									
3,23									
Anleihen									
Bermuda									
14 963 000	USD	3264 Re 07/02/23, variabel	14 555 258	0,74	12 087 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variabel	11 769 716	0,60
26 000 000	USD	Acorn Re 07/11/24, variabel	24 844 299	1,26	3 750 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B1 21/04/25, variabel	3 571 875	0,18
10 263 000	USD	Baldwin Re 07/07/25, variabel	9 857 612	0,50	4 750 000	USD	Kilimanjaro III Re Series C1 21/04/25, variabel	4 560 000	0,23
2 667 000	USD	Blue Halo Re Series A 24/02/25, variabel	2 596 991	0,13	10 464 000	USD	Kilimanjaro III Re Series A2 20/04/26, variabel	9 156 000	0,46
3 500 000	USD	Blue Halo Re Series B 24/02/25, variabel	3 202 500	0,16	4 000 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B2 20/04/26, variabel	3 770 000	0,19
4 750 000	USD	Bowline Re Series 2019-1A 20/03/23, variabel	4 625 313	0,23	3 750 000	USD	Kilimanjaro III Re Series C2 20/04/26, variabel	3 590 625	0,18
14 350 000	USD	Bowline Re Series 2019-1B 20/03/23, variabel	13 973 313	0,71	6 000 000	USD	Kilimanjaro Re Series A2 05/05/23, variabel	5 710 500	0,29
3 333 000	USD	Bowline Re Series 2022-1 23/05/25, variabel	3 336 833	0,17	17 600 000	USD	Kilimanjaro Re Series B2 05/05/23, variabel	17 243 599	0,87
6 750 000	USD	Citrus Re 07/06/25, variabel	6 680 813	0,34	1 527 288	USD	Manatee Re III 08/06/26, variabel	305 458	0,02
133	USD	Eden Re II 22/03/23, ZCP	2 940	-	25 602 000	USD	Merna Reinsurance II 08/07/24, variabel	15 361 200	0,78
1 487 500	USD	Eden Re II 22/03/24, ZCP	629 436	0,03	15 000 000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/25, variabel	14 632 500	0,74
1 100 000	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	931 150	0,05	14 700 000	USD	Mona Lisa Re Series A 09/01/23, variabel	14 275 905	0,72
24 512 000	USD	Everglades Re II Series A1 14/05/24, variabel	21 447 999	1,08	11 714 000	USD	Mona Lisa Re Series B 09/01/23, variabel	11 564 647	0,59
28 750 000	USD	Everglades Re II Series A2 14/05/24, variabel	25 156 249	1,27	9 000 000	USD	Montoya Re 07/04/25, variabel	8 889 750	0,45
19 250 000	USD	Everglades Re II Series B1 14/05/24, variabel	15 881 249	0,80	30 000 000	USD	Mystic Re IV 08/01/24, variabel	29 812 499	1,51
12 500 000	USD	FloodSmart Re Series A 27/02/23, variabel	5 625 000	0,28	2 020 000	USD	Nakama Re 14/01/25, variabel	1 980 610	0,10
9 750 000	USD	FloodSmart Re Series B 27/02/23, variabel	1 462 500	0,07	30 250 000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	28 888 749	1,46
7 917 000	USD	Four Lakes Re 07/01/25, variabel	7 871 477	0,40	14 880 000	USD	Northshore Re II 07/07/23, variabel	14 861 400	0,75
11 950 000	USD	Galileo Re Series C 08/01/24, variabel	11 642 885	0,59	14962000	USD	Northshore Re II 08/01/24, variabel	14 490 697	0,73
9 400 000	USD	Galileo Re Series D 08/01/24, variabel	9 241 140	0,47	8 884 000	USD	Phoenician Re 14/12/23, variabel	8 772 950	0,44
2 400 000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	2 328 000	0,12	16 000 000	USD	Phoenician Re Series A 14/12/23, variabel	15 800 000	0,80
5 000 000	USD	Integrity Re 12/06/23, variabel	750 000	0,04	5 000 000	USD	Power Protective Re 15/12/23, variabel	4 912 500	0,25
7 750 000	USD	Integrity Re II 12/04/23, variabel	1 162 500	0,06	2 250 000	USD	Power Protective Re 09/10/24, variabel	2 190 938	0,11
					23 000 000	USD	Riverfront Re Series A 07/01/25, variabel	22 137 499	1,12
					5 750 000	USD	Riverfront Re Series B 07/01/25, variabel	5 563 125	0,28

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
6 601 509	USD	Sanders Re II 07/04/23, variabel	182 202	0,01
9 270 000	USD	Sanders Re II 07/06/23, variabel	8 574 750	0,43
9 625 000	USD	Sanders Re II 07/04/24, variabel	9 461 375	0,48
7 917 000	USD	Sanders Re II Series A 07/04/25, variabel	7 614 175	0,39
16 447 000	USD	Sanders Re II Series A1 07/04/25, variabel	15 797 344	0,80
7 750 000	USD	Sanders Re III Series A 07/06/25, variabel	7 701 563	0,39
8 250 000	USD	Sanders Re III Series B 07/06/25, variabel	4 950 000	0,25
11 050 000	USD	Sanders Re III Series A 07/04/26, variabel	10 859 388	0,55
8 750 000	USD	Sanders Re III Series B 07/04/26, variabel	8 500 625	0,43
11 250 000	USD	Sutter Re Series A 23/05/23, variabel	11 100 938	0,56
13 100 000	USD	Sutter Re Series F 23/05/23, variabel	12 926 425	0,65
5 256 000	USD	Tailwind Re Series A 08/01/25, variabel	5 045 760	0,26
8 958 000	USD	Tailwind Re Series B 08/01/25, variabel	8 543 693	0,43
5 152 000	USD	Tailwind Re Series C 08/01/25, variabel	4 913 720	0,25
250 000	USD	Tailwind Re Series D 08/01/25, variabel	238 438	0,01
9 500 000	USD	Titania Re 21/06/24, variabel	9 203 125	0,47
10 107 000	USD	Titania Re 27/12/24, variabel	9 538 481	0,48
3 750 000	USD	Tomoni Re Series A 07/04/26, variabel	3 661 875	0,19
6 750 000	USD	Tomoni Re Series B 07/04/26, variabel	6 566 063	0,33
1 384 000	USD	Voussoir Re 01/03/24, variabel	126 082	0,01
1 460 000	USD	Voussoir Re perpetual, variabel	134 685	0,01
3 500 000	USD	Wrigley Re 08/07/24, variabel	3 404 625	0,17
Hongkong			2 973 750	0,15
3 000 000	USD	Greater Bay Re 15/10/22, ZCP	2 973 750	0,15
Irland			20 100 502	1,02
9 856 000	EUR	Azzurro Re II DAC 17/01/24, variabel	9 514 482	0,48
10 966 000	EUR	Hexagon II Reinsurance DAC 17/01/24, variabel	10 586 020	0,54

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
Singapur			37 612 414	1,90
17 250 000	USD	Alamo Re II 08/06/23, variabel	17 142 188	0,86
9 783 000	USD	Easton Re 08/01/24, variabel	9 408 800	0,48
6 750 000	USD	Kizuna Re III 07/04/26, variabel	6 564 375	0,33
4 012 000	USD	Phoenix 1 Re 04/01/27, ZCP	4 497 051	0,23
Supranational			42 003 342	2,12
3 450 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 02/12/22, variabel	3 441 375	0,17
9 620 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 02/12/22, variabel	1 443 000	0,07
18 500 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 29/12/23, variabel	18 296 499	0,93
2 013 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 13/03/24, variabel	2 007 968	0,10
5 550 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 13/03/24, variabel	5 466 750	0,28
6 700 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series C 13/03/24, variabel	6 603 687	0,33
4 750 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series D 13/03/24, variabel	4 744 063	0,24
Vereinigtes Königreich			20 833 313	1,05
21 450 000	USD	Atlas Capital UK 2019 07/06/23, variabel	20 833 313	1,05
Summe Anleihen			757 105 290	38,30
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			821 029 578	41,53

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen					9 250 000	USD	Hestia Re 22/04/25, variabel	1 387 500	0,07
Bermuda					719 278 912			36,40	
7 308 000	USD	2001 Cat Re 08/01/24, variabel	7 241 497	0,37	6 864 000	USD	Hypatia Series A 07/06/23, variabel	6 743 880	0,34
39 726 000	USD	Alamo Re 07/06/24, variabel	37 670 179	1,91	2 379 000	USD	Hypatia Series B 07/06/23, variabel	2 337 368	0,12
4 250 000	USD	Alamo Re 07/06/25, variabel	4 132 063	0,21	6 750 000	USD	Integrity Re 06/06/25, variabel	1 012 500	0,05
2 450 000	USD	Artex 17/01/25, variabel	2 278 500	0,12	6 000 000	USD	Isosceles Insurance 10/07/23, variabel	5 940 000	0,30
19 855 000	USD	Bonanza Re 20/02/24, variabel	1 191 300	0,06	3 000 000	USD	Kendall Re 02/05/24, variabel	2 814 000	0,14
18 246 000	USD	Bonanza Re 23/12/24, variabel	8 210 700	0,42	7 857 000	USD	Kilimanjaro III Re 21/04/25, variabel	6 874 875	0,35
12 250 000	USD	Bonanza Re 16/03/25, variabel	11 943 750	0,60	24 844 000	USD	Kilimanjaro III Re 25/06/25, variabel	24 688 724	1,25
24 917 000	USD	Cape Lookout Re 22/03/24, variabel	24 181 948	1,22	7 500 000	USD	Matterhorn Re 08/01/24, variabel	6 668 250	0,34
10 000 000	USD	Cape Lookout Re 28/03/25, variabel	9 655 000	0,49	4 257 000	USD	Matterhorn Re 07/06/24, variabel	4 225 073	0,21
816 477	USD	Citrus Re 20/03/23, variabel	244 943	0,01	9 250 000	USD	Matterhorn Re 24/03/25, variabel	8 995 625	0,46
10 833 000	USD	Commonwealth Re 08/07/25, variabel	10 817 292	0,55	14 250 000	USD	Matterhorn Re 08/12/25, variabel	13 804 688	0,70
199	USD	Eden Re II 22/03/23, ZCP	1 834	-	7 600 000	USD	Matterhorn Re 25/01/27, variabel	7 296 000	0,37
1 637 314	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP	1 252 545	0,06	9 500 000	USD	Matterhorn Re Series A 24/03/25, variabel	9 143 750	0,46
3 419 200	USD	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP	2 612 268	0,13	13 118 000	USD	Matterhorn Re Series A 07/12/22, variabel	13 003 218	0,66
16 300 000	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	13 843 590	0,70	14 250 000	USD	Matterhorn Re Series B 07/12/22, variabel	14 196 563	0,72
11 000 000	USD	Everglades Re II 04/05/23, variabel	9 625 000	0,49	20 144 000	USD	Merna Reinsurance II 05/04/24, variabel	19 690 760	1,00
8 750 000	USD	Everglades Re II 19/05/25, variabel	7 656 250	0,39	12 000 000	USD	Merna Reinsurance II Series 2 07/07/25, variabel	7 200 000	0,36
31 404 000	USD	FloodSmart Re Series A 01/03/24, variabel	7 851 000	0,40	19 000 000	USD	Merna Reinsurance II Series 3 07/07/25, variabel	18 833 750	0,95
5 625 000	USD	FloodSmart Re Series B 01/03/24, variabel	562 500	0,03	6 000 000	USD	MetroCat Re 08/05/23, variabel	5 887 500	0,30
21 020 000	USD	FloodSmart Re Series A 25/02/25, variabel	9 459 000	0,48	23 750 000	USD	Mona Lisa Re 08/07/25, variabel	23 405 624	1,18
9 250 000	USD	FloodSmart Re Series B 25/02/25, variabel	1 850 000	0,09	9 750 000	USD	Mystic Re IV 08/01/25, variabel	9 445 313	0,48
2 250 000	USD	FloodSmart Re Series C 25/02/25, variabel	135 000	0,01	16 952 000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	16 152 713	0,82
4 520 000	USD	Frontline Re 06/07/26, variabel	2 938 000	0,15	34 150 000	USD	Nakama Re Series 1 13/04/23, variabel	33 791 424	1,71
4 000 000	USD	Golden State Re II 08/01/23, variabel	4 001 800	0,20	12 200 000	USD	Nakama Re Series 2 13/04/23, variabel	12 071 900	0,61
2 500 000	USD	Herbie Re 06/01/23, variabel	1 437 500	0,07	6 974 000	USD	Northshore Re II 08/07/25, variabel	6 902 517	0,35
7 000 000	USD	Herbie Re 08/07/24, variabel	6 370 000	0,32					
3 833 000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	3 353 875	0,17					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregeltten 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 geregeltten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
7 500 000	USD	Pelican IV Re Series A 07/05/24, variabel	4 125	-	4 000 000	USD	Residential Reinsurance 2019 Series 12 06/06/23, variabel	3 840 000	0,19
4 750 000	USD	Pelican IV Re Series B 07/05/24, variabel	24 225	-	2 250 000	USD	Residential Reinsurance 2019 Series 13 06/06/23, variabel	2 235 938	0,11
23 250 000	USD	Phoenician Re 14/12/24, variabel	22 197 937	1,12	6 154 000	USD	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variabel	6 046 305	0,31
19 872 000	USD	Sakura Re Series A 07/04/25, variabel	19 226 160	0,97	5 484 000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variabel	5 340 045	0,27
17 292 000	USD	Sakura Re Series B 07/04/25, variabel	16 781 886	0,85	5 000 000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variabel	4 918 750	0,25
2 750 000	USD	Sierra Series A 28/12/22, variabel	2 725 938	0,14	4 250 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 11 06/06/25, variabel	3 963 125	0,20
2 750 000	USD	Sierra Series B 28/12/22, variabel	2 725 938	0,14	5 535 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 12 06/06/25, variabel	5 233 343	0,26
14 500 000	USD	Sierra Series A 31/01/24, variabel	14 086 750	0,71	4 642 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 13 06/06/25, variabel	4 402 937	0,22
3 500 000	USD	Sierra Series B 31/01/24, variabel	3 400 250	0,17	6 500 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 14 06/06/25, variabel	6 191 250	0,31
3 750 000	USD	Topanga Re 08/01/26, variabel	3 591 563	0,18	14 416 667	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 2 06/12/25, variabel	13 605 728	0,69
20 000 000	USD	Torrey Pines Re Series A 07/06/24, variabel	19 230 000	0,97	4 310 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 3 06/12/25, variabel	4 089 113	0,21
19 250 000	USD	Torrey Pines Re Series B 07/06/24, variabel	18 701 375	0,95	6 300 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 13 06/06/26, variabel	6 191 325	0,31
9 500 000	USD	Torrey Pines Re Series A 06/06/25, variabel	9 241 125	0,47	2 950 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 14 06/06/26, variabel	2 899 113	0,15
5 000 000	USD	Torrey Pines Re Series B 06/06/25, variabel	4 863 750	0,25	5 250 000	USD	Vitality Re X Series A 10/01/23, variabel	5 242 388	0,27
22 982 000	USD	Ursa Re 10/12/22, variabel	22 562 578	1,14	4 750 000	USD	Vitality Re X Series B 10/01/23, variabel	4 729 813	0,24
41 725 000	USD	Ursa Re II Series AA 07/12/23, variabel	40 577 562	2,05	9 117 000	USD	Vitality Re XI Series A 09/01/24, variabel	8 942 409	0,45
11 500 000	USD	Ursa Re II Series D 07/12/23, variabel	11 057 250	0,56	3 500 000	USD	Vitality Re XI Series B 09/01/24, variabel	3 433 325	0,17
21 366 000	USD	Ursa Re II 06/12/24, variabel	20 415 213	1,03	12 044 000	USD	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variabel	11 806 131	0,60
9 000 000	USD	Ursa Re II Series A 16/06/25, variabel	8 754 750	0,44	6 000 000	USD	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variabel	5 916 900	0,30
6 250 000	USD	Ursa Re II Series E 16/06/25, variabel	6 079 688	0,31	8 148 000	USD	Vitality Re XIII Series A 06/01/26, variabel	7 997 669	0,40
Kaimaninseln			160 528 873	8,12	4 000 000	USD	Vitality Re XIII Series B 06/01/26, variabel	3 962 200	0,20
1 092 500	USD	Caelus Re V Series B 05/06/24, variabel	928 625	0,05					
6 600 000	USD	Caelus Re V Series C 05/06/24, variabel	660 000	0,03					
132 536	USD	Caelus Re V Series D 05/06/24, variabel	2 498	-					
6 850 000	USD	Caelus Re VI 07/06/23, variabel	6 647 925	0,34					
13 050 000	USD	Caelus Re VI 07/06/24, variabel	12 632 399	0,64					
11 975 000	USD	Residential Reinsurance 2018 06/12/22, variabel	11 828 306	0,60					
7 062 000	USD	Residential Reinsurance 2019 06/12/23, variabel	6 841 313	0,35					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Hongkong			6 477 665	0,33
6 558 000	USD	Black Kite Re 09/06/25, variabel	6 477 665	0,33
Irland			70 160 479	3,55
19 925 000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variabel	19 202 719	0,97
20 000 000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity 06/06/25, variabel	19 635 000	0,99
20 000 000	EUR	Lion III Re DAC 16/07/25, variabel	19 319 725	0,98
4 250 000	EUR	Orange Capital Re DAC 17/01/25, variabel	4 061 082	0,21
8 269 000	EUR	Windmill II Re DAC 05/07/24, variabel	7 941 953	0,40
Singapur			46 888 785	2,37
4 000 000	USD	Astro Re 08/07/25, variabel	240 000	0,01
9 250 000	USD	Catahoula II Re Series A 16/06/25, variabel	9 219 937	0,47
5 250 000	USD	Catahoula II Re Series B 16/06/25, variabel	5 238 188	0,26
6 000 000	USD	Catahoula Re 09/05/23, variabel	22 500	-
6 315 000	USD	Cosaint Re 03/04/24, variabel	947 250	0,05
11 466 000	USD	First Coast Re III 07/04/25, variabel	8 599 500	0,44
6 957 000	EUR	Hexagon III Re 15/01/26, variabel	5 284 111	0,27
5 000 000	EUR	Hexagon III Re Series CAT 15/01/26, variabel	4 630 736	0,23
3 000 000	USD	Phoenix 2 Re 04/01/28, ZCP	3 058 800	0,15
250 000	USD	Phoenix 2 Re Series 22-1 04/01/28, ZCP	273 325	0,01
5 000 000	USD	Umigame Re Series A1 07/04/25, variabel	4 863 750	0,25
2 750 000	USD	Umigame Re Series A2 07/04/25, variabel	2 675 063	0,14
1 875 000	USD	Umigame Re Series B1 07/04/25, variabel	1 835 625	0,09
Vereinigtes Königreich			28 939 313	1,46
29 750 000	USD	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variabel	28 939 313	1,46

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
Vereinigte Staaten			31 707 612	1,60
5 500 000	USD	Gateway Re 12/05/25, variabel	54 65 625	0,28
6 250 000	USD	Logistics Re 20/12/24, variabel	6 144 688	0,31
51 919	USD	Putnam Re 07/06/24, variabel	27 257	-
1 500 000	USD	Security First Managers 25/02/25, variabel	1 500 000	0,08
15 403 000	USD	Vista Re 21/05/24, variabel	14 979 417	0,75
3 750 000	USD	Vista Re 21/05/25, variabel	3 590 625	0,18
Summe Anleihen			1 063 981 639	53,83
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			1 063 981 639	53,83

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Bermuda			8 553 203	0,43
8 898 000	USD	Matterhorn Re 07/12/22, ZCP	8 553 203	0,43
Vereinigte Staaten			15 069 382	0,76
13 907 978	USD	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5,96%	13 351 659	0,67
2 400	USD	LionRock SideCar 2020- 1C perpetual, ZCP	-	-
2 174 333	USD	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP	1 717 723	0,09
Summe Anleihen			23 622 585	1,19
Summe sonstige Wertpapiere			23 622 585	1,19
Summe Kapitalanlagen			1 908 633 802	96,55
Sonstiges Nettovermögen			68 219 909	3,45
Nettoinventarwert			1 976 853 711	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Israel			4 630 704	2,11
24 600	USD	Nice	4 630 704	2,11
Vereinigte Staaten			126 450 181	57,60
73 892	USD	Alphabet	7 067 770	3,22
36 182	USD	Amazon.com	4 088 566	1,86
226 000	USD	Cargurus	3 202 420	1,46
855 986	USD	CCC Intelligent Solutions Holdings	7 789 473	3,55
103 304	USD	Comcast	3 029 906	1,38
98 999	USD	Fiserv	9 263 336	4,22
149 503	USD	Five9	11 209 735	5,11
13 128	USD	Intuit	5 084 737	2,32
221 816	USD	Marvell Technology	9 518 125	4,34
239 033	USD	Momentive Global	1 388 782	0,63
28 088	USD	Netflix	6 613 039	3,01
220 381	USD	New Relic	12 645 461	5,76
302 163	USD	News	4 565 683	2,08
103 017	USD	PayPal Holdings	8 866 673	4,04
122 243	USD	Pinterest	2 848 262	1,30
57 391	USD	Seagate Technology Holdings	3 054 923	1,39
59 400	USD	T-Mobile US	7 969 698	3,63
189 000	USD	Toast	3 160 080	1,44
131 712	USD	TripAdvisor	2 908 201	1,32
180 495	USD	Warner Music Group	4 189 289	1,91
83222	USD	Zendesk	6 333 194	2,88
57 771	USD	Zillow Group	1 652 828	0,75
Summe Aktien			131 080 885	59,71
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			131 080 885	59,71
Summe Kapitalanlagen			131 080 885	59,71
Sonstiges Nettovermögen			88 454 147	40,29
Nettoinventarwert			219 535 032	100,00

Schroder GAIA Egerton Equity

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Kanada			133 461 525	22,67
441 954	CAD	Canadian National Railway	48 700 756	8,27
770 971	CAD	Canadian Pacific Railway	52 512 668	8,92
1 107 926	CAD	Cenovus Energy	17 366 175	2,95
479 613	USD	Teck Resources	14 881 926	2,53
Frankreich			769 284	0,13
8 183	EUR	Safran	769 284	0,13
Norwegen			7 487 127	1,27
1 357 872	NOK	Norsk Hydro	7 487 127	1,27
Taiwan			8 687 928	1,48
124 192	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	8 687 928	1,48
Vereinigtes Königreich			11 074 082	1,88
40 258	USD	Linde	11 074 082	1,88
Vereinigte Staaten			351 884 605	59,79
390 203	USD	Alphabet	38 281 739	6,50
140 060	USD	Amazon.com	16 148 952	2,74
155 152	USD	Analog Devices	22 058 956	3,75
227 818	USD	Applied Materials	19 045 078	3,24
84 366	USD	Blackstone Mortgage Trust	2 009 186	0,34
7 966	USD	Booking Holdings	13 356 268	2,27
360 011	USD	Charles Schwab	26 400 684	4,49
687 719	USD	CSX	18 693 775	3,18
175 661	USD	DR Horton	12 071 597	2,05
29 248	USD	First Citizens BancShares	23 798 003	4,04
176 135	USD	KKR	7 727 978	1,31
98 617	USD	Lowe's	18 898 279	3,21
81 022	USD	LPL Financial Holdings	18 062 024	3,07
84 662	USD	Mastercard	24 562 821	4,17
177 780	USD	Microsoft	42 247 805	7,19
44 361	USD	UnitedHealth Group	22 860 139	3,88
141 567	USD	Visa	25 661 321	4,36
Summe Aktien			513 364 551	87,22
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			513 364 551	87,22
Summe Kapitalanlagen			513 364 551	87,22
Sonstiges Nettovermögen			75 233 221	12,78
Nettoinventarwert			588 597 772	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Helix

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Belgien				
30 098	EUR	Azelis Group	672 270	0,14
Brasilien				
			16 061 309	3,28
639 100	BRL	B3 - Brasil Bolsa Balcao	1 541 965	0,31
276 607	BRL	BR Malls Participacoes	482 247	0,10
126 023	BRL	CCR	291 942	0,06
1 287 800	BRL	Cia Brasileira de Aluminio	2 723 764	0,56
1 298 885	BRL	Itausa	2 336 569	0,48
337 973	BRL	Lojas Renner	1740212	0,35
279 100	BRL	Petroleo Brasileiro	1 537 698	0,31
548 600	BRL	Raia Drogasil	2 305 421	0,47
1 388 700	BRL	TIM	3 101 491	0,64
Kanada				
			373	-
256	CAD	Loop Energy	373	-
Chile				
			2 175 719	0,44
1 463 812	CLP	Aguas Andinas	287 189	0,06
291 732	CLP	Empresas Copec	1 888 530	0,38
China				
			37 645 057	7,68
168 200	HKD	Baozun	324 405	0,07
319 500	HKD	Budweiser Brewing	836 409	0,17
426 000	HKD	China Mengniu Dairy	1 690 455	0,34
48 300	CNH	China Tourism Group Duty Free	1 343 144	0,27
5 000	HKD	China Tourism Group Duty Free	125 670	0,03
43 098	CNH	Contemporary Amperex Technology	24 23 509	0,49
36 270	CNH	Foshan Haitian Flavouring & Food	421 352	0,09
52 310	CNH	Gongniu Group	1 030 916	0,21
6 552	USD	H World Group	219 754	0,04
304 490	CNH	Han's Laser Technology Industry Group	1 113 037	0,23
140 916	CNH	Hongfa Technology	688 456	0,14
486 975	CNH	Huafon Chemical	446 049	0,09
101 488	CNH	Jiangsu Hengli Hydraulic	644 590	0,13
190 320	CNH	Jiangsu Hengrui Medicine	937 031	0,19
7 544	USD	JinkoSolar Holding	417 862	0,09
7 000	CNH	Kweichow Moutai	1 838 578	0,37
643 112	CNH	LONGi Green Energy Technology	4 321 903	0,88
725 449	CNH	Midea Group	5 017 694	1,03
215 660	CNH	NARI Technology	752 329	0,15

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
33 285	CNH	Oppein Home Group	530 429	0,11
140 400	CNH	Ping An Insurance Group of China	818 868	0,17
822 400	CNH	Sany Heavy Industry	1 601 160	0,33
228 700	CNH	SF Holding	1 514 797	0,31
117 436	CNH	Shanghai Kelai Mechatronics Engineering	290 742	0,06
609 183	CNH	Shenzhen Inovance Technology	4 914 206	1,00
73 462	CNH	Thunder Software Technology	1 087 944	0,22
407 820	CNH	Toly Bread	763 681	0,16
46 800	CNH	Wanhua Chemical Group	604 599	0,12
14 300	CNH	Yunnan Energy New Material	349 258	0,07
80 290	CNH	Zhejiang Jiechang Linear Motion Technology	292 367	0,06
223 500	HKD	Zylox-Tonbridge Medical Technology	283 863	0,06
Ägypten				
			499 425	0,10
448 317	USD	Commercial International Bank Egypt	499 425	0,10
Georgien				
			807 917	0,16
43 390	GBP	TBC Bank Group	807 917	0,16
Deutschland				
			2 752 363	0,56
34 055	EUR	Dr Ing hc F Porsche	2 752 363	0,56
Griechenland				
			2 284 107	0,47
373 350	EUR	Alpha Services & Holdings	294 796	0,06
671 062	EUR	National Bank of Greece	1 989 311	0,41
Ungarn				
			2 000 637	0,41
116 757	HUF	Richter Gedeon	2 000 637	0,41
Indonesien				
			6 011 732	1,23
541 100	IDR	Bank Central Asia	303 819	0,06
8 053 600	IDR	Bank Mandiri Persero	4 984 743	1,02
3 247 300	IDR	Mitra Keluarga Karyasehat	618 432	0,13
357 600	IDR	Telkom Indonesia Persero	104 738	0,02
Italien				
			4 248 363	0,87
86 699	EUR	Ariston Holding	739781	0,15
67 344	EUR	FincoBank Banca Finco	840 173	0,17
1 418 143	EUR	Intesa Sanpaolo	2 365 672	0,49
10 433	EUR	Prysmian	302 737	0,06

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Kasachstan			1 888 024	0,39
161 612	USD	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	1 616 120	0,33
4 688	USD	Kaspi.KZ	271 904	0,06
Mexiko			670 830	0,14
61 626	USD	Banco Santander Mexico Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	314 293	0,06
37 849	USD	Vista Energy	356 537	0,08
Peru			137 030	0,03
6 831	USD	Intercorp Financial Services	137 030	0,03
Philippinen			3 511 812	0,72
893 020	PHP	Ayala Land	348 068	0,07
555 850	PHP	International Container Terminal Services	1 484 795	0,30
3 080 700	PHP	Wilcon Depot	1 678 949	0,35
Polen			2 235 839	0,46
3 081	PLN	Dino Polska	188 391	0,04
38 930	PLN	Grupa Pracuj	299 522	0,06
5 374	PLN	KRUK	256 786	0,05
76 698	PLN	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	359 653	0,07
28 382	PLN	Santander Bank Polska	1 131 487	0,24
Katar			1 824 670	0,37
1 620 730	QAR	Qatar Gas Transport	1 824 670	0,37
Russland			-	-
262 653	USD	Fix Price Group	-	-
62 454	USD	Softline Holding	-	-
Slowenien			2 324 158	0,47
228 119	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	2 324 158	0,47
Südafrika			1 481 842	0,30
17 149	ZAR	Capitec Bank Holdings	1 481 842	0,30
Südkorea			33 222 826	6,78
2 800	KRW	Hana Financial Group	69 379	0,01
11 165	KRW	Hyundai Motor	1 377 383	0,28
2 313	KRW	KB Financial Group	70 649	0,01
5 450	KRW	Korea Zinc	2 266 548	0,46
7 382	KRW	LG Chem	2 765 606	0,56
220	KRW	LG Chem - Preference	38 750	0,01
6 970	KRW	LG Energy Solution	2 077 798	0,42
2 593	KRW	LG H&H	1 147 249	0,23
95 415	KRW	LG Uplus	716 930	0,15

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
7 519	KRW	NAVER	1 016 933	0,21
400 719	KRW	Samsung Electronics	14 872 565	3,04
96 464	KRW	Samsung Electronics - Preference	3 162 201	0,65
19 348	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	2 488 315	0,51
2 506	KRW	Samsung SDI	956 368	0,20
1 644	KRW	SK Hynix	95 489	0,02
2 835	KRW	SK Telecom	100 663	0,02
Schweiz			1 456 688	0,30
234 018	ZAR	Mediclinic International	1 280 995	0,26
9 933	GBP	Wizz Air Holdings	175 693	0,04
Taiwan			49 740 270	10,13
144 792	TWD	Advantech	13 38 513	0,27
361 000	TWD	ASE Technology Holding	910 772	0,19
5 000	TWD	ASMedia Technology	104 570	0,02
234 000	TWD	Chroma ATE	1 326 656	0,27
118 000	TWD	CTBC Financial Holding	73 776	0,02
31 250	TWD	Dadi Early-Childhood Education Group	90 849	0,02
20 000	TWD	Delta Electronics	159 375	0,03
163 000	TWD	Eclat Textile	2 012 536	0,41
348 000	TWD	Getac Holdings	463 101	0,09
77 000	TWD	Giant Manufacturing	498 394	0,10
555 000	TWD	Hon Hai Precision Industry	1 783 048	0,36
210 000	TWD	MediaTek	3 644 524	0,74
182 000	TWD	Merida Industry	1 034 710	0,21
233 000	TWD	Nien Made Enterprise	1 845 712	0,38
125 000	TWD	Novatek Microelectronics	862 232	0,18
138 750	TWD	Sporton International	1 031 371	0,21
201 000	TWD	Taiwan Mobile	605 235	0,12
2 157 000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	28 670 320	5,85
55 000	TWD	Uni-President Enterprises	116 586	0,02
1 294 000	TWD	United Microelectronics	1 457 070	0,30
29 900	TWD	Universal Vision Biotechnology	266 048	0,05
32 650	TWD	Voltronic Power Technology	1 444 872	0,29
Thailand			3 511 749	0,72
429 300	THB	Kasikornbank	1 638 897	0,33
472 400	THB	Kasikornbank-XDR	1 803 436	0,38
294 200	THB	Land & Houses	69 416	0,01

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Vereinigte Arabische Emirate				
			7 118 528	1,45
4 623 063	AED	Emaar Development	5 777 177	1,17
240 689	AED	Emaar Properties	379 409	0,08
274 962	AED	Emirates NBD Bank	961 942	0,20
Vereinigtes Königreich				
			20 127 394	4,10
485 217	GBP	Beazley	3 054 892	0,61
313 078	GBP	Bytes Technology Group	1 467 155	0,30
67 338	EUR	CNH Industrial	767 204	0,16
1 133 322	GBP	Harworth Group	1 530 804	0,31
633 457	GBP	Inspecc Group	954 623	0,19
1 039 222	GBP	NatWest Group	2 620 628	0,53
361 349	GBP	OSB Group	1 695 784	0,35
219 480	PLN	Pepco Group	1 328 701	0,27
1 274 357	GBP	Premier Foods	1 355 704	0,28
393 119	GBP	Team17 Group	1 632 480	0,33
1 140 761	GBP	TT Electronics	1 792 992	0,37
437 457	GBP	Tyman	961 040	0,20
128 310	GBP	Watches of Switzerland Group	965 387	0,20
Vereinigte Staaten				
			356 287	0,07
632	USD	Mastercard	179 703	0,03
994	USD	Visa	176 584	0,04
Vietnam				
			1 437 820	0,29
474 600	VND	Vietnam Dairy Products	1 437 820	0,29
Summe Aktien				
			206 205 039	42,06
Anleihen				
Angola				
			392 058	0,08
340 000	USD	Angolan Government International Bond 26/11/29, 8,00%	256 736	0,05
200 000	USD	Angolan Government International Bond 26/11/49, 9,13%	135 322	0,03
Argentinien				
			176 906	0,04
423 000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/01/38, 3,88%	100 361	0,02
354 000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/41, 3,50%	76 545	0,02
Brasilien				
			1 337 329	0,26
3 136 000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10,00%	548 481	0,11

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
4 590 000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/31, 10,00%	788 848	0,15
Burkina Faso				
			303 544	0,06
380 000	USD	Endeavour Mining 14/10/26, 5,00%	303 544	0,06
China				
			108 025	0,02
290 000	USD	Country Garden Holdings 08/04/26, 7,25%	108 025	0,02
Tschechische Republik				
			193 248	0,04
8 490 000	CZK	Czech Republic Government Bond 24/04/40, 1,50%	193 248	0,04
Ecuador				
			277 440	0,06
630 319	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/35, 2,50%	209 015	0,05
230 000	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/40, 1,50%	68 425	0,01
El Salvador				
			92 627	0,02
250 000	USD	El Salvador Government International Bond 28/02/29, 8,63%	92 627	0,02
Elfenbeinküste				
			426 690	0,09
470 000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5,88%	334 352	0,07
140 000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 30/01/32, 4,88%	92 338	0,02
Mexiko				
			1 067 004	0,21
4 300 000	MXN	Mexican Bonos 18/11/38, 8,50%	193 073	0,04
3 310 000	MXN	Mexican Bonos 18/11/42, 7,75%	136 678	0,03
8 870 000	MXN	Mexican Bonos 12/11/47, 8,00%	372 319	0,07
3 800 000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/09/24, 7,19%	171 147	0,03
4 600 000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/11/26, 7,47%	193 787	0,04
Nigeria				
			251 433	0,05
350 000	USD	Nigeria Government International Bond 24/03/29, 8,38%	251 433	0,05
Peru				
			319 863	0,07
1 540 000	PEN	Peru Government Bond 12/08/32, 6,15%	319 863	0,07

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Polen				
1 350 000	PLN	Republic of Poland Government Bond 25/10/30, 1,25%	176 766	0,04
1 500 000	PLN	Republic of Poland Government Bond 25/04/32, 1,75%	193 202	0,04
Russland				
38 000 000	RUB	Russian Federal Bond - OFZ 23/03/33, 7,70%	170 961	0,03
Senegal				
320 000	EUR	Senegal Government International Bond 08/06/37, 5,38%	189 428	0,04
Singapur				
370 000	USD	Puma International Financing 24/01/26, 5,00%	326 328	0,07
Südafrika				
6 690 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8,88%	304 563	0,06
4 819 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/40, 9,00%	211 569	0,04
Türkei				
470 000	USD	Pegasus Hava Tasimaciligi 30/04/26, 9,25%	431 836	0,09
Ukraine				
3 000 000	UAH	Ukraine Government Bond 22/05/24, 9,99%	47 256	0,01
6 460 000	UAH	Ukraine Government Bond 26/02/25, 15,84%	106 980	0,02
8 190 000	UAH	Ukraine Government Bond 26/05/27, 9,79%	88 789	0,02
330 000	USD	VF Ukraine PAT via VFU Funding 11/02/25, 6,20%	179 091	0,04
Summe Anleihen			7 372 936	1,50
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			213 577 975	43,56

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Brasilien				
250 000	USD	MC Brazil Downstream Trading 30/06/31, 7,25%	188 533	0,04

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
Chile				
450 000	USD	Kenbourne Invest 22/01/28, 4,70%	342 920	0,07
Vereinigtes Königreich				
525 000	USD	Petrofac 15/11/26, 9,75%	404 759	0,08
Vereinigte Staaten				
20 000 000	USD	United States Treasury Bill 06/10/22, ZCP	19 993 748	4,09
20 000 000	USD	United States Treasury Bill 13/10/22, ZCP	19 984 997	4,08
20 000 000	USD	United States Treasury Bill 20/10/22, ZCP	19 976 171	4,07
20 000 000	USD	United States Treasury Bill 27/10/22, ZCP	19 967 421	4,07
5 000 000	USD	United States Treasury Bill 03/11/22, ZCP	4 988 833	1,02
10 000 000	USD	United States Treasury Bill 10/11/22, ZCP	9 971 822	2,03
20 000 000	USD	United States Treasury Bill 17/11/22, ZCP	19 931 119	4,06
20 000 000	USD	United States Treasury Bill 08/12/22, ZCP	19 884 060	4,05
20 000 000	USD	United States Treasury Bill 12/01/23, ZCP	19 814 371	4,04
15 000 000	USD	United States Treasury Bill 19/01/23, ZCP	14 847 352	3,03
Summe Anleihen			170 296 106	34,73
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			170 296 106	34,73

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Luxemburg				
45 213	USD	Schroder ISF - China A	6 157 648	1,26
33 994	USD	Schroder ISF Indian Equity	11 263 807	2,29
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen			17 421 455	3,55
Summe Kapitalanlagen			401 295 536	81,84
Sonstiges Nettovermögen			89 068 179	18,16
Nettoinventarwert			490 363 715	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Argentinien				
80 000	USD	Gennea 02/09/27, 8,75%	73 999	0,16
250 000	USD	Transportadora de Gas del Sur 02/05/25, 6,75%	214 911	0,45
775 000	USD	YPF 27/06/29, 8,50%	468 117	0,99
250 000	USD	YPF Energia Electrica 25/07/26, 10,00%	200 379	0,42
Belgien				
100 000	EUR	Telenet Finance Luxembourg Notes 01/03/28, 3,50%	82 319	0,17
Kanada				
100 000	EUR	Primo Water Holdings 31/10/28, 3,88%	79 572	0,17
China				
200 000	USD	Shimao Group Holdings 15/07/26, 5,60%	25 314	0,05
200 000	USD	Shimao Group Holdings 13/07/30, 4,60%	24 435	0,05
200 000	USD	Sino-Ocean Land Treasure IV 05/05/26, 3,25%	61 313	0,13
Frankreich				
13 425	EUR	Accor 07/12/27, 0,70%	9 631	0,02
100 000	EUR	Afflelou 19/05/26, 4,25%	86 244	0,18
100 000	EUR	Altice France 15/07/29, 4,00%	74 507	0,16
100 000	EUR	Banijay Entertainment 01/03/25, 3,50%	91 150	0,19
110 000	EUR	CAB Selas 01/02/28, 3,38%	82 770	0,17
100 000	EUR	Chrome Bidco 31/05/28, 3,50%	78 085	0,16
100 000	EUR	Iliad Holding 15/10/28, 5,63%	84 347	0,18
100 000	EUR	Loxam 15/07/26, 3,75%	83 270	0,18
110 000	EUR	Parts Europe 16/07/25, 6,50%	107 860	0,23
27 591	EUR	Worldline 30/07/25, ZCP	23 673	0,05
Deutschland				
100 000	EUR	Gruenthal 15/05/28, 4,13%	81 744	0,17
100 000	EUR	Nidda BondCo 30/09/25, 5,00%	85 892	0,18
100 000	EUR	Renk 15/07/25, 5,75%	90 023	0,19
Indien				
200 000	USD	Vedanta Resources Finance II 21/01/24, 13,88%	167 448	0,35

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
200 000	USD	Vedanta Resources Finance II 11/03/25, 8,95%	136 355	0,29
Irland				
100 000	EUR	eircom Finance DAC 15/02/27, 2,63%	83 108	0,18
100 000	EUR	Rockford Tower Europe CLO DAC 20/04/34, variabel	78 166	0,16
Italien				
100 000	EUR	Castor 15/02/29, variabel	89 763	0,19
100 000	EUR	Centurion Bidco 30/09/26, 5,88%	86 303	0,18
100 000	EUR	Gamma Bidco 15/07/25, 5,13%	88 464	0,19
100 000	EUR	Mooney Group 17/12/26, variabel	92 883	0,20
110 000	EUR	TeamSystem 15/02/28, 3,50%	89 450	0,19
100 000	EUR	Telecom Italia 11/04/24, 4,00%	94 962	0,19
Luxemburg				
100 000	EUR	Altice Financing 15/01/28, 3,00%	74 086	0,16
100 000	EUR	Matterhorn Telecom 15/11/27, 4,00%	86 146	0,17
100 000	EUR	Summer BC Holdco B 31/10/26, 5,75%	83 805	0,18
Niederlande				
100 000	EUR	Lincoln Financing 01/04/24, 3,63%	95 006	0,20
110 000	EUR	Q-Park Holding I 01/03/26, variabel	93 966	0,20
110 000	EUR	TMNL Holding 15/01/29, 3,75%	86 511	0,18
100 000	EUR	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 3,75%	88 572	0,19
175 000	USD	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 5,50%	156 755	0,33
100 000	EUR	UPC Holding 15/06/29, 3,88%	77 241	0,16
100 000	EUR	Ziggo Bond 28/02/30, 3,38%	68 275	0,14
Spanien				
139 000	USD	Banco Santander 18/08/25, 5,15%	134 976	0,28
100 000	EUR	Cirsa Finance International 15/03/27, 4,50%	78 655	0,17
100 000	EUR	Grifols Escrow Issuer 15/10/28, 3,88%	72 773	0,15
110 000	EUR	Lorca Telecom Bondco 18/09/27, 4,00%	94 104	0,20
100 000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	77 904	0,16

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (cont)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Schweden			125 905	0,26
100 000	EUR	Samhallsbyggnadsbola- get i Norden perpetual, variabel	41 339	0,09
100 000	EUR	Verisure Holding 15/07/26, 3,88%	84 566	0,17
Vereinigtes Königreich			736 959	1,55
100 000	GBP	AA Bond 31/01/26, 6,50%	94 348	0,20
100 000	EUR	EG Global Finance 30/10/25, 6,25%	85 369	0,18
100 000	GBP	Hurricane Finance 15/10/25, 8,00%	106 819	0,22
100 000	EUR	Motion Finco 15/05/25, 7,00%	97 246	0,20
100 000	GBP	Pinewood Finance 15/11/27, 3,63%	90 305	0,19
100 000	GBP	Premier Foods Finance 15/10/26, 3,50%	89 517	0,19
100 000	GBP	Thames Water Kemble Finance 19/05/26, 4,63%	93 215	0,20
110 000	EUR	Vodafone Group 27/08/80, variabel	80 140	0,17
Vereinigte Staaten			2 702 131	5,70
162 000	USD	American Tower 15/03/25, 2,40%	150 600	0,32
110 000	EUR	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 2,13%	83 165	0,18
125 000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/27, 5,25%	77 792	0,16
100 000	EUR	Avantor Funding 15/07/28, 3,88%	84 998	0,18
155 000	USD	Boeing 01/05/25, 4,88%	151 576	0,32
150 000	USD	Celanese US Holdings 05/07/24, 5,90%	148 074	0,31
13 000	USD	Cloudflare 15/08/26, ZCP	10 166	0,02
100 000	EUR	Dana Financing Luxembourg 15/07/29, 3,00%	71 094	0,15
100 000	EUR	Energizer Gamma Acquisition 30/06/29, 3,50%	70 490	0,15
161 000	USD	Energy Transfer 15/03/25, 4,05%	154 547	0,33
100 000	USD	Ford Motor Credit 17/11/23, 3,37%	96 872	0,20
153 000	USD	General Motors Financial 07/04/25, 3,80%	145 784	0,31
156 000	USD	HCA 15/03/24, 5,00%	155 066	0,33
85 000	USD	MGIC Investment 15/08/28, 5,25%	76 112	0,16
55 000	USD	Oceaneering International 01/02/28, 6,00%	43 701	0,09

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
263 000	USD	Olin 01/08/29, 5,63%	233 951	0,50
165 000	USD	Oracle 01/04/25, 2,50%	153 916	0,32
110 000	EUR	Silgan Holdings 01/06/28, 2,25%	86 854	0,18
110 000	EUR	Standard Industries 21/11/26, 2,25%	85 136	0,18
171 000	USD	Synchrony Bank 22/08/25, 5,40%	166 901	0,35
260 000	USD	TransDigm 15/11/27, 5,50%	226 712	0,48
87 000	USD	VMware 15/05/25, 4,50%	85 081	0,18
149 000	USD	Zimmer Biomet Holdings 01/04/25, 3,55%	143 543	0,30
Summe Anleihen			8 150 227	17,15
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			8 150 227	17,15

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Argentinien			503 942	1,06
150 000	USD	Pampa Energia 15/04/29, 9,13%	126 203	0,27
400 000	USD	Telecom Argentina 06/08/25, 8,50%	377 739	0,79
Australien			1 086 983	2,29
125 000	USD	Mineral Resources 01/05/30, 8,50%	121 074	0,25
262 000	AUD	Ruby Bond Trust 12/03/53, variabel	161 806	0,34
272 000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2021-1 12/03/53, variabel	168 261	0,35
500 000	AUD	Ruby Bond Trust 14/01/54, variabel	317 977	0,68
500 000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2022-1 14/01/54, variabel	317 865	0,67
Bermuda			756 701	1,59
400 000	USD	Eagle Re 25/11/28, variabel	395 435	0,83
400 000	USD	Home Re 25/01/34, variabel	361 266	0,76
Brasilien			123 613	0,26
200 000	USD	Azul Investments 15/06/26, 7,25%	123 613	0,26
Kanada			1 276 320	2,69
78 000	USD	Bank of Montreal 14/09/24, 4,25%	76 841	0,16

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (cont)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
125 000	USD	Bombardier 15/06/26, 7,13%	114 823	0,24	Irland				
50 000	USD	Bombardier 15/03/25, 7,50%	49 094	0,10	375 000	EUR	Ares European CLO XII DAC 20/04/32, variabel	305 282	0,64
80 000	USD	Canadian Imperial Bank of Commerce 04/08/25, 3,95%	77 325	0,16	321 530	EUR	Arrow CMBS 2018 DAC 22/05/30, variabel	307 426	0,65
300 000	USD	Cascades 15/01/28, 5,38%	254 401	0,54	750 000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 15/04/32, variabel	622 241	1,30
180 000	USD	Federation des Caisses Desjardins du Quebec 23/08/25, 4,40%	174 221	0,37	750 000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 19/10/34, variabel	609 301	1,27
105 000	USD	GFL Environmental 01/08/28, 4,00%	88 149	0,19	250 000	EUR	BBAM European CLO I DAC 22/07/34, variabel	193 530	0,41
200 000	USD	Intelligent Packaging 15/09/28, 6,00%	159 558	0,34	300 000	EUR	Bluemountain Fuji Eur CLO IV DAC 25/02/34, variabel	231 993	0,49
130 000	USD	Precision Drilling 15/01/26, 7,13%	122 119	0,26	104 000	EUR	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	93 409	0,20
19 000	USD	Shopify 01/11/25, 0,13%	15 628	0,03	100 000	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	102 618	0,22
100 000	USD	Strathcona Resources 01/08/26, 6,88%	84 995	0,18	109 000	GBP	Frost CMBS DAC* 20/11/33, variabel	109 101	0,23
60 000	USD	Toronto-Dominion Bank 13/09/24, 4,29%	59 166	0,12	375 000	EUR	Goldentree Loan Management CLO 4 DAC 20/07/34, variabel	294 689	0,62
Kaimaninseln			3 353 402	7,06	177 206	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 17/08/33, variabel	157 401	0,33
250 000	USD	ACAM 17/11/34, variabel	236 088	0,50	558 497	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance Series 1A 17/08/33, variabel	502 198	1,06
250 000	USD	ACAM Series 2019-FL1 17/11/34, variabel	241 828	0,51	375 000	EUR	Palmer Square European CLO DAC 15/04/35, variabel	289 086	0,61
375 000	USD	ICG US CLO 16/01/33, variabel	301 643	0,63	375 000	EUR	Segovia European CLO 20/07/32, 3,40%, variabel	322 626	0,68
375 000	USD	Marble Point CLO XV 23/07/32, variabel	302 845	0,64	250 000	EUR	St Paul's CLO VII DAC 18/07/34, variabel	208 972	0,44
250 000	USD	MP CLO VIII 28/04/34, variabel	220 565	0,46	399 359	GBP	Taurus UK DAC 17/11/29, variabel	426 100	0,90
250 000	USD	Ocean Trails CLO XI 20/07/34, variabel	202 258	0,43	310 000	GBP	Taurus UK DAC 17/05/30, variabel	314 421	0,66
250 000	USD	Ocean Trails CLO XI Series 2021-11A 20/07/34, variabel	217 900	0,46	281 517	GBP	Taurus UK DAC 17/08/31, variabel	285 448	0,60
375 000	USD	Trinitas CLO XVI 20/07/34, variabel	341 334	0,72	375 000	EUR	Vendome Funding CLO DAC 20/07/34, variabel	273 886	0,58
1 000 000	USD	Trinitas CLO XVIII 20/01/35, variabel	906 264	1,90	Israel				
400 000	USD	TRTX Issuer 15/03/38, variabel	382 677	0,81	18 000	USD	Wix.com 15/08/25, ZCP	15 147	0,03
Frankreich			38 218	0,08	Japan				
40 000	USD	Credit Agricole 04/10/24, 3,25%	38 218	0,08	4 200 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 11/10/22, ZCP	29 021	0,06
Deutschland			116 587	0,25	7 600 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 24/10/22, ZCP	52 518	0,11
Hongkong			115 869	0,24					
150 000	USD	Seaspan 01/08/29, 5,50%	115 869	0,24					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (cont)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
82 350 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 07/11/22, ZCP	569 077	1,20	50 000	USD	Bausch Health 01/02/27, 6,13%	34 740	0,07
Luxemburg			106 187	0,22	55 000	USD	Bausch Health 01/06/28, 4,88%	35 551	0,07
130 000	USD	ION Trading Technologies 15/05/28, 5,75%	106 187	0,22	335 000	USD	BellRing Brands 15/03/30, 7,00%	307 145	0,65
Mexiko			134 500	0,28	30 000	USD	Bentley Systems 01/07/27, 0,38%	22 755	0,05
200 000	USD	Braskem Idesa 20/02/32, 6,99%	134 500	0,28	329 988	USD	Blackbird Capital Aircraft 15/07/46, 2,44%	267 074	0,56
Singapur			29 993	0,06	16 000	USD	Blackline 15/03/26, ZCP	13 024	0,03
43 000	USD	Sea 15/09/26, 0,25%	29 993	0,06	370 000	USD	Bloomin' Brands 15/04/29, 5,13%	308 806	0,65
Vereinigtes Königreich			83 692	0,18	250 000	USD	BRSP 19/08/38, variabel	233 191	0,49
100 000	GBP	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 15/07/28, 4,88%	83 692	0,18	180 000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/28, 5,63%	144 226	0,30
Vereinigte Staaten			20 268 111	42,66	280 000	USD	Calpine 01/02/29, 4,63%	228 705	0,48
195 000	USD	Academy 15/11/27, 6,00%	177 245	0,37	165 000	USD	Carnival 01/03/27, 5,75%	115 867	0,24
125 000	USD	Acadia Healthcare 01/07/28, 5,50%	114 445	0,24	20 000	USD	Carnival 01/06/30, 10,50%	16 735	0,04
65 000	USD	Acadia Healthcare 15/04/29, 5,00%	57 687	0,12	200 000	USD	CCO Holdings 01/09/29, 6,38%	183 988	0,39
170 000	USD	Ahead DB Holdings 01/05/28, 6,63%	145 238	0,31	23 000	USD	Ceridian HCM Holding 15/03/26, 0,25%	18 665	0,04
13 000	USD	Airbnb 15/03/26, ZCP	10 829	0,02	207 000	USD	Charles Schwab 13/05/26, variabel	201055	0,42
33 000	USD	Alarm.com Holdings 15/01/26, ZCP	27 143	0,06	80 000	USD	Citgo Holding 01/08/24, 9,25%	79 526	0,17
310 000	USD	Albertsons 15/02/28, 5,88%	286 620	0,60	330 000	USD	CITGO Petroleum 15/06/25, 7,00%	315 855	0,66
35 000	USD	Albertsons 15/02/30, 4,88%	29 658	0,06	160 000	USD	Citigroup 01/06/24, variabel	160 223	0,34
50 000	USD	Allied Universal 01/06/28, 4,63%	38 603	0,08	220 000	USD	Cogent Communications Group 15/06/27, 7,00%	207 668	0,44
280 000	USD	Allied Universal Finance 15/07/26, 6,63%	250 060	0,53	125 000	USD	Colgate Energy Partners III 15/02/26, 7,75%	122 925	0,26
30 000	USD	American Airlines 15/07/25, 11,75%	31 378	0,07	45 000	USD	CommScope 01/07/28, 7,13%	34 833	0,07
125 000	USD	APX Group 15/02/27, 6,75%	116 929	0,25	170 000	USD	CommScope 01/09/29, 4,75%	138 984	0,29
250 000	USD	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 15/05/36, variabel	234 198	0,49	145 000	USD	CommScope Technologies 15/06/25, 6,00%	129 040	0,27
185 000	USD	Arconic 15/02/28, 6,13%	163 830	0,34	145 000	USD	Community Health Systems 15/03/27, 5,63%	111 827	0,24
80 000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 4,13%	66 095	0,14	30 000	USD	Community Health Systems 15/01/29, 6,00%	22 112	0,05
103 000	USD	AREIT Trust 14/09/36, variabel	97 351	0,20	370 000	USD	Compass Group Diversified Holdings 15/04/29, 5,25%	290 863	0,61
205 000	USD	ASP Unifrax Holdings 30/09/28, 5,25%	156 268	0,33	35 000	USD	Comstock Resources 15/01/30, 5,88%	30 567	0,06
170 000	USD	AssuredPartners 15/01/29, 5,63%	132 343	0,28					
29 000	USD	Beauty Health 01/10/26, 1,25%	23 490	0,05					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (cont)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregeltten 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 geregeltten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
280 000	USD	Consolidated Communications 01/10/28, 6,50%	210 062	0,44	500 000	USD	FS Rialto Issuer 17/08/37, variabel	493 651	1,05
335 000	USD	Coty 15/04/26, 6,50%	306 888	0,65	90 000	USD	General Motors Financial 08/03/24, variabel	88 767	0,19
19 000	USD	Coupa Software 15/06/26, 0,38%	14 697	0,03	40 000	USD	Goldman Sachs Group 29/09/25, variabel	38 134	0,08
45 000	USD	Crocs 15/03/29, 4,25%	35 864	0,08	135 000	USD	Graham Packaging 15/08/28, 7,13%	108 699	0,23
185 000	USD	CSC Holdings 01/02/28, 5,38%	161 968	0,34	230 000	USD	Gray Television 15/10/30, 4,75%	172 711	0,36
322 000	USD	Cushman & Wakefield US Borrower 15/05/28, 6,75%	299 386	0,63	40 000	USD	Harley-Davidson Financial Services 08/06/25, 3,35%	37 529	0,08
105 000	USD	CVR Energy 15/02/25, 5,25%	94 708	0,20	200 000	USD	HAT Holdings I 15/04/25, 6,00%	188 130	0,40
161 000	USD	Delta Air Lines 20/10/25, 4,50%	156 386	0,33	285 000	USD	Hawaiian Brand Intellectual Property 20/01/26, 5,75%	251 796	0,53
41 000	USD	DigitalOcean Holdings 01/12/26, ZCP	29 930	0,06	170 000	USD	Hess Midstream Operations 15/06/28, 5,13%	149 095	0,31
350 000	USD	Directv Financing 15/08/27, 5,88%	302 531	0,64	290 000	USD	Hunt 15/04/29, 5,25%	222 418	0,47
115 000	USD	DISH DBS 01/12/26, 5,25%	94 384	0,20	25 000	USD	iHeartCommunications 01/05/27, 8,38%	21 148	0,04
50 000	USD	DISH DBS 01/12/28, 5,75%	37 772	0,08	300 000	USD	iHeartCommunications 15/08/27, 5,25%	257 074	0,54
33 000	USD	DocuSign 15/01/24, ZCP	30 954	0,07	26 000	USD	Illumina 15/08/23, ZCP	24 961	0,05
17 000	USD	Dropbox 01/03/26, ZCP	14 867	0,03	21 000	USD	Ionis Pharmaceuticals 15/12/24, 0,13%	19 096	0,04
85 000	USD	Edgewell Personal Care 01/04/29, 4,13%	70 723	0,15	185 000	USD	Iron Mountain 15/03/28, 5,25%	162 535	0,34
20 000	USD	Envestnet 15/08/25, 0,75%	16 825	0,04	25 000	USD	Iron Mountain 15/07/28, 5,00%	21 551	0,05
32 000	USD	Etsy 15/06/28, 0,25%	24 912	0,05	305 000	USD	JB Poindexter 15/04/26, 7,13%	282 445	0,59
45 000	USD	EverArc Escrow 30/10/29, 5,00%	36 317	0,08	15 000	USD	JetBlue Airways 01/04/26, 0,50%	10 725	0,02
90 000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/30, 6,75%	68 634	0,14	145 000	USD	LABL 01/11/28, 5,88%	117 707	0,25
345 000	USD	FirstCash 01/01/30, 5,63%	295 298	0,62	245 000	USD	Legends Hospitality Holding 01/02/26, 5,00%	211 068	0,44
400 000	USD	FMC GMSR Issuer Trust 25/07/26, variabel	318 113	0,67	375 000	USD	Level 3 Financing 01/07/28, 4,25%	293 494	0,62
95 000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/08/27, 9,75%	93 095	0,20	26 000	USD	Liberty Broadband 30/09/50, 2,75%	24 992	0,05
195 000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/05/28, 5,50%	156 276	0,33	280 000	USD	Medline Borrower 01/10/29, 5,25%	212 086	0,45
160 000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/28, 5,00%	137 579	0,29	295 000	USD	Minerals Technologies 01/07/28, 5,00%	257 413	0,54
170 000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/29, 6,75%	140 640	0,30	157 000	USD	Mondelez International Holdings Netherlands 15/09/25, 4,25%	153 794	0,32
					55 000	USD	MPH Acquisition Holdings 01/09/28, 5,50%	45 713	0,10

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (cont)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregeltten 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 geregeltten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
341 500	USD	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 15/03/35, variabel	326 880	0,69	64 000	USD	Snap 01/03/28, 0,13%	43 200	0,09
25 000	USD	NCR 01/10/28, 5,00%	19 726	0,04	300 000	USD	Spirit AeroSystems 15/04/25, 7,50%	283 085	0,60
160 000	USD	NCR 01/09/29, 6,13%	138 036	0,29	32 000	USD	Splunk 15/06/27, 1,13%	25 337	0,05
180 000	USD	Necessity Retail Real Estate Investment Trust 30/09/28, 4,50%	134 541	0,28	53 000	USD	Spotify USA 15/03/26, ZCP	41 870	0,09
85 000	USD	Nexstar Media 15/07/27, 5,63%	78 317	0,16	100 000	USD	Sprint 15/09/23, 7,88%	101 369	0,21
50 000	USD	Nexstar Media 01/11/28, 4,75%	42 865	0,09	55 000	USD	Standard Industries 15/01/28, 4,75%	46 599	0,10
145 000	USD	NFP 15/08/28, 4,88%	123 923	0,26	90 000	USD	Standard Industries 15/07/30, 4,38%	69 067	0,15
24 000	USD	Nutanix 01/10/27, 0,25%	18 168	0,04	160 000	USD	Suburban Propane Partners 01/06/31, 5,00%	130 997	0,28
17 000	USD	NuVasive 15/03/25, 0,38%	14 864	0,03	25 000	USD	Tenet Healthcare 01/02/27, 6,25%	23 387	0,05
30 000	USD	Okta 15/06/26, 0,38%	23 445	0,05	235 000	USD	Tenet Healthcare 01/10/28, 6,13%	206 162	0,43
150 000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/28, 4,25%	115 546	0,24	167 000	USD	T-Mobile USA 15/02/26, 2,25%	149 662	0,31
10 000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/29, 6,25%	6 870	0,01	95 000	USD	TMS International 15/04/29, 6,25%	67 621	0,14
330 000	USD	Pediatrix Medical Group 15/02/30, 5,38%	273 933	0,58	40 000	USD	Tronox 15/03/29, 4,63%	29 684	0,06
40 000	USD	Penske Truck Leasing 15/07/25, 4,00%	38 167	0,08	110 000	USD	Uber Technologies 15/01/28, 6,25%	102 449	0,22
30 000	USD	Perficient 15/11/26, 0,13%	22 350	0,05	44 000	USD	Unity Software 15/11/26, ZCP	32 065	0,07
205 000	USD	Performance Food Group 15/10/27, 5,50%	186 796	0,39	180 000	USD	Univision Communications 01/06/27, 6,63%	170 271	0,36
175 000	USD	Picard Midco 31/03/29, 6,50%	148 960	0,31	80 000	USD	US Foods 01/06/30, 4,63%	66 782	0,14
260 000	USD	Pike 01/09/28, 5,50%	210 933	0,44	394 699	USD	Verus Securitization Trust 25/08/67, variabel	381 895	0,80
200 000	USD	Post Holdings 15/01/28, 5,63%	182 914	0,38	400 000	USD	Verus Securitization Trust 25/08/67, variabel	354 984	0,75
350 000	USD	Prime Security Services Borrower 15/01/28, 6,25%	299 560	0,63	14 000	USD	Vishay Intertechnology 15/06/25, 2,25%	13 047	0,03
293 416	USD	PRPM 25/06/26, variabel	252 344	0,53	370 000	USD	VM Consolidated 15/04/29, 5,50%	318 875	0,67
200 000	USD	PRPM 25/09/26, variabel	180 794	0,38	189 000	USD	VMC Finance 16/06/36, variabel	180 215	0,38
85 000	USD	Rocket Mortgage 15/10/26, 2,88%	69 829	0,15	455 000	USD	VMC Finance Series 2021-FL4 16/06/36, variabel	435 256	0,93
155 000	USD	Sabine Pass Liquefaction 01/03/25, 5,63%	155 035	0,33	160 000	USD	Warnermedia Holdings 15/03/25, 3,64%	151 689	0,32
165 000	USD	SEG Holding 15/10/28, 5,63%	152 249	0,32	205 000	USD	Wash Multifamily Acquisition 15/04/26, 5,75%	189 304	0,40
28 000	USD	Shake Shack 01/03/28, ZCP	18 848	0,04					
17 000	USD	Shift4 Payments 01/08/27, 0,50%	13 058	0,03					
60 000	USD	Simmons Foods 01/03/29, 4,63%	49 186	0,10					
85 000	USD	Six Flags Entertainment 15/04/27, 5,50%	75 692	0,16					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (cont)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
200 000	USD	Watco 15/06/27, 6,50%	182 315	0,38
57 000	USD	Western Digital 01/02/24, 1,50%	54 264	0,11
115 000	USD	Xerox Holdings 15/08/28, 5,50%	91 930	0,19
Summe Anleihen			34 309 609	72,21
TBA-Wertpapiere				
Vereinigte Staaten			600 352	1,26
217 000	USD	Fannie Mae or Freddie Mac 01/10/37, 4,00%	209 829	0,44
199 000	USD	Fannie Mae or Freddie Mac 01/10/37, 4,50%	195 471	0,41
196 000	USD	Fannie Mae or Freddie Mac 01/10/52, 5,50%	195 052	0,41
Summe TBA-Wertpapiere			600 352	1,26
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			34 909 961	73,47

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Kaimaninseln			645 028	1,36
798 822	USD	Horizon Aircraft Finance I 15/12/38, 4,46%	645 028	1,36
Irland			997 108	2,09
500 000	EUR	Dryden 27 R Euro CLO DAC 15/04/33, variabel	391 325	0,82
250 000	EUR	ICG Euro CLO DAC 15/05/35, variabel	192 594	0,41
500 000	EUR	ICG Euro CLO DAC Series 2022-1A 15/05/35, variabel	413 189	0,86
Vereinigte Staaten			735 000	1,55
750 000	USD	Voya CLO 20/10/34, variabel	735 000	1,55
Summe Anleihen			2 377 136	5,00
Summe sonstige Wertpapiere			2 377 136	5,00
Summe Kapitalanlagen			45 437 324	95,62
Sonstiges Nettovermögen			2 079 089	4,38
Nettoinventarwert			47 516 413	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Bermuda			1 208 022	0,64
48 476	USD	Golar LNG	1 208 022	0,64
Schweiz			830 8104	4,41
142 800	USD	Alcon	830 8104	4,41
Vereinigte Staaten			126 839 730	67,30
57 093	USD	Abbott Laboratories	5 524 319	2,93
16 967	USD	Adobe	4 669 318	2,48
21 420	USD	agilon health	501 656	0,27
33 136	USD	Alphabet	3 169 458	1,68
40 833	USD	American Express	5 508 780	2,92
40 932	USD	Analog Devices	5 703 465	3,03
11 952	USD	Anterix	426 925	0,23
2 477	USD	Biogen	661 359	0,35
133 863	USD	Boston Scientific	5 184 514	2,75
2 101	USD	Bunge	173 480	0,09
11 155	USD	Comerica	793 121	0,42
15 873	USD	Constellation Brands	3 645 711	1,93
3 561	USD	CyberArk Software	533 936	0,28
14 262	USD	Danaher	3 683 732	1,95
10 850	USD	Dropbox	224 812	0,12
21 199	USD	Eaton	2 827 099	1,50
12 361	USD	Eli Lilly	3 996 929	2,12
17 210	USD	Graphic Packaging Holding	339 725	0,18
44 833	USD	Halliburton	1 103 788	0,59
17 330	USD	Hess	1 888 797	1,00
70 426	USD	Johnson Controls International	3 466 368	1,84
17 444	USD	Keysight Technologies	2 744 988	1,46
14 241	USD	Lantheus Holdings	1 001 570	0,53
24 871	USD	LPL Financial Holdings	5 433 816	2,88
5 521	USD	MasTec	350 584	0,19
11 214	USD	Medtronic	905 531	0,48
7 994	USD	Microsoft	1 861 803	0,99
8 815	USD	NextEra Energy	691 184	0,37
249 052	USD	Norwegian Cruise Line Holdings	2 829 231	1,50
16 877	USD	Occidental Petroleum	1 037 092	0,55
10 063	USD	Old Dominion Freight Line	2 503 373	1,33
23 094	USD	Option Care Health	726 768	0,39
48 689	USD	PACCAR	4 074 782	2,16
4 394	USD	Palo Alto Networks	719 693	0,38
124 609	USD	Patterson-UTI Energy	1 455 433	0,77

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
42 135	USD	Pfizer	1 843 828	0,98
142 841	USD	Portillo's	2 812 539	1,49
2 388	USD	PTC	249 785	0,13
13 536	USD	QUALCOMM	1 529 297	0,81
25 206	USD	Regions Financial	505 884	0,27
19 562	USD	Roper Technologies	7 035 278	3,73
40 090	USD	Royal Caribbean Cruises	1 519 411	0,81
27 550	USD	S&P Global	8 412 392	4,46
88 649	USD	Sabre	456 542	0,24
83 952	USD	Schlumberger	3 013 877	1,60
15 121	USD	Silgan Holdings	635 687	0,34
141 655	USD	Southwest Airlines	4 368 640	2,32
6 598	USD	Splunk	496 170	0,26
1 919	USD	T-Mobile US	257 472	0,14
37 346	USD	Verra Mobility	574 008	0,30
3 429	USD	Vulcan Materials	540 788	0,29
10 125	USD	Waste Connections	1 368 191	0,73
228 055	USD	Wells Fargo	9 172 371	4,87
14 293	USD	Williams-Sonoma	1 684 430	0,89
Summe Aktien			136 355 856	72,35
Anleihen				
Vereinigte Staaten			1 967 153	1,04
2 256 000	USD	TransDigm 15/11/27, 5,50%	1 967 153	1,04
Summe Anleihen			1 967 153	1,04
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			138323009	73,39
Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
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			40 012 010	21,23
2 735 000	USD	NCL 15/03/26, 5,88%	2 101 683	1,11
2 630 000	USD	Royal Caribbean Cruises 31/08/26, 5,50%	1 995 188	1,06
36 000 000	USD	United States Treasury Bill 17/11/22, ZCP	35 915 139	19,06
Summe Anleihen			40 012 010	21,23
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			40 012 010	21,23
Summe Kapitalanlagen			178 335 019	94,62
Sonstiges Nettovermögen			10 134 047	5,38
Nettoinventarwert			188 469 066	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Deutschland			66 564	0,01
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4,25%	12 558	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4,75%	13 422	0,01
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3,25%	11 469	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2,50%	10 406	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2,50%	10 536	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1,25%	8 173	-
Vereinigte Staaten			23 612	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2,50%	7 639	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3,00%	8 363	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2,50%	7 610	-
Summe Anleihen			90 176	0,01
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			90 176	0,01

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Vereinigte Staaten			24 133	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2,88%	8 175	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3,00%	8 361	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2,50%	7 597	-
Summe Anleihen			24 133	-
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			24 133	-

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Luxemburg				
5 000 000	USD	JPMorgan Liquidity Funds-US Dollar Treasury Liquidity Fund	5 000 000	0,72
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen			5 000 000	0,72
Summe Kapitalanlagen			5 114 309	0,73

Termineinlagen				
Finanzen			338 925 000	48,78
90 000 000	USD	Banque NA 03/10/22, 3,05%	90 000 000	12,95
65 000 000	USD	Credit Agricole 03/10/22, 3,06%	65 000 000	9,35
58 925 000	USD	JPMorgan Chase Bank NA 03/10/22, 3,04%	58 925 000	8,48
30 000 000	USD	Mizuho Bank 03/10/22, 3,07%	30 000 000	4,32
95 000 000	USD	Toronto-Dominion Bank 03/10/22, 3,06%	95 000 000	13,68
Summe Termineinlagen			338 925 000	48,78
Sonstiges Nettovermögen			350 806 706	50,49
Nettoinventarwert			694 846 015	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert GBP	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Vereinigtes Königreich			8 494 283	20,91
183 377	GBP	Beazley	1 034 247	2,56
116 909	GBP	Bytes Technology Group	490 784	1,21
1 296 958	GBP	Comptoir Group	69 387	0,17
547 250	GBP	Everyman Media Group	536 305	1,32
425 207	GBP	Harworth Group	514 500	1,27
237 618	GBP	Inspecc Group	320 784	0,79
386 538	GBP	NatWest Group	873 190	2,15
135 336	GBP	OSB Group	568 953	1,40
489 684	GBP	Premier Foods	466 669	1,15
150 981	GBP	Team17 Group	561 649	1,38
430 398	GBP	TT Electronics	606 000	1,49
163 992	GBP	Tyman	322 736	0,79
49 534	GBP	VIDENDUM	596 389	1,47
71 120	GBP	Vp	536 245	1,32
48 274	GBP	Watches of Switzerland Group	325 367	0,80
126 987	GBP	Wincanton	371 437	0,91
36 692	GBP	Young & Company's Brewery	220 886	0,54
8 423	GBP	Young & Company's Brewery Class A	78 755	0,19
Summe Aktien			8 494 283	20,91
Anleihen				
Vereinigtes Königreich			19 152 312	47,14
9 600 000	GBP	United Kingdom Gilt 31/01/23, 0,13%	9 510 241	23,40
3 300 000	GBP	United Kingdom Gilt 22/07/23, 0,75%	3 221 261	7,93
2 000 000	GBP	United Kingdom Gilt 07/09/23, 2,25%	1 964 846	4,84
4 050 000	GBP	United Kingdom Gilt 31/01/24, 0,13%	3 837 202	9,45
650 000	GBP	United Kingdom Gilt 22/04/24, 1,00%	618 762	1,52
Summe Anleihen			19 152 312	47,14
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			27 646 595	68,05

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert GBP	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Vereinigtes Königreich			6 914 229	17,02
2 000 000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 06/03/23, ZCP	1 978 060	4,87
5 000 000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 13/03/23, ZCP	4 936 169	12,15
Summe Anleihen			6 914 229	17,02
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			6 914 229	17,02
Summe Kapitalanlagen			34 560 824	85,07
Sonstiges Nettovermögen			6 064 445	14,93
Nettoinventarwert			40 625 269	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien					845	HKD	Anhui Conch Cement	2 680	-
Australien					26 779	HKD	Baidu	389 251	0,06
244 434	GBP	Glencore	1 304 981	0,21	6 700	CNH	Baoshan Iron & Steel	4 936	-
27 073	AUD	Whitehaven Coal	156 028	0,03	1 836	HKD	China Longyuan Power Group	2 304	-
Österreich					4 000	HKD	China National Building Material	3 063	-
26 088	EUR	Addiko Bank	269 738	0,04	3 869	HKD	China Oilfield Services	3 840	-
45 127	EUR	BAWAG Group	1 966 319	0,32	7 000	CNH	China Railway Group	5 128	-
Belgien					4 344	CNH	Contemporary Amperex Technology	243 920	0,04
8 858	USD	Euronav	136 325	0,02	248 122	HKD	CSPC Pharmaceutical Group	245 920	0,04
6 476	EUR	UCB	451 384	0,08	40 705	HKD	Everest Medicines	38 892	0,01
Bermuda					5 842	HKD	Ganfeng Lithium	38 886	0,01
15 514	USD	Golar LNG	386 609	0,06	3 372	CNH	Ganfeng Lithium	35 347	0,01
Brasilien					1 650	HKD	Great Wall Motor	1 896	-
59 588	USD	Banco Bradesco	219 284	0,04	664	CNH	Guangzhou Tinci Materials Technology	4 098	-
2 049	USD	Cia de Saneamento Basico do Estado de Sao Paulo	18 666	-	2 303	CNH	Hangzhou Tigermed Consulting	29 412	-
51 184	BRL	Cosan	164 909	0,03	727 277	HKD	Hope Education Group	51 884	0,01
254 634	BRL	Hapvida Participacoes e Investimentos	357 333	0,05	83 500	HKD	Li Ning	639 308	0,11
14 784	BRL	Hypera	121 274	0,02	185 310	HKD	Lifetech Scientific	61 615	0,01
Burkina Faso					5 381	CNH	Metallurgical of China	2 254	-
16 057	CAD	Endeavour Mining	296 183	0,05	51 900	HKD	Onewo	293 562	0,05
Kanada					474	HKD	Ping An Insurance Group of China	2 367	-
134 400	CAD	ARC Resources	1 614 143	0,27	25 295	HKD	Remegen	122 614	0,02
20 248	USD	Barrick Gold	313 844	0,05	1 300	CNH	SAIC Motor	2 604	-
96 147	USD	Cenovus Energy	1 477 779	0,24	1 600	CNH	Sany Heavy Industry	3 111	-
3 200	USD	Clementia Pharmaceuticals	-	-	173 600	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer	233 541	0,04
112 979	CAD	Enerplus	1 599 790	0,26	114 638	CNH	Sinoma Science & Technology	319 853	0,05
54 229	CAD	Foran Mining	90 293	0,01	8 000	HKD	Sinopec Engineering Group	3 210	-
81 390	CAD	Headwater Exploration	309 922	0,05	7 500	HKD	Tencent Holdings	254 534	0,04
7 128	CAD	Intact Financial	1 008 762	0,16	580	CNH	Wuxi Lead Intelligent Equipment	3 843	-
22 465	CAD	NuVista Energy	159 541	0,03	3 059	HKD	XPeng	17 926	-
39 159	CAD	Parex Resources	571 786	0,09	69	USD	Xpeng-ADR	825	-
6 016	CAD	Pembina Pipeline	182 743	0,03	200	CNH	Yunnan Energy New Material	4 878	-
23 215	CAD	Trican Well Service	48 233	0,01	144 400	HKD	Zai Lab	504 043	0,08
15 667	CAD	Whitecap Resources	99 127	0,02	8 452	CNH	Zhejiang HangKe Technology	59 180	0,01
Kaimaninseln					4 074	CNH	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology	3 161	-
37 400	USD	Patria Investments	488 070	0,08					
China									
35 808	HKD	Alibaba Group Holding	355 587	0,06					
17 904	CNH	Amoy Diagnostics	57 854	0,01					
9 075	HKD	Angang Steel	2 243	-					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Dänemark			863 895	0,14
6 874	USD	Ascendis Pharma	709 809	0,11
475	DKK	Genmab	154 086	0,03
Ägypten			2 344	-
2 328	GBP	Centamin	2 344	-
Frankreich			3 821 527	0,62
108 981	EUR	ALD	1 010 393	0,17
4 378	EUR	Dassault Aviation	502 007	0,08
383	EUR	Gaztransport Et Technigaz	42 528	0,01
10 909	EUR	Publicis Groupe	522 808	0,08
31 853	EUR	Technip Energies	362 592	0,06
18 173	EUR	TotalEnergies	859 799	0,14
11 364	EUR	Ubisoft Entertainment	315 408	0,05
21 218	EUR	Vallourec	205 992	0,03
Deutschland			3 323 157	0,54
127 627	EUR	Commerzbank	918 344	0,15
5 477	EUR	Hensoldt	110 307	0,02
26 832	USD	Immatics	268 320	0,04
7 837	EUR	Siemens	777 282	0,13
35 009	EUR	Talanx	1 248 904	0,20
Griechenland			192 139	0,03
37702	EUR	Public Power	192 139	0,03
Hongkong			2 144 929	0,35
122 486	HKD	AIA Group	1 021 282	0,17
112 593	GBP	Prudential	1 123 647	0,18
Ungarn			18 635	-
1 087	HUF	Richter Gedeon	18 635	-
Indien			2 430 388	0,39
183 804	INR	Axis Bank	1 661 779	0,27
78 065	INR	Bharti Airtel	767 300	0,12
84	INR	Mahindra & Mahindra	1 309	-
Indonesien			1 114 302	0,18
40 338	IDR	Aneka Tambang	5 139	-
1 316 983	IDR	Bank Rakyat Indonesia Persero	388 327	0,06
2 432 200	IDR	Telkom Indonesia Persero	712 370	0,12
2 325	IDR	United Tractors	5 012	-
8 218	IDR	Vale Indonesia	3 454	-
Irland			4 247 063	0,69
25 847	USD	AerCap Holdings	1 094 104	0,18
961 511	EUR	AIB Group	2 342 629	0,38

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
18 05	USD	ICON	331 723	0,05
126 844	EUR	Irish Continental Group	478 607	0,08
Italien			5 317 149	0,86
2 456	EUR	DiaSorin	276 324	0,04
255 123	EUR	FinecoBank Banca Fineco	3 184 174	0,52
181 148	EUR	UniCredit	1 856 651	0,30
Japan			4 454 140	0,72
14 537	JPY	Astellas Pharma	192 548	0,03
5 800	JPY	Bank of Kyoto	211 995	0,03
41 400	JPY	Chiba Bank	222 833	0,04
24 235	JPY	Chugai Pharmaceutical	607 173	0,10
18 571	JPY	Daiichi Sankyo	518 648	0,08
1 606	JPY	Eisai	85 987	0,01
474	JPY	ENEOS Holdings	1 523	-
60 100	JPY	Fukuoka Financial Group	1 065 547	0,17
14 900	JPY	Japan Steel Works	292 997	0,05
1 282	JPY	Nippon Shinyaku	65 548	0,01
4 136	JPY	Ono Pharmaceutical	96 620	0,02
230	JPY	Panasonic Holdings	1 612	-
106	JPY	Rohm	6 929	-
11 800	JPY	Sanken Electric	360 775	0,06
29 000	JPY	Shiga Bank	523 775	0,09
148	JPY	Sumitomo Mitsui Financial Group	4 115	-
20 700	JPY	T&D Holdings	195 515	0,03
Jordanien			52 097	0,01
3 422	GBP	Hikma Pharmaceuticals	52 097	0,01
Luxemburg			33 705	0,01
41 756	USD	Arrival	33 705	0,01
Malaysia			4 007	-
3 318	MYR	Malaysia Airports Holdings	4 007	-
Mexiko			86 598	0,01
10 083	GBP	Fresnillo	86 598	0,01
Niederlande			3 408 054	0,55
2 957	USD	Argenx	1 043 969	0,17
124 737	GBP	DP Eurasia	56 406	0,01
6 777	EUR	EXOR	434 905	0,07
16 837	EUR	Koninklijke Philips	264 018	0,04
17 013	USD	Merus	340 770	0,06
50 551	GBP	Shell	1 267 986	0,20
Norwegen			1 182 408	0,19
1 235	NOK	Aker BP	35 456	0,01
36 064	NOK	Aker Carbon Capture	46 187	0,01
39 453	NOK	DNB Bank	626 299	0,09
14 330	USD	Equinor	474 466	0,08

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Philippinen					6 194	-			
17 082	PHP	Bloomerry Resorts	1 952	-	17 071	GBP	ConvaTec Group	39 189	0,01
3 070	PHP	Security Bank	4 242	-	8 127	GBP	Derwent London	183 299	0,03
Puerto Rico					1 647 868	0,27			
22 868	USD	Popular	1 647 868	0,27	8 811	GBP	Genus	257 557	0,04
Singapur					1 761 060	0,29			
41 594	SGD	DBS Group Holdings	966 979	0,16	11 405	GBP	Harbour Energy	57 037	0,01
6 570	EUR	STMicroelectronics	207 623	0,03	69 798	GBP	Hargreaves Lansdown	675 834	0,11
32 198	SGD	United Overseas Bank	586 458	0,10	8 383	GBP	IMI	104 739	0,02
Südafrika					705 259	0,11			
20 074	GBP	Anglo American	613 125	0,10	970	USD	Immunocore Holdings	45 532	0,01
4 953	GBP	Thungela Resources	92 134	0,01	19 318	GBP	Imperial Brands	400 114	0,07
Südkorea					182 396	0,03			
7 582	USD	Coupang	126 392	0,02	16 887	GBP	Rotork	44 159	0,01
128	KRW	KB Financial Group	3 910	-	429 729	GBP	Sabre Insurance Group	465 419	0,08
3 297	KRW	Korea Electric Power	46 320	0,01	115 882	GBP	Serco Group	202 233	0,03
61	KRW	Samsung Electronics	2 264	-	30 904	GBP	Smith & Nephew	362 484	0,06
35	KRW	SK Innovation	3 510	-	109	GBP	St James's Place	1 261	-
Spanien					2 020 975	0,33			
699 247	EUR	Banco Santander	1 642 999	0,27	61 309	NOK	Subsea 7	487 049	0,08
43 069	EUR	Bankinter	243 382	0,04	41 193	USD	TechnipFMC	348 493	0,06
15 462	EUR	Grifols	134 594	0,02	16 230	USD	Verona Pharma	165 871	0,03
Schweden					769 085	0,12			
50 751	SEK	Anleger	748 073	0,12	Vereinigte Staaten				
1 552	SEK	SKF	21 012	-	118 179 661	19,21			
Schweiz					2 586 119	0,42			
9 097	CHF	Alcon	536 029	0,09	20 948	USD	2seventy bio	304 793	0,05
98	CHF	Lonza Group	48 300	0,01	813	USD	Accenture	209 185	0,03
9 862	CHF	Novartis	754 917	0,12	28 538	USD	Aclaris Therapeutics	449 188	0,07
595	CHF	Tecan Group	206 836	0,03	1 578	USD	Acuity Brands	248 488	0,04
70 895	CHF	UBS Group	1 040 037	0,17	14 799	USD	AdaptHealth	277 925	0,05
Thailand					4 283	-			
13 136	THB	Banpu	4 283	-	1 100	USD	Addus HomeCare	104 764	0,02
Vereinigtes Königreich					7 147 760	1,17			
11 615	GBP	Abcam	174 429	0,03	5 589	USD	AECOM	382 120	0,06
45 116	EUR	Allfunds Group	334 936	0,05	21 910	USD	AES	495 166	0,08
10 199	GBP	AstraZeneca	1 132 392	0,17	1 160	USD	Agilent Technologies	140 998	0,02
49 563	GBP	Babcock International Group	154 176	0,03	14 677	USD	agilon health	343 735	0,06
131 933	GBP	Barclays	212 568	0,03	1 204	USD	Align Technology	249 360	0,04
83 503	GBP	Beazley	525 847	0,09	32 060	USD	Alkermes	715 900	0,12
43 684	GBP	BP	211 246	0,03	4 128	USD	Allstate	514 060	0,08
5 432	GBP	British American Tobacco	195 690	0,03	5 350	USD	Alnylam Pharmaceuticals	1 070 856	0,17
32 129	EUR	CNH Industrial	366 206	0,06	2 881	USD	Altus Power	31 720	0,01
					6 120	USD	Amazon.com	691 560	0,11
					2 011	USD	Amedisys	194 644	0,03
					15 895	USD	Amerant Bancorporation	394 832	0,06
					6 166	USD	American Electric Power	533 051	0,09
					18 382	USD	American Express	2 479 915	0,40
					57 892	USD	Ameris Bancorporation	2 588 351	0,42
					8 666	USD	Amicus Therapeutics	90 473	0,01
					29 753	USD	Antero Midstream	273 133	0,04
					32 260	USD	Antero Resources	984 898	0,16
					14 430	USD	Apellis Pharmaceuticals	985 569	0,16
					5 581	USD	Applied Industrial Technologies	573 615	0,09
					3 639	USD	Aptiv	284 606	0,05

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
20 152	USD	Arch Capital Group	917 722	0,15	3 478	USD	Dexcom	280 118	0,05
5 182	USD	Archer-Daniels-Midland	416 892	0,07	118 351	USD	Diamond Offshore Drilling	784 667	0,13
27 036	USD	Ares Management	1 674 880	0,27	31 132	USD	Diamondback Energy	3 750 160	0,62
2 077	USD	Atmos Energy	211 542	0,03	433	USD	Domino's Pizza	134 317	0,02
1 357	USD	AvalonBay Communities	249 946	0,04	1 988	USD	Edison International	112 481	0,02
3 082	USD	Avantor	60 407	0,01	2 760	USD	Edwards Lifesciences	228 059	0,04
12 456	USD	AZEK	207 019	0,03	6 355	USD	Elanco Animal Health	78 865	0,01
6 767	USD	Baker Hughes	141 836	0,02	1 280	USD	Elevance Health	581 427	0,09
3 524	USD	Baxter International	189 803	0,03	7 869	USD	Eli Lilly	2 544 441	0,41
2 052	USD	Becton Dickinson	457 247	0,07	5 843	USD	Encompass Health	264 279	0,04
443	USD	Bio-Techne	125 812	0,02	27 846	USD	EnLink Midstream	247 551	0,04
4 636	USD	Block	254 934	0,04	1 296	USD	Enstar Group	219 789	0,04
8 492	USD	Blueprint Medicines	559 538	0,09	11 488	USD	Entergy	1 156 037	0,19
8 896	USD	Boston Scientific	344 542	0,06	15 738	USD	Enterprise Financial Services	693 101	0,11
29 898	USD	Brigham Minerals	737 584	0,12	19 974	USD	EOG Resources	2 231 695	0,36
825	USD	Bristol-Myers Squibb	58 649	0,01	19 499	USD	EQT	794 584	0,13
18 161	USD	Builders FirstSource	1 070 046	0,17	20 841	USD	Equitable Holdings	549 160	0,09
3 993	USD	Bunge	329 702	0,05	11 751	USD	Eversource Energy	916 108	0,15
13 364	USD	BWX Technologies	673 145	0,11	9 579	USD	Exact Sciences	311 222	0,05
6 960	USD	Cabot	444 674	0,07	32 247	USD	Exelon	1 207 973	0,20
266	USD	Cactus	10 222	-	52 460	USD	Expro Group Holdings	668 340	0,11
26 044	USD	CareMax	184 652	0,03	5 710	USD	Exxon Mobil	498 540	0,08
15 356	USD	Cargurus	217 595	0,04	12 345	USD	Fidelity National Financial	446 889	0,07
6 223	USD	Celldex Therapeutics	174 929	0,03	4 425	USD	First Solar	585 295	0,10
9 206	USD	Centene	716 319	0,12	1 434	USD	Five9	107 521	0,02
24 616	USD	CenterPoint Energy	693 679	0,11	7 986	USD	Flowserve	194 060	0,03
7 123	USD	ChargePoint Holdings	105 135	0,02	280	USD	Fluence Energy	4 085	-
60 349	USD	Charles Schwab	4 337 282	0,71	10 204	USD	Fluor	253 977	0,04
393	USD	Charter Communications	119 217	0,02	188	USD	Fluor-Preference	233 723	0,04
13 110	USD	Chemours	323 162	0,05	10 611	USD	Ford Motor	118 843	0,02
7 728	USD	Cheniere Energy	1 282 152	0,21	1 167	USD	Gartner	322 897	0,05
18 808	USD	Chesapeake Energy	1 771 902	0,29	26 804	USD	Genworth Financial	93 814	0,02
17 382	USD	Chord Energy	2 377 336	0,39	2 904	USD	Glaukos	154 609	0,03
2 564	USD	Chubb	466 340	0,08	1 984	USD	Global Payments	214 371	0,03
3 270	USD	Clean Harbors	359 635	0,06	8 585	USD	GoDaddy	608 505	0,10
6 610	USD	CNB Financial	155 798	0,03	4 459	USD	Goldman Sachs Group	1 306 710	0,21
9 326	USD	Comerica	663 079	0,11	5 810	USD	Green Plains	168 897	0,03
6 219	USD	ConocoPhillips	636 452	0,10	13 500	GBP	GSK	196 829	0,03
12 653	USD	Consolidated Edison	1 085 121	0,18	3 441	USD	Gulfport Energy	303 806	0,05
3 904	USD	Constellation Energy	324 774	0,05	3 910	USD	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital	117 026	0,02
20 222	USD	Coterra Energy	528 199	0,09	1 833	USD	HCA Healthcare	336 887	0,05
9 019	USD	CTI BioPharma	5 2491	0,01	3 655	USD	Health Catalyst	35 453	0,01
2 703	USD	Danaher	698 158	0,11					
200	USD	Darling Ingredients	13 230	-					
899	USD	Deere	300 167	0,05					
2 221	USD	Denbury	191 583	0,03					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
8 670	USD	Heritage Financial	229 495	0,04	20 229	USD	NextDecade	121 779	0,02
2 304	USD	HF Sinclair	124 047	0,02	31 089	USD	NiSource	783 132	0,13
6 407	USD	Hologic	413 380	0,07	15 955	USD	Noble	471 949	0,08
11 708	USD	Home BancShares	263 547	0,04	10 690	USD	Northern Oil & Gas	293 013	0,05
3 866	USD	Horizon Therapeutics	239 267	0,04	1 876	USD	Okta	106 688	0,02
1 700	USD	Hubbell	379 100	0,06	6 503	USD	ON Semiconductor	405 332	0,07
1 957	USD	Humana	949 517	0,15	30 313	USD	Ovintiv	1 394 398	0,23
977	USD	IDEXX Laboratories	318 307	0,05	9 740	USD	Owens & Minor	234 734	0,04
1 240	USD	Illumina	236 580	0,04	2 388	USD	Palo Alto Networks	391 131	0,06
65 941	USD	ImmunoGen	315 198	0,05	810	USD	Paycom Software	267 292	0,04
1 731	USD	Inari Medical	125 740	0,02	806	USD	PayPal Holdings	69 372	0,01
8 902	USD	Incyte	593 229	0,10	21 183	USD	PDC Energy	1 224 166	0,20
1 629	USD	Insulet	373 693	0,06	5 871	USD	Peabody Energy	145 718	0,02
20 472	USD	Intel	527 563	0,09	8 781	USD	Pfizer	384 257	0,06
7 386	USD	Intra-Cellular Therapies	343 670	0,06	3 798	USD	Phillips 66	306 575	0,05
24 067	USD	Ironwood Pharmaceuticals	249 334	0,04	3 454	USD	Pioneer Natural Resources	747 895	0,12
912	USD	Johnson & Johnson	148 984	0,02	9 571	USD	PNM Resources	437 682	0,07
24 221	USD	Johnson Controls International	1 192 158	0,19	13 132	USD	Portland General Electric	570 717	0,09
1 042	USD	Jones Lang LaSalle	157 415	0,03	19 563	USD	ProFrac Holding	297 553	0,05
2 514	USD	Karuna Therapeutics	565 474	0,09	5 860	USD	Progressive	680 991	0,11
11 232	USD	Kymera Therapeutics	244 521	0,04	1 783	USD	Prologis	181 153	0,03
1 335	USD	Laboratory of America Holdings	273 421	0,04	4 537	USD	PTC Therapeutics	227 757	0,04
10 557	USD	Lennar	787 024	0,13	5 196	USD	Public Service Enterprise Group	292 171	0,05
1 051	USD	Livent	32 213	0,01	1 956	USD	QuidelOrtho	139 815	0,02
618	USD	Lululemon Athletica	172 768	0,03	8 869	USD	Range Resources	224 031	0,04
6 900	USD	M&T Bank	1 216 608	0,20	2 166	USD	Raymond James Financial	214 044	0,03
1 885	USD	Marriott International	264 164	0,04	668	USD	Regeneron Pharmaceuticals	460 165	0,07
178	USD	Merck	15 329	-	2 828	USD	Revolution Medicines	55 768	0,01
16 548	USD	MGIC Investment	212 145	0,03	8 096	USD	Rice Acquisition II	80 393	0,01
6 664	USD	Mirati Therapeutics	465 414	0,08	14 906	USD	Rice Acquisition II-XNYS	147 122	0,02
1 643	USD	Moderna	194 285	0,03	438	CHF	Roche Holding	143 581	0,02
1 078	USD	Molina Healthcare	355 568	0,06	6 373	USD	Ross Stores	537 053	0,09
36 607	USD	Morgan Stanley	2 892 319	0,48	2 665	USD	S&P Global	813 758	0,13
11 316	USD	MVB Financial	314 924	0,05	4 635	USD	Sage Therapeutics	181 507	0,03
22 149	USD	Myovant Sciences	397 796	0,06	1 701	USD	Salesforce	244 672	0,04
18 225	USD	NanoString Technologies	232 733	0,04	1 259	USD	Sarepta Therapeutics	139 170	0,02
4 605	USD	National Bank Holdings	170 339	0,03	56 084	USD	Schlumberger	2 013 416	0,33
20 269	USD	Navigator Holdings	232 080	0,04	3 753	EUR	Schneider Electric	430 120	0,07
10 475	USD	NeoGenomics	90 190	0,01	7 302	USD	Seagen	999 133	0,16
1 321	USD	Netflix	311 016	0,05					
20 778	USD	New Jersey Resources	804 109	0,13					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
7 883	USD	Sempra Energy	1 181 977	0,19
10 410	USD	Skyline Champion	550 377	0,09
3 663	USD	Southwest Gas Holdings	255 494	0,04
1 743	USD	Stoke Therapeutics	22 380	-
2 405	USD	Stryker	487 109	0,08
3 344	USD	SunPower	77 046	0,01
2 270	USD	Syndax Pharmaceuticals	54 548	0,01
4 665	USD	Syneos Health	219 955	0,04
72 459	USD	Synovus Financial	2 717 937	0,45
2 377	USD	Take-Two Interactive Software	259 093	0,04
14 228	USD	Talos Energy	236 896	0,04
14 646	USD	Targa Resources	883 740	0,14
305	USD	Teleflex	61 445	0,01
3 323	USD	Tenaris	85 866	0,01
422	USD	Thermo Fisher Scientific	214 034	0,03
11 700	USD	Third Harmonic Bio	221 949	0,04
6 239	USD	T-Mobile US	837 087	0,14
1 703	USD	Tradeweb Markets	96 083	0,02
5 021	USD	Uber Technologies	133 057	0,02
1 249	USD	Ultra Beauty	501 086	0,08
3 779	USD	Ultragenyx Pharmaceutical	156 488	0,03
1 770	USD	UnitedHealth Group	893 921	0,15
2 428	USD	Valaris	118 826	0,02
5 663	USD	Valero Energy	605 092	0,10
2 695	USD	Veeva Systems	444 352	0,07
8 030	USD	Veracyte	133 298	0,02
1 390	USD	Verisk Analytics	237 037	0,04
3 266	USD	Vertex Pharmaceuticals	945 638	0,15
4 496	USD	Visteon	476 846	0,08
1 842	USD	Waters	496 474	0,08
3 004	USD	WESCO International	358 618	0,06
19 942	USD	Western Alliance Bancorporation	1 310 987	0,21
6 018	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	489 564	0,08
13 731	USD	Williams	393 119	0,06
793	USD	Workday	120 710	0,02
17 618	USD	Zentaris Pharmaceuticals	381 606	0,06
4 239	USD	Zoetis	628 601	0,10
550	USD	ZoomInfo Technologies	22 913	-
Summe Aktien			185 569 833	30,15

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen				
Argentinien			12 972	-
42 724	USD	Cia Latinoamericana de Infraestructura & Servicios 25/07/27, 5,25%	12 972	-
Bulgarien			1 601 452	0,26
1 740 000	EUR	Bulgaria Government International Bond 23/09/29, 4,13%	1 601 452	0,26
Kanada			2 197 147	0,36
1 350 000	CAD	Ontario Teachers' Finance Trust 16/11/22, ZCP	972 940	0,16
700 000	CAD	Regional Municipality of York 08/11/22, ZCP	504 947	0,08
1 000 000	CAD	Regional Municipality of York 06/12/22, ZCP	719 260	0,12
China			699 738	0,11
700 000	USD	Bank of China 22/11/22, variabel	699 738	0,11
Frankreich			863 667	0,14
910 000	USD	BNP Paribas perpetual, variabel	679 770	0,11
200 165	EUR	Vallourec 30/06/26, 8,50%	183 897	0,03
Deutschland			332 425	0,05
135 000	EUR	Renk 15/07/25, 5,75%	121 531	0,02
300 000	EUR	Wintershall Dea Finance 2 perpetual, variabel	210 894	0,03
Ungarn			2 132 852	0,35
885 000	EUR	Hungary Government International Bond 28/04/26, 1,13%	760 892	0,12
2 205 000	EUR	Hungary Government International Bond 18/11/30, 0,50%	1 371 960	0,23
Luxemburg			369 270	0,06
495 000	EUR	Altice France Holding 15/05/27, 8,00%	369 270	0,06
Mexiko			465 689	0,08
11 110 500	MXN	Mexican Bonos 31/07/53, 8,00%	465 689	0,08
Niederlande			2 096 334	0,34
690 000	USD	ING Groep perpetual, variabel	451 847	0,07
630 000	USD	ING Groep Series * perpetual, variabel	442 450	0,07
685 000	EUR	Koninklijke KPN perpetual, variabel	658 394	0,11
690 000	EUR	UPCB Finance VII 15/06/29, 3,63%	543 643	0,09

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Peru			2 605 961	0,42
2 300 000	PEN	Peru Government Bond 12/08/28, 6,35%	525 513	0,09
3 350 000	PEN	Peru Government Bond 12/08/32, 6,15%	694 740	0,11
7 390 000	PEN	Peru Government Bond 12/08/34, 5,40%	1 385 708	0,22
Südafrika			7 065 763	1,15
64 515 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8,25%	2 934 363	0,48
70 245 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8,88%	3 175 384	0,52
9 545 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/36, 6,25%	335 182	0,05
14 810 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/44, 8,75%	620 834	0,10
Südkorea			3 003 800	0,49
200 000	USD	Export-Import Bank of Korea 22/03/23, variabel	200 479	0,03
1 010 000	USD	Export-Import Bank of Korea 27/04/23, variabel	1 015 307	0,17
500 000	USD	Korea Development Bank 30/10/22, variabel	500 077	0,09
400 000	USD	Korea Development Bank 18/02/23, variabel	400 017	0,06
200 000	USD	Korea Development Bank 16/04/23, variabel	201 229	0,03
500 000	USD	Korea Development Bank 26/05/23, ZCP	486 998	0,08
200 000	USD	Korea Development Bank 09/03/24, variabel	199 693	0,03
Supranational			2 685 149	0,44
127 500 000	ZAR	Asian Development Bank 30/04/40, ZCP	1 121 754	0,19
16 000 000	TRY	European Bank for Reconstruction & Development 15/10/26, ZCP	240 223	0,04
40 000 000	MXN	European Bank for Reconstruction & Development 19/01/32, ZCP	842 138	0,14
200 000	USD	European Investment Bank 19/01/23, variabel	199 981	0,03
11 750 000	MXN	International Bank for Reconstruction & Development 25/05/33, ZCP	210 963	0,03
7 200 000	TRY	International Finance 09/05/27, ZCP	70 090	0,01

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Schweden			636 329	0,10
680 000	EUR	Telia 21/12/82, variabel	636 329	0,10
Schweiz			2 076 860	0,34
960 000	USD	Credit Suisse Group perpetual, variabel	884 807	0,14
895 000	USD	Credit Suisse Group perpetual, variabel	532 946	0,09
290 000	USD	UBS Group perpetual, variabel	226 563	0,04
510 000	USD	UBS Group perpetual, variabel	432 544	0,07
Vereinigtes Königreich			2 426 963	0,39
320 000	GBP	AA Bond 31/07/29, 7,38%	317 203	0,05
350 000	GBP	B&M European Value Retail 15/07/25, 3,63%	332 858	0,05
480 000	USD	Barclays perpetual, variabel	421 296	0,07
670 000	EUR	British American Tobacco perpetual, variabel	463 596	0,08
460 000	GBP	Heathrow Funding 09/08/49, 2,75%	268 364	0,04
700 000	GBP	National Express Group perpetual, variabel	623 646	0,10
Summe Anleihen			31 272 371	5,08
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			216 842 204	35,23

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen				
Kanada			18 836 969	3,06
100 000	CAD	Alberta Treasury Bill 01/11/22, ZCP	72 347	0,01
500 000	CAD	Alberta Treasury Bill 15/11/22, ZCP	360 555	0,06
1 000 000	CAD	CDP Financial 25/10/22, ZCP	722 521	0,12
750 000	CAD	CDP Financial 10/11/22, ZCP	541 116	0,09
400 000	USD	CDP Financial 26/06/23, ZCP	389 072	0,06
250 000	USD	CDP Financial 28/06/23, ZCP	243 213	0,04
400 000	CAD	City of Montreal Canada 11/05/23, 0,45%	283 278	0,05

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens	
1 000 000	CAD	City of Montreal Canada 01/09/23, 3,50%	719 666	0,12	1 300 000	CAD	Province of British Columbia Canada Principal Strip 08/09/23, ZCP	906 482	0,14	
300 000	CAD	City of Montreal Coupon Strip 01/12/22, ZCP	215 897	0,04	600 000	CAD	Province of Manitoba Canada Treasury Bill 16/11/22, ZCP	432 636	0,07	
1 000 000	CAD	City of Ottawa Ontario 19/10/22, ZCP	722 752	0,12	500 000	CAD	Province of Saskatchewan Canada Coupon Strip 27/10/22, ZCP	361 196	0,06	
310 000	CAD	City of Quebec Canada 25/09/23, 4,00%	223 632	0,04	500 000	CAD	PSP Capital 03/10/22, ZCP	361 923	0,06	
340 000	CAD	City of Quebec Canada Principal Strip 06/03/23, ZCP	241 769	0,04	800 000	CAD	Quebec Treasury Bill 28/10/22, ZCP	577 869	0,09	
700 000	CAD	Hydro Quebec Interest Strip 15/08/23, ZCP	489 607	0,08	400 000	CAD	Quebec Treasury Bill 10/11/22, ZCP	288 497	0,05	
600 000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 12/10/22, ZCP	433 969	0,07	500 000	CAD	Regional Municipality of York 11/10/22, ZCP	361 695	0,06	
1 000 000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 19/10/22, ZCP	722 825	0,11	1 500 000	CAD	Regional Municipality of York 18/11/22, ZCP	1 080 893	0,17	
900 000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 02/11/22, ZCP	649 767	0,11	1 000 000	CAD	Regional Municipality of York 22/11/22, ZCP	720 533	0,12	
500 000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 16/11/22, ZCP	360 503	0,06	China				499 265	0,08
300 000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 04/10/22, ZCP	217 134	0,04	500 000	USD	Industrial & Commercial Bank of China 08/11/22, 2,96%	499 265	0,08	
700 000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 13/10/22, ZCP	506 248	0,08	Frankreich				249 567	0,04
500 000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 17/10/22, ZCP	361 485	0,06	250 000	USD	Dexia Credit Local 02/11/22, ZCP	249 567	0,04	
600 000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 27/10/22, ZCP	433 415	0,07	Deutschland				496 815	0,08
1 000 000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 28/11/22, ZCP	719 929	0,12	500 000	USD	Landesbank Baden-Wuerttemberg 10/01/23, ZCP	496 815	0,08	
910 000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 06/12/22, ZCP	654 512	0,11	Japan				29 967 849	4,87
395 000	CAD	Nova Scotia Treasury Bill 25/10/22, ZCP	285 397	0,05	282 400 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 03/10/22, ZCP	1 951 234	0,32	
1 450 000	CAD	Ontario Teachers' Finance Trust 19/10/22, ZCP	1 048 212	0,16	142 400 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 11/10/22, ZCP	983 939	0,16	
600 000	CAD	Ontario Treasury Bill 02/11/22, ZCP	433 211	0,07	372 100 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 17/10/22, ZCP	2 571 151	0,42	
700 000	CAD	Ontario Treasury Bill 09/11/22, ZCP	505 507	0,08	94 600 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 24/10/22, ZCP	653 696	0,11	
1 047 000	CAD	Ontario Treasury Bill 07/12/22, ZCP	753 700	0,11	111 000 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 31/10/22, ZCP	767 035	0,12	
600 000	CAD	Prince Edward Island Treasury Note 11/10/22, ZCP	434 006	0,07	61 400 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 07/11/22, ZCP	424 296	0,07	
					225 550 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 14/11/22, ZCP	1 558 634	0,25	
					322 550 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 21/11/22, ZCP	2 229 036	0,36	

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
139 000 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 28/11/22, ZCP	960 582	0,16	1 500 000	USD	United States Cash Management Bill 31/01/23, ZCP	1 482 249	0,24
383 500 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 05/12/22, ZCP	2 650 286	0,43	9 648 000	USD	United States Treasury Bill 04/10/22, ZCP	9 646 145	1,57
147 200 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 12/12/22, ZCP	1 017 298	0,17	1 000 000	USD	United States Treasury Bill 06/10/22, ZCP	999 778	0,16
583 000 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 19/12/22, ZCP	4 029 219	0,65	52 484 000	USD	United States Treasury Bill 11/10/22, ZCP	52 448 814	8,52
657 850 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 06/01/23, ZCP	4 547 774	0,74	500 000	USD	United States Treasury Bill 13/10/22, ZCP	499 638	0,08
88 650 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 10/01/23, ZCP	612 807	0,10	9 637 000	USD	United States Treasury Bill 18/10/22, ZCP	9 626 056	1,56
307 000 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 11/01/23, ZCP	2 122 589	0,34	25147000	USD	United States Treasury Bill 20/10/22, ZCP	25 114 459	4,08
245 000 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 10/03/23, ZCP	1 694 245	0,28	1 650 000	USD	United States Treasury Bill 25/10/22, ZCP	1 647 138	0,27
172 650 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 20/04/23, ZCP	1 194 028	0,19	8 870 000	USD	United States Treasury Bill 01/11/22, ZCP	8 849 648	1,44
Rumänien			1 256 201	0,20	2 760 000	USD	United States Treasury Bill 03/11/22, ZCP	2 759 357	0,45
1 384 000	USD	Romanian Government International Bond 25/11/27, 5,25%	1 256 201	0,20	1 059 000	USD	United States Treasury Bill 08/11/22, ZCP	1 056 506	0,17
Südkorea			249 784	0,04	5 078 000	USD	United States Treasury Bill 10/11/22, ZCP	5 063 932	0,82
250 000	USD	Korea Development Bank 19/10/22, ZCP	249 784	0,04	3 890 000	USD	United States Treasury Bill 15/11/22, ZCP	3 876 710	0,63
Schweiz			3 994 413	0,65	1 320 000	USD	United States Treasury Bill 17/11/22, ZCP	1 316 186	0,21
5 221 000	USD	Credit Suisse Group perpetual, variabel	3 994 413	0,65	3 925 000	USD	United States Treasury Bill 22/11/22, ZCP	3 909 859	0,64
Vereinigte Staaten			192 459 856	31,27	1 525 000	USD	United States Treasury Bill 25/11/22, ZCP	1 518 558	0,25
240 000	USD	Adams Homes 15/02/25, 7,50%	198 438	0,04	2 050 000	USD	United States Treasury Bill 01/12/22, ZCP	2 040 015	0,33
363 000	USD	Alynlam Pharmaceuticals 15/09/27, 1,00%	354 288	0,07	15 634 000	USD	United States Treasury Bill 08/12/22, ZCP	15 546 651	2,53
105 000	USD	NCL 15/02/29, 7,75%	79 375	0,01	1 060 000	USD	United States Treasury Bill 15/12/22, ZCP	1 053 161	0,17
1 670 000	USD	United States Cash Management Bill 13/12/22, ZCP	1 660 620	0,27	830000	USD	United States Treasury Bill 22/12/22, ZCP	823 866	0,13
3 935 000	USD	United States Cash Management Bill 20/12/22, ZCP	3 906 860	0,63	2 230 000	USD	United States Treasury Bill 02/02/23, ZCP	2 207 680	0,36
1 215 000	USD	United States Cash Management Bill 03/01/23, ZCP	1 205 140	0,20	455 000	USD	United States Treasury Bill 09/02/23, ZCP	450 000	0,07
4 110 000	USD	United States Cash Management Bill 10/01/23, ZCP	4 071 584	0,66	212 0000	USD	United States Treasury Bill 16/02/23, ZCP	2 095 507	0,34
2 855 000	USD	United States Cash Management Bill 17/01/23, ZCP	2 824 992	0,46					
13 220 000	USD	United States Cash Management Bill 24/01/23, ZCP	13 072 663	2,12					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2022 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
380 000	USD	United States Treasury Bill 23/02/23, ZCP	375 245	0,06
4 330 000	USD	United States Treasury Bill 02/03/23, ZCP	4 270 663	0,69
2 265 000	USD	United States Treasury Bill 09/03/23, ZCP	2 228 735	0,36
1 744 000	USD	United States Treasury Bill 23/03/23, ZCP	1 726 521	0,28
2 500 000	USD	United States Treasury Bill 30/03/23, ZCP	2 452 819	0,40
Summe Anleihen			248 010 719	40,29
TBA-Wertpapiere				
Vereinigte Staaten			21 004 969	3,41
22 038 000	USD	Fannie Mae or Freddie Mac 01/10/52, 4,50%	21 004 969	3,41
Summe TBA-Wertpapiere			21 004 969	3,41
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			269 015 688	43,70

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Kanada			538 957	0,09
750 000	CAD	Toronto Hydro 10/04/23, 2,91%	538 957	0,09
Summe Anleihen			538 957	0,09
Summe sonstige Wertpapiere			538 957	0,09

Anzahl der Anteile oder Nenn- betrag	Währung	Optionsscheine	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Vereinigte Staaten			1 352	-
3 660	USD	Metals Acquisition Warrants 12/07/26	1 352	-
Summe Optionsscheine			1 352	-
Summe Kapitalanlagen			486 398 201	79,02
Sonstiges Nettovermögen			129 140 372	20,98
Nettoinventarwert			615 538 573	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 152 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2022

Die Gesellschaft

Die Gesellschaft ist eine offene Investmentgesellschaft in der Rechtsform einer „Société Anonyme“, die nach den Gesetzen des Grossherzogtums Luxemburg gegründet wurde und 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.

Anteilsklassen

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

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

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

Ausgabeaufschlag

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

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

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

Vertriebsgebühr

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

Swing-Pricing

Der Nettoinventarwert je Anteil eines Teilfonds kann verwässert werden, wenn Anleger Anteile eines Teilfonds zu einem Kurs kaufen oder verkaufen, der die Handels- und sonstigen Kosten im Zusammenhang mit vom Anlageverwalter zur Berücksichtigung von Mittelzu- oder 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 30. September 2022, dem letzten Berechnungstag des Berichtsjahres, wurden Swing-Pricing-Anpassungen für den Schroder GAIA Contour Tech Equity und den Schroder GAIA Oaktree Credit vorgenommen. Die nachfolgende Tabelle stellt den offiziellen Nettoinventarwert je Anteil dieser Teilfonds nach Anwendung der Swing-Pricing-Anpassung zu diesem Termin dar. Alle sonstigen in diesem Bericht aufgeführten Finanzinformationen werden vor den Swing Pricing-Anpassungen ausgewiesen.

	Währung der Anteilsklasse	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Oaktree Credit
Nettoinventarwert je Anteil* (einschliesslich Swing-Pricing-Anpassung)			
zum 30. September 2022			
Klasse A Thes.	USD	106,55	-
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	96,42	-
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	98,38	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	SGD	145,95	-
Klasse A1 Thes.	USD	105,88	-

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

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

Swing-Pricing (Forts.)

	Wahrung der An- teilsklasse	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Oaktree Credit
Klasse A2 Thes.	USD	-	89,93
Klasse A2 Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	-	87,70
Klasse A2 Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	-	87,86
Klasse A2 Aussch.	USD	-	92,80
Klasse A2 Aussch. (in CHF abgesichert)	CHF	-	91,87
Klasse A2 Aussch. (in EUR abgesichert)	EUR	-	97,60
Klasse A2 Aussch. (in GBP abgesichert)	GBP	-	92,41
Klasse C Thes.	USD	110,88	90,36
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	101,61	88,27
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	102,12	88,48
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	GBP	85,11	89,83
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	851,03	-
Klasse C Aussch.	USD	-	92,80
Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert)	CHF	-	91,86
Klasse C Aussch. (in EUR abgesichert)	EUR	-	97,59
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	GBP	-	92,40
Klasse E Thes.	USD	112,31	90,42
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	102,25	88,46
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	103,30	88,69
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	GBP	-	90,02
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	853,54	-
Klasse E Aussch.	USD	-	92,79
Klasse E Aussch. (in CHF abgesichert)	CHF	-	91,86
Klasse E Aussch. (in EUR abgesichert)	EUR	-	97,59
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	GBP	-	92,40
Klasse I Thes.	USD	-	91,39

Mindestanlage bei Erstzeichnung, Mindestanlage bei weiteren Zeichnungen und Mindestanlagebestand

Teilfonds	Anteilklassen	Mindestanlage bei Erstzeichnung		Mindestanlage bei Folgezeich- nungen		Mindestanlage- bestand	
Schroder GAIA BlueTrend	A-, C-, E- und N-Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000
Schroder GAIA Cat Bond	A-, C-, F- und PI*-Anteile	USD	100 000	USD	50 000	USD	100 000
	I-Anteile	USD	5 000 000	USD	2 500 000	USD	5 000 000
	IF-Anteile	USD	1 000 000	USD	500 000	USD	1 000 000
	Y*- und Y1*-Anteile	USD	100 000 000	USD	2 500 000	USD	100 000 000
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A-, A1-, C- und E-Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000
Schroder GAIA Egerton Equity	A-, A1-, C- und E-Anteile	EUR	10 000	EUR	5 000	EUR	10 000
	X-Anteile	EUR	100 000 000	EUR	2 500 000	EUR	100 000 000
Schroder GAIA Helix	A-, C-, C1-, E- und S*- Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000
	I-Anteile	USD	5 000 000	USD	2 500 000	USD	5 000 000
	IZ-Anteile	USD	100 000 000	USD	20 000 000	USD	100 000 000
	X-Anteile	USD	100 000 000	USD	2 500 000	USD	100 000 000
Schroder GAIA Oaktree Credit	A2-, C- und E-Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000
	I-Anteile	USD	5 000 000	USD	2 500 000	USD	5 000 000
Schroder GAIA Sirios US Equity	A-, C- und E-Anteile	USD	10 000	USD	5 000	USD	10 000
	X-Anteile	USD	100 000 000	USD	2 500 000	USD	100 000 000

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

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

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

Teilfonds	Anteilklassen	Mindestanlage bei Erstzeichnung		Mindestanlage bei Folgezeichnungen		Mindestanlagebestand	
Schroder GAIA 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.

Nettoinventarwert

Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil

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

Bewertung des Vermögens der Gesellschaft

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

Der Wert von Wertpapieren, derivativen Finanzinstrumenten und Vermögenswerten wird an dem jeweiligen Geschäftstag auf Basis der Schlusskurse an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt ermittelt, an der bzw. an dem diese Wertpapiere oder Vermögenswerte gehandelt werden oder zum Handel zugelassen sind. Bei 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 überprüfaren Bewertung unterzogen werden und können jederzeit auf Initiative der Gesellschaft zum beizulegenden Zeitwert veräußert, abgewickelt oder durch ein Gegengeschäft glattgestellt werden.

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

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

Fair Value Pricing

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

Zum 30. September 2022 wurde die Fair-Value-Anpassung auf die folgenden Wertpapiere angewandt:

Teilfonds	Wertpapiername
Schroder GAIA Cat Bond	Voussoir Re perpetual, variabel
Schroder GAIA Helix	CFD auf MAGNIT PJSC
	CFD auf TRINITY LIMITED
	Fix Price Group
	Softline Holding
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Clementia Pharmaceuticals

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

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. Des Weiteren muss die Gesellschaft möglicherweise Steuern auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge auf ihre Vermögenswerte im Ursprungsland zahlen, und entsprechende Rückstellungen werden in bestimmten Ländern möglicherweise anerkannt.

Managementgebühren

Die Anlageverwalter 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 das Berichtsjahr tatsächlich anfallenden Gebühren sind in der folgenden Tabelle dargestellt:

Teilfonds	Anteilsklasse	Verwaltungsgebühren
Schroder GAIA BlueTrend	A-Anteile	1,60%
	C-, E- und N-Anteile	1,00%
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Cat Bond	A- und F-Anteile	1,50%
	C- und IF-Anteile	1,10%
	PI*-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,10% (0,46%)
	Y*-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,10% (0,88%)
	Y1*-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,50% (1,28%)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A- und A1-Anteile	2,00%
	C-Anteile	1,25%
	E-Anteile	1,00%
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Egerton Equity	A- und A1-Anteile	2,00%
	C- und E-Anteile	1,25%
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25% (1,25%)
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Helix	A-Anteile	2,00%
	C-, C1- und IZ*-Anteile	1,00%
	E-Anteile	0,75%
	S*-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00% (0,35%)
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00% (0,60%)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Oaktree Credit	A2-Anteile	1,25%
	C-Anteile	0,75%
	E-Anteile	0,60%
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Sirios US Equity	A-Anteile	2,00%
	C-Anteile	1,25%
	E-Anteile	1,00%
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25% (1,25%)
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C-Anteile	1,40%
	K-Anteile	1,90%
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	C- und R-Anteile	0,75%
	K-Anteile	1,25%
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A- und A1*-Anteile	2,00%
	C- und C1-Anteile	1,25%
	E-Anteile	0,75%
	I*-Anteile	Entfällt

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

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

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

Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini, Bernard Herman und Eric Bertrand erhielten für das Berichtsjahr jeweils eine Vergütung in Höhe von 20 167 EUR. Hugh Mullan erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 16 000 EUR. Die verbleibenden Verwaltungsratsmitglieder verzichteten auf ihr Honorar.

Performancegebühren

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

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

Nähere Einzelheiten zur Berechnung der während des Berichtsjahres angefallenen Performancegebühren sind in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt. Weitere Angaben zur Berechnung der Performancegebühren sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Die für das Jahr zahlbaren Gebühren sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Fällige Performancegebühren“ ausgewiesen. Die während des Geschäftsjahres pro Anteilsklasse erhobenen Performancegebühren sind auf den Seiten 151–152 aufgeführt.

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

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

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

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

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

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

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

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

Gebühren der Verwahrstelle und der Verwaltungsstelle

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

Wiederanlage von Barsicherheiten

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

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

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

Devisenterminkontrakte

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

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

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Absicherung des Portfolios					
AUD	29 800 000	USD	19 900 566	19. Okt. 2022	(835 691)
AUD	3 025 000	USD	1 990 529	21. Okt. 2022	(55 200)
BRL	2 578 550	USD	491 635	21. Okt. 2022	(15 688)
BRL	97 924 007	USD	18 540 287	21. Dez. 2022	(711 643)
CAD	20 116 480	USD	15 056 212	19. Okt. 2022	(493 858)
CAD	2 860 000	USD	2 086 277	21. Okt. 2022	(15 932)
CHF	20 610 629	USD	21 417 568	19. Okt. 2022	(501 015)
CHF	18 775 000	USD	19 371 931	21. Okt. 2022	(314 751)
CLP	3 894 434 989	USD	4 196 486	21. Dez. 2022	(232 927)
CNH	13 055 206	USD	1 835 680	11. Okt. 2022	(6 861)
CNH	122 541 805	USD	17 306 016	19. Okt. 2022	(137 883)
CNH	47 693	USD	6 638	16. Nov. 2022	47
EUR	23 100 000	USD	22 753 757	19. Okt. 2022	(90 788)
EUR	5 239 000	USD	5 119 826	21. Okt. 2022	20 793
GBP	15 300 000	USD	16 864 169	19. Okt. 2022	224 694
GBP	1 950 000	USD	2 135 390	21. Okt. 2022	42 702
HKD	21 245 000	USD	2 708 049	21. Okt. 2022	(395)
HUF	2 930 954 185	USD	7 133 688	19. Okt. 2022	(373 928)
IDR	57 622 883 059	USD	3 858 601	21. Dez. 2022	(84 284)
ILS	357 393	USD	100 146	6. Okt. 2022	91
ILS	8 263 709	USD	2 389 997	19. Okt. 2022	(69 484)
INR	3 156 814 697	USD	39 151 725	21. Dez. 2022	(636 253)
JPY	2 159 954 478	USD	15 060 352	19. Okt. 2022	(115 214)
JPY	117 170 000	USD	811 805	21. Okt. 2022	(926)
KRW	23 076 735 059	USD	16 743 447	21. Dez. 2022	(562 419)
MXN	574 827 189	USD	28 704 436	19. Okt. 2022	(242 620)
NOK	112 983 668	USD	10 840 261	19. Okt. 2022	(463 315)
NZD	20 400 000	USD	11 630 865	19. Okt. 2022	(213 387)
PHP	483 771 779	USD	8 247 879	21. Dez. 2022	(10 941)
PLN	44 682 364	USD	9 298 161	19. Okt. 2022	(305 756)
SEK	184 150 368	USD	16 619 338	19. Okt. 2022	(14 551)
SEK	12 815 000	USD	1 175 969	21. Okt. 2022	(20 337)
SGD	51 498 192	USD	36 215 124	19. Okt. 2022	(353 996)
SGD	3 450 000	USD	2 409 370	21. Okt. 2022	(6 895)
SGD	84 635	USD	58 818	16. Nov. 2022	137

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
THB	861 773 292	USD	23 017 045	19. Okt. 2022	(154 087)
THB	4 676 907	USD	123 906	16. Nov. 2022	390
TWD	1 038 217 887	USD	33 720 632	21. Dez. 2022	(819 199)
USD	26 292 360	AUD	39 100 000	19. Okt. 2022	1 277 709
USD	2 864 804	AUD	4 330 000	21. Okt. 2022	94 564
USD	490 623	BRL	2 578 550	21. Okt. 2022	14 676
USD	150 666	BRL	792 523	22. Nov. 2022	5 425
USD	14 785 437	BRL	79 792 513	21. Dez. 2022	257 923
USD	30 215 701	CAD	39 855 096	19. Okt. 2022	1 364 529
USD	2 424 181	CAD	3 245 000	21. Okt. 2022	75 134
USD	32 171 874	CHF	31 229 376	19. Okt. 2022	478 956
USD	19 520 183	CHF	19 030 000	21. Okt. 2022	204 170
USD	10 310 599	CLP	9 874 189 574	21. Dez. 2022	261 148
USD	1 835 869	CNH	13 055 206	11. Okt. 2022	7 050
USD	17 722 269	CNH	122 541 805	19. Okt. 2022	554 137
USD	6 760 150	CNH	48 268 875	16. Nov. 2022	(5 720)
USD	9 227	CZK	230 000	21. Okt. 2022	79
USD	43 219 650	EUR	43 400 000	19. Okt. 2022	640 744
USD	3 917 009	EUR	3 950 000	21. Okt. 2022	41 185
USD	18 794 729	GBP	16 400 000	19. Okt. 2022	477 255
USD	334 819	GBP	295 000	21. Okt. 2022	5 313
USD	806 633	GBP	700 000	21. Jun. 2023	27 133
USD	2 075 294	HKD	16 280 000	21. Okt. 2022	425
USD	11 158 372	HUF	4 471 573 656	19. Okt. 2022	845 429
USD	5 156	HUF	2 125 000	21. Okt. 2022	258
USD	7 542 958	IDR	112 965 132 368	21. Dez. 2022	143 705
USD	13 966	ILS	49 516	6. Okt. 2022	78
USD	14 323 344	ILS	49 029 784	19. Okt. 2022	555 412
USD	40 522 107	INR	3 272 285 576	21. Dez. 2022	597 805
USD	37 920 384	JPY	5 471 988 988	19. Okt. 2022	58 643
USD	1 228 149	JPY	175 925 000	21. Okt. 2022	10 654
USD	3 062 800	KRW	4 269 343 884	21. Okt. 2022	77 803
USD	27 969 034	KRW	37 425 155 930	21. Dez. 2022	1 727 127
USD	8 167 991	MXN	166 448 962	19. Okt. 2022	(73 510)
USD	23 963 216	NOK	241 404 812	19. Okt. 2022	1 791 474
USD	21 496 063	NZD	35 900 000	19. Okt. 2022	1 403 535
USD	14 710	NZD	25 000	21. Okt. 2022	718
USD	15 503 567	PHP	876 341 096	21. Dez. 2022	582 550
USD	15 150 159	PLN	72 014 271	19. Okt. 2022	657 158
USD	88 307	PLN	425 000	21. Okt. 2022	2 806
USD	38 156 921	SEK	406 313 900	19. Okt. 2022	1 519 708
USD	1 256 163	SEK	13 560 000	21. Okt. 2022	33 348
USD	36 782 490	SGD	51 498 192	19. Okt. 2022	921 363
USD	2 419 421	SGD	3 465 000	21. Okt. 2022	6 500
USD	17 117 871	SGD	24 600 280	16. Nov. 2022	(18 174)
USD	23 650 896	THB	861 773 292	19. Okt. 2022	787 935
USD	385 464	THB	14 200 922	21. Okt. 2022	8 670
USD	9 790 832	THB	371 486 276	16. Nov. 2022	(82 097)
USD	151 355	TRY	2 855 000	21. Okt. 2022	1 100
USD	45 744 038	TWD	1 384 595 751	21. Dez. 2022	1865 788

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
USD	15 788 977	ZAR	275 389 165	19. Okt. 2022	595 268
USD	3 514 611	ZAR	63 175 000	21. Okt. 2022	29 794
ZAR	130 469 192	USD	7 379 564	19. Okt. 2022	(181 346)
ZAR	58 010 000	USD	3 242 209	21. Okt. 2022	(42 300)
					USD 12 037 667
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	240 692 929	USD	45 870 288	31. Okt. 2022	(1 551 111)
CHF	2 021 169	USD	2 065 599	31. Okt. 2022	(12 168)
EUR	107 235 692	USD	104 793 019	31. Okt. 2022	504 775
GBP	116 746 740	USD	130 419 158	31. Okt. 2022	13 053
SEK	38 982 139	USD	3 493 998	31. Okt. 2022	22 965
USD	511 236	BRL	2 773 086	31. Okt. 2022	623
USD	1 537	CHF	1 497	31. Okt. 2022	16
USD	904	EUR	919	31. Okt. 2022	2
USD	126 658	GBP	116 695	31. Okt. 2022	(3 717)
USD	-	SEK	3	31. Okt. 2022	-
					USD (1 025 562)
					USD 11 012 105
Schroder GAIA Cat Bond					
Absicherung des Portfolios					
USD	66 981 293	EUR	65 750 000	26. Okt. 2022	2 442 746
					USD 2 442 746
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	243 113 491	USD	248 422 989	31. Okt. 2022	(1 428 722)
EUR	709 526 237	USD	693 598 520	31. Okt. 2022	3 105 578
GBP	8 150 655	USD	8 868 577	31. Okt. 2022	237 526
JPY	1 285 994	USD	9 032	31. Okt. 2022	(124)
SEK	6 830 469 210	USD	612 580 622	31. Okt. 2022	3 663 300
SGD	388 369	USD	273 003	31. Okt. 2022	(2 530)
USD	28 128 685	CHF	27 533 066	31. Okt. 2022	156 114
USD	39 490 800	EUR	40 640 642	31. Okt. 2022	(415 408)
USD	51	GBP	46	31. Okt. 2022	-
USD	1 338 045	SEK	15 077 092	31. Okt. 2022	(22 208)
					USD 5 293 526
					USD 7 736 272
Schroder GAIA Contour Tech Equity					
Absicherung des Portfolios					
AUD	3 157 878	USD	2 164 325	10. Nov. 2022	(143 394)
EUR	1 096 257	USD	1 116 353	10. Nov. 2022	(39 131)
GBP	92 040	USD	99 679	10. Nov. 2022	3 160
JPY	369 394 679	USD	2 677 377	10. Nov. 2022	(115 677)
NOK	43 986 349	USD	4 477 743	10. Nov. 2022	(436 209)
USD	2 592 131	AUD	3 815 116	10. Nov. 2022	150 591
USD	1 116 918	EUR	1 096 257	10. Nov. 2022	39 696
USD	473 908	GBP	427 901	10. Nov. 2022	(4 197)
USD	2 852 525	JPY	395 338 523	10. Nov. 2022	110 908
USD	4 365 282	NOK	43 499 075	10. Nov. 2022	368 521
					USD (65 732)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2 828 495	USD	2 890 313	31. Okt. 2022	(16 667)

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)					
EUR	64 701 074	USD	63 264 923	31. Okt. 2022	266 912
GBP	15 385 498	USD	17 217 014	31. Okt. 2022	(27 973)
SEK	122 231 890	USD	10 960 364	31. Okt. 2022	67 379
SGD	774 906	USD	544 640	31. Okt. 2022	(4 969)
USD	11 083	CHF	10 838	31. Okt. 2022	71
USD	3 282 841	EUR	3 364 163	31. Okt. 2022	(20 526)
USD	300 739	GBP	275 035	31. Okt. 2022	(6 537)
USD	49 968	SEK	557 644	31. Okt. 2022	(342)
USD	1 870	SGD	2 663	31. Okt. 2022	15
					USD 257 363
					USD 191 631
Schroder GAIA Egerton Equity					
Absicherung des Portfolios					
CHF	6 069 000	EUR	6 239 077	13. Okt. 2022	38 034
CNY	23 531 000	EUR	3 403 532	14. Okt. 2022	(18 636)
EUR	58 088 038	CAD	75 601 000	13. Okt. 2022	2 279 732
EUR	2 231 069	GBP	1 939 000	13. Okt. 2022	22 948
EUR	4 104 135	HKD	31 865 000	13. Okt. 2022	(36 312)
EUR	13 242 208	JPY	1 867 244 000	13. Okt. 2022	75 228
EUR	5 910 360	SEK	632 960 000	13. Okt. 2022	92 020
EUR	501 848 047	USD	497 096 000	13. Okt. 2022	(5 052 938)
GBP	1 939 000	EUR	2 202 968	13. Okt. 2022	5 153
JPY	970 228 000	EUR	6 971 837	13. Okt. 2022	(130 218)
USD	59 441 000	EUR	60 725 308	13. Okt. 2022	(111 862)
					EUR (2 836 851)
Absicherung der Anteilsklasse					
EUR	1 461 111	GBP	1 311 605	31. Okt. 2022	(31 211)
EUR	5 324 168	USD	5 166 459	31. Okt. 2022	62 629
GBP	59 798 931	EUR	68 491 848	31. Okt. 2022	(453 547)
USD	216 907 356	EUR	221 820 231	31. Okt. 2022	(921 005)
					EUR (1 343 134)
					EUR (4 179 985)
Schroder GAIA Helix					
Absicherung des Portfolios					
AUD	27 537 000	USD	19 161 922	17. Nov. 2022	(1 446 213)
CAD	3 221 000	USD	2 503 815	17. Nov. 2022	(159 739)
CHF	10 528 000	EUR	10 849 854	17. Nov. 2022	78 935
CHF	9 213 000	USD	9 651 257	17. Nov. 2022	(251 560)
DKK	37 048 000	EUR	4 978 285	17. Nov. 2022	4 736
DKK	31 369 000	USD	4 320 448	17. Nov. 2022	(174 086)
EUR	4 112 789	CHF	3 915 000	17. Nov. 2022	47 399
EUR	4 591 917	DKK	34 146 000	17. Nov. 2022	(841)
EUR	2 035 151	GBP	1 771 927	17. Nov. 2022	20 567
EUR	1 451 871	NOK	14 888 000	17. Nov. 2022	59 676
EUR	90 993 44	SEK	96 833 000	17. Nov. 2022	197 164
EUR	124 000	USD	120 990	3. Nov. 2022	745
EUR	44 371 680	USD	45 085 053	17. Nov. 2022	(1 479 950)
GBP	1 766 135	EUR	2 084 330	17. Nov. 2022	(75 366)
GBP	31 801 639	USD	38 233 799	17. Nov. 2022	(2 708 107)
HKD	74 000	JPY	1 337 308	13. Okt. 2022	182

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Helix (Forts.)						
HKD	976 842 000	USD	124 740 102	17. Nov. 2022	(177 496)	
INR	675 713 610	USD	8 409 628	17. Nov. 2022	(140 824)	
JPY	4 594 069 344	USD	33 960 378	17. Nov. 2022	(2 078 907)	
NOK	43 190 000	EUR	4 287 537	17. Nov. 2022	(247 482)	
NOK	11 693 000	USD	1 193 407	17. Nov. 2022	(119 681)	
NZD	2 600 000	USD	1 621 052	17. Nov. 2022	(150 072)	
SEK	102 597 000	EUR	9 759 033	17. Nov. 2022	(324 909)	
SEK	91 083 569	USD	8 878 106	17. Nov. 2022	(652 359)	
SGD	19 498 000	USD	14 048 972	17. Nov. 2022	(454 097)	
USD	3 840 848	AUD	5 708 000	17. Nov. 2022	168 652	
USD	1 030 356	BRL	5 760 000	3. Nov. 2022	(26 554)	
USD	8 235 479	BRL	44 574 533	17. Nov. 2022	80 637	
USD	1 459 132	BRL	7 990 000	4. Jan. 2023	13 115	
USD	492 875	CAD	673 000	17. Nov. 2022	3 100	
USD	2 417 917	CHF	2 356 000	17. Nov. 2022	14 174	
USD	669 454	CLP	607 985 000	21. Nov. 2022	40 107	
USD	205 621	CZK	5 071 000	11. Okt. 2022	3 592	
USD	2 564 370	DKK	19 178 000	17. Nov. 2022	29 417	
USD	1 643 007	EUR	1 600 000	3. Nov. 2022	72 232	
USD	24 630 037	EUR	24 831 200	17. Nov. 2022	227 826	
USD	40 571 716	GBP	34 975 546	17. Nov. 2022	1 500 445	
USD	36 341 260	HKD	284 852 000	17. Nov. 2022	18 182	
USD	12 216 865	JPY	1 725 350 000	17. Nov. 2022	243 451	
USD	281 209	NOK	3 001 093	17. Nov. 2022	5 630	
USD	7 545	NZD	12 000	17. Nov. 2022	756	
USD	411 339	PLN	1 962 000	11. Okt. 2022	14 494	
USD	6 250 929	SEK	64 852 514	17. Nov. 2022	394 105	
USD	762 871	SGD	1 101 000	17. Nov. 2022	(4 796)	
					USD	(7 433 720)
Absicherung der Anteilsklasse						
CHF	5 887 090	USD	6 015 786	31. Okt. 2022	(34 721)	
EUR	239 144 157	USD	233 855 049	31. Okt. 2022	967 435	
GBP	165 105 984	USD	184 832 552	31. Okt. 2022	(372 256)	
JPY	1 224 601	USD	8 601	31. Okt. 2022	(118)	
SEK	132 432	USD	11 878	31. Okt. 2022	71	
SGD	29 632	USD	20 830	31. Okt. 2022	(193)	
USD	34 075	CHF	33 322	31. Okt. 2022	219	
USD	3 198 462	EUR	3 302 662	31. Okt. 2022	(44 515)	
USD	8 208 939	GBP	7 423 834	31. Okt. 2022	(85 142)	
USD	44	JPY	6 242	31. Okt. 2022	1	
USD	71	SEK	792	31. Okt. 2022	-	
USD	90	SGD	129	31. Okt. 2022	1	
					USD	430 782
					USD	(7 002 938)
Schroder GAIA Oaktree Credit						
Absicherung des Portfolios						
AUD	8 193	USD	5 302	20. Okt. 2022	(60)	
EUR	518 186	USD	506 540	20. Okt. 2022	1 880	
EUR	5 365	USD	5 496	19. Apr. 2023	(160)	
GBP	15 537	USD	18 407	20. Okt. 2022	(1 053)	

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Oaktree Credit (cont)					
JPY	70 011 200	USD	513 716	11. Okt. 2022	(29 671)
JPY	21 604 428	USD	158 713	24. Okt. 2022	(9 156)
JPY	69 617 400	USD	510 859	7. Nov. 2022	(28 238)
USD	1 020 178	AUD	1 520 815	20. Okt. 2022	47 207
USD	5 018 277	EUR	4 901 525	20. Okt. 2022	209 139
USD	6 049 891	EUR	5 509 431	19. Apr. 2023	571 049
USD	2 151 462	GBP	1 805 590	20. Okt. 2022	134 717
USD	556 355	JPY	74 222 333	11. Okt. 2022	43 195
USD	213 359	JPY	29 206 183	24. Okt. 2022	11 177
USD	1 154 070	JPY	152 001 825	7. Nov. 2022	100 321
					USD 1 050 347
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	103 340	USD	105 599	31. Okt. 2022	(609)
EUR	4 555 650	USD	4 454 779	31. Okt. 2022	18 546
GBP	47 489	USD	53 163	31. Okt. 2022	(108)
USD	3 262	CHF	3 197	31. Okt. 2022	14
USD	133 790	EUR	137 292	31. Okt. 2022	(1 024)
USD	1 546	GBP	1 405	31. Okt. 2022	(22)
					USD 16 797
					USD 1 067 144
Schroder GAIA Sirius US Equity					
Absicherung des Portfolios					
CAD	395 000	USD	288 361	21. Dez. 2022	(2 299)
CHF	597 000	USD	623 871	21. Dez. 2022	(13 782)
DKK	4 014 000	USD	541 021	21. Dez. 2022	(8 508)
EUR	10 061 000	USD	9 881 511	21. Dez. 2022	41 235
SEK	4 468 000	USD	401 841	21. Dez. 2022	2 845
USD	4 006 573	CAD	5 354 000	21. Dez. 2022	129 164
USD	273 734	DKK	2 086 000	21. Dez. 2022	(3 002)
USD	15 713 777	EUR	15 677 000	21. Dez. 2022	252 203
USD	16 961 179	GBP	15 070 000	21. Dez. 2022	114 174
USD	4 997 371	SEK	54 370 000	21. Dez. 2022	72 847
					USD 584 877
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2 950 906	USD	3 015 415	31. Okt. 2022	(17 404)
EUR	45 287 078	USD	44 282 973	31. Okt. 2022	185 703
GBP	8 003 444	USD	8 959 831	31. Okt. 2022	(18 195)
USD	66 030	CHF	64 950	31. Okt. 2022	44
USD	1 905 172	EUR	1 965 096	31. Okt. 2022	(24 414)
USD	451 855	GBP	418 664	31. Okt. 2022	(15 886)
					USD 109 848
					USD 694 725
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
AUD	10 871 001	USD	7 323 922	21. Dez. 2022	(360 384)
BRL	4 831 206	USD	913 404	11. Okt. 2022	(19 490)
BRL	4 831 206	USD	897 994	31. Okt. 2022	(8 416)
CAD	6 538 571	USD	4 973 900	21. Dez. 2022	(238 614)
CHF	3 579 044	USD	3 696 433	21. Dez. 2022	(38 916)
CNH	29 696 160	USD	4 270 440	21. Dez. 2022	(104 062)

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)						
CZK	7 261 459	USD	292 185	21. Dez. 2022	(4 657)	
GBP	9 115 003	USD	10 407 220	21. Dez. 2022	(217 405)	
ILS	532 724	USD	156 644	21. Dez. 2022	(6 190)	
INR	580 429	USD	7 122	6. Okt. 2022	12	
JPY	1 327 021 195	USD	9 315 697	21. Dez. 2022	(62 346)	
MXN	128 382 635	USD	6 297 309	21. Dez. 2022	(13 788)	
NOK	13 392 484	USD	1 334 940	21. Dez. 2022	(102 563)	
NZD	7 821 243	USD	4 724 602	21. Dez. 2022	(345 426)	
PLN	7 466 416	USD	1 553 839	21. Dez. 2022	(67 960)	
SEK	13 828 772	USD	1 296 791	21. Dez. 2022	(44 260)	
SGD	8 102 930	USD	5 767 864	21. Dez. 2022	(119 963)	
TWD	3 409 000	USD	107 571	6. Okt. 2022	(187)	
TWD	2 215 661	USD	71 972	21. Dez. 2022	(1 757)	
USD	6 635 444	AUD	9 846 185	21. Dez. 2022	328 363	
USD	901 832	BRL	4 831 206	11. Okt. 2022	7 918	
USD	15 697 198	CAD	20 624 804	21. Dez. 2022	760 552	
USD	1 843 697	CHF	1 784 037	21. Dez. 2022	20 544	
USD	1 796 927	CNH	12 488 100	21. Dez. 2022	44 844	
USD	66 358 214	EUR	66 000 000	21. Dez. 2022	1 265 155	
USD	11 691 230	GBP	10 156 925	21. Dez. 2022	336 633	
USD	587 499	HUF	239 934 747	21. Dez. 2022	43973	
USD	560 138	ILS	1 908 000	21. Dez. 2022	21 271	
USD	7 256	INR	580 429	6. Okt. 2022	122	
USD	7 104	INR	580 429	31. Okt. 2022	(10)	
USD	14 118 250	JPY	2 012 791 505	21. Dez. 2022	83 006	
USD	2 602 274	KRW	3 600 506 566	21. Dez. 2022	77 658	
USD	2 916 812	MXN	59 478 178	21. Dez. 2022	5 730	
USD	2 382 090	NOK	23 824 536	21. Dez. 2022	189 753	
USD	2 004 398	NZD	3 319 081	21. Dez. 2022	146 018	
USD	553 902	PLN	2 659 426	21. Dez. 2022	24 654	
USD	1 658 866	SEK	17 694 924	21. Dez. 2022	56161	
USD	3 480 753	SGD	4 906 313	21. Dez. 2022	60 957	
USD	111 814	TWD	3 409 000	6. Okt. 2022	4 431	
USD	107 602	TWD	3 409 000	31. Okt. 2022	76	
USD	1 368 752	ZAR	23 953 911	21. Dez. 2022	54 616	
ZAR	27 635 984	USD	1 574 336	21. Dez. 2022	(58 198)	
					USD	1 717 855
Absicherung der Anteilsklasse						
CHF	4 263 396	USD	4 356 787	31. Okt. 2022	(25 335)	
EUR	148 207 306	USD	144 921 926	31. Okt. 2022	607 065	
GBP	168 863 262	USD	188 941 204	31. Okt. 2022	(283 188)	
USD	347 037	EUR	355 713	31. Okt. 2022	(2 247)	
USD	455 653	GBP	418 524	31. Okt. 2022	(11 932)	
					USD	284 363
					USD	2 002 218
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund						
Absicherung der Anteilsklasse						
CHF	362 017	GBP	332 691	31. Okt. 2022	(3 486)	
EUR	15 238 059	GBP	13 305 157	31. Okt. 2022	87582	
GBP	3 915	CHF	4 174	31. Okt. 2022	120	

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund (Forts.)					
GBP	193 595	EUR	216 767	31. Okt. 2022	3 078
GBP	15 273	USD	16 500	31. Okt. 2022	504
USD	1 474 495	GBP	1 317 202	31. Okt. 2022	2 581
					GBP
					90 379
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Absicherung des Portfolios					
AUD	139 085 000	USD	92 186 173	7. Okt. 2022	(3 217 953)
AUD	3 560 000	USD	2 290 031	7. Nov. 2022	(11 870)
AUD	1 006 000	USD	694 643	30. Nov. 2022	(50 621)
AUD	140 000	USD	93 573	21. Dez. 2022	(3 894)
AUD	1 634 000	USD	1 063 734	28. Dez. 2022	(16 836)
BRL	71 885 000	USD	13 729 831	4. Okt. 2022	(403 851)
BRL	805 000	USD	148 465	3. Nov. 2022	(347)
BRL	3 013 000	USD	554 370	7. Nov. 2022	(452)
BRL	4 060 000	USD	774 809	18. Nov. 2022	(30 132)
BRL	17 665 000	USD	3 371 374	2. Dez. 2022	(140 792)
BRL	6 038 000	USD	1 150 373	26. Jan. 2023	(59 530)
BRL	4 825 000	USD	859 765	30. Jan. 2023	11 223
BRL	3 475 000	USD	595 544	10. Feb. 2023	30 343
CAD	250 000	USD	194 001	3. Okt. 2022	(13 019)
CAD	300 000	USD	233 448	4. Okt. 2022	(16 269)
CAD	49 313 734	USD	36 291 497	7. Okt. 2022	(592 012)
CAD	300 000	USD	232 795	11. Okt. 2022	(15 619)
CAD	350 000	USD	271 594	12. Okt. 2022	(18 223)
CAD	3 550 000	USD	2 590 914	7. Nov. 2022	(21 150)
CAD	500 000	USD	387 994	9. Nov. 2022	(26 052)
CAD	2 216 000	USD	1 665 598	21. Dez. 2022	(60 754)
CAD	1 474 000	USD	1 071 961	4. Jan. 2023	(4 206)
CHF	33 981 035	USD	34 810 459	7. Okt. 2022	(362 374)
CHF	9 065 000	USD	9 238 480	7. Nov. 2022	(22 373)
CHF	813 000	USD	839 227	21. Dez. 2022	(8 402)
CLP	12 351 331 000	USD	13 132 805	7. Okt. 2022	(376 631)
CLP	837 005 000	USD	855 833	12. Okt. 2022	8 150
CLP	1 198 563 000	USD	1 156 914	14. Okt. 2022	79 836
CLP	144 483 000	USD	151 927	20. Okt. 2022	(3 002)
CLP	961 191 000	USD	1 057 998	3. Nov. 2022	(69 738)
CLP	1 95 100 000	USD	202 491	7. Nov. 2022	(2 063)
CLP	1 176 713 000	USD	1 344 815	7. Dez. 2022	(143 507)
CLP	2 112 027 000	USD	2 228 349	21. Dez. 2022	(78 834)
CLP	1 883 466 000	USD	1 893 250	27. Dez. 2022	21 114
CNH	17 713 000	USD	2 469 551	7. Nov. 2022	12 812
CNH	70 783 000	USD	10 097 790	21. Dez. 2022	(166 920)
CNY	2 156 000	USD	303 054	21. Dez. 2022	2 104
COP	10 821 200 000	USD	2 409 168	7. Okt. 2022	(63 158)
COP	1 869 162 000	USD	485 497	11. Okt. 2022	(80 570)
COP	2 556 261 000	USD	574 402	12. Okt. 2022	(20 742)
COP	10 644 689 000	USD	2 333 850	4. Nov. 2022	(39 301)
COP	3 884 046 000	USD	862 546	16. Dez. 2022	(31 670)
COP	5 651 950 000	USD	1 253 615	21. Dez. 2022	(45 580)
CZK	593 031 880	USD	24 050 181	7. Okt. 2022	(427 660)

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
CZK	7 640 000	USD	306 833	21. Dez. 2022	(4 315)
DKK	178 000	USD	23 168	28. Okt. 2022	336
DKK	2 890 000	USD	391 152	21. Dez. 2022	(7 754)
EUR	141 538 000	USD	140 553 672	7. Okt. 2022	(1 811 060)
EUR	4 160 000	USD	4 224 484	11. Okt. 2022	(145 538)
EUR	793 000	USD	794 269	14. Okt. 2022	(16 552)
EUR	4 983 000	USD	4 812 178	28. Okt. 2022	79 714
EUR	1 657 000	USD	1 599 012	31. Okt. 2022	28 044
EUR	2 698 000	USD	2 608 966	2. Nov. 2022	40 660
EUR	42 458 000	USD	41 114 385	7. Nov. 2022	597 351
EUR	1 476 000	USD	1 489 579	1. Dez. 2022	(37 012)
EUR	1 921 000	USD	1 867 945	16. Dez. 2022	25 593
EUR	177 000	USD	177 885	19. Dez. 2022	(3 357)
EUR	8 584 000	USD	8 533 643	21. Dez. 2022	(67 600)
EUR	2 398 000	USD	2 315 029	5. Jan. 2023	53 679
GBP	47 831 000	USD	54 150 079	7. Okt. 2022	(740 979)
GBP	836 000	USD	1 052 932	11. Okt. 2022	(119 357)
GBP	986 000	USD	1 057 081	28. Okt. 2022	44 427
GBP	40 440 000	USD	43 593 291	7. Nov. 2022	1 590 964
GBP	3 897 000	USD	4 473 439	21. Dez. 2022	(116 917)
GBP	1 663 000	USD	1 779 077	5. Jan. 2023	80 471
HKD	4 338 000	USD	552 682	7. Okt. 2022	(2)
HKD	4 045 000	USD	516 204	21. Dez. 2022	(182)
HUF	5 545 372 000	USD	13 458 581	7. Okt. 2022	(622 802)
HUF	153 700 000	USD	366 314	17. Okt. 2022	(11 610)
HUF	682 816 000	USD	1 680 571	28. Okt. 2022	(110 170)
HUF	292 672 000	USD	671 882	7. Nov. 2022	(812)
HUF	217 984 000	USD	536 048	21. Nov. 2022	(38 281)
HUF	73 066 000	USD	175 800	19. Dez. 2022	(10 201)
HUF	1 919 819 000	USD	4 677 553	21. Dez. 2022	(328 572)
HUF	764 073 000	USD	1 766 847	27. Dez. 2022	(38 567)
HUF	537 588 000	USD	1 215 410	9. Jan. 2023	(3 406)
IDR	55 203 000 000	USD	3 677 963	7. Okt. 2022	(53 052)
IDR	18 770 000 000	USD	1 252 837	21. Dez. 2022	(23 396)
IDR	104 598 000 000	USD	7 062 660	21. Feb. 2023	(226 934)
ILS	2 155 000	USD	619 354	3. Okt. 2022	(15 078)
ILS	16 920 629	USD	5 001 906	7. Okt. 2022	(255 733)
ILS	8 993 773	USD	2 571 041	7. Nov. 2022	(41 404)
ILS	1 135 000	USD	342 642	2. Dez. 2022	(22 708)
ILS	3 715 000	USD	1 106 258	21. Dez. 2022	(57 049)
INR	1 658 485 000	USD	20 536 988	7. Okt. 2022	(156 713)
INR	124 159 000	USD	1 553 191	7. Nov. 2022	(32 382)
INR	60 945 000	USD	758 494	18. Nov. 2022	(12 773)
INR	297 269 000	USD	3 652 590	21. Dez. 2022	(25 689)
INR	144 217 000	USD	1 746 603	5. Jan. 2023	10 868
JPY	14 390 348 669	USD	101 078 160	7. Okt. 2022	(1 622 111)
JPY	2 151 615 226	USD	14 934 711	7. Nov. 2022	(18 700)
JPY	418 600 000	USD	2 938 369	21. Dez. 2022	(19 461)
KRW	26 346 800 000	USD	19 115 140	7. Okt. 2022	(698 991)

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
KRW	1 123 414 000	USD	889 516	4. Nov. 2022	(103 828)
KRW	2 605 713 000	USD	1 892 292	7. Nov. 2022	(69 724)
KRW	1 234 335 000	USD	918 062	30. Nov. 2022	(53 988)
KRW	262 509 000	USD	189 469	13. Dez. 2022	(5 527)
KRW	3 355 952 000	USD	2 401 816	21. Dez. 2022	(48 677)
MXN	7 870 000	USD	388 259	6. Okt. 2022	2 373
MXN	637 533 638	USD	31 605 148	7. Okt. 2022	33 431
MXN	46 241 000	USD	2 309 798	14. Okt. 2022	(18 020)
MXN	522 718 641	USD	25 822 837	7. Nov. 2022	(35 345)
MXN	61 573 000	USD	3 018 144	21. Dez. 2022	(4 535)
NOK	236 491 000	USD	23 546 056	7. Okt. 2022	(1 827 048)
NOK	104 785 000	USD	9 602 299	7. Nov. 2022	24 515
NZD	84 180 000	USD	50 599 628	7. Okt. 2022	(3 487 445)
NZD	35 183 000	USD	19 878 783	7. Nov. 2022	(186 489)
NZD	1 223 000	USD	750 922	30. Nov. 2022	(66 271)
NZD	28 000	USD	16 496	21. Dez. 2022	(818)
NZD	1 845 000	USD	1 082 093	28. Dez. 2022	(49 003)
PEN	14 898 000	USD	3 744 627	7. Okt. 2022	(6 477)
PEN	1 660 000	USD	422 166	21. Dez. 2022	(9 233)
PHP	187 830 000	USD	3 171 197	7. Okt. 2022	32 480
PHP	108 221 000	USD	1 913 722	2. Dez. 2022	(70 209)
PHP	105 448 000	USD	1 803 247	21. Dez. 2022	(7 837)
PHP	128 521 000	USD	2 158 203	4. Jan. 2023	29 272
PLN	102 255 000	USD	21 524 751	7. Okt. 2022	(904 845)
PLN	2 686 000	USD	563 373	11. Okt. 2022	(22 048)
PLN	51 985 000	USD	10 263 027	7. Nov. 2022	165 099
PLN	73 540 000	USD	16 154 209	17. Nov. 2022	(1 424 715)
PLN	2 619 000	USD	556 642	21. Nov. 2022	(32 397)
PLN	16 667 000	USD	3 470 783	21. Dez. 2022	(153 912)
PLN	2 264 000	USD	475 760	22. Dez. 2022	(25 305)
PLN	6 231 000	USD	1 222 220	9. Jan. 2023	13 342
PLN	9 086 000	USD	1 874 220	12. Jan. 2023	(73 266)
RON	2 520 000	USD	510 328	21. Dez. 2022	(16 591)
SEK	161 183 117	USD	14 946 682	7. Okt. 2022	(420 729)
SEK	125 086 000	USD	11 053 009	7. Nov. 2022	236 511
SGD	14 573 571	USD	10 169 826	7. Okt. 2022	(22 569)
SGD	920 000	USD	657 333	21. Dez. 2022	(16 074)
THB	565 859 400	USD	14 914 586	7. Okt. 2022	88 821
THB	80 145 000	USD	2 189 535	17. Okt. 2022	(63 507)
THB	73 107 000	USD	1 994 190	2. Nov. 2022	(53 186)
THB	12 329 000	USD	337 134	19. Dez. 2022	(8 431)
THB	146 346 000	USD	3 985 121	21. Dez. 2022	(82 458)
THB	26 860 000	USD	713 982	5. Jan. 2023	3 557
TRY	49 226 000	USD	2 624 046	7. Okt. 2022	23 585
TRY	296 000	USD	15 191	7. Nov. 2022	24
TRY	24 760 000	USD	1 315 167	14. Nov. 2022	(53 717)
TRY	5 247 000	USD	257 332	21. Nov. 2022	7 646
TRY	4 027 000	USD	201 855	21. Dez. 2022	(5 258)
TWD	760 656 000	USD	24 237 294	7. Okt. 2022	(275 376)

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
TWD	16 955 000	USD	533 069	28. Okt. 2022	1 634
TWD	25 610 000	USD	804 082	7. Nov. 2022	4 092
TWD	42 470 000	USD	1 355 996	21. Dez. 2022	(10 110)
USD	94 257 565	AUD	139 085 000	7. Okt. 2022	5 289 342
USD	45 224 507	AUD	69 865 000	7. Nov. 2022	515 599
USD	264 835	AUD	407 000	30. Nov. 2022	4 281
USD	2 609 594	AUD	3 921 000	21. Dez. 2022	97 954
USD	13 608 375	BRL	71 885 000	4. Okt. 2022	282 394
USD	8 312 460	BRL	45 162 000	3. Nov. 2022	2 755
USD	1 875 474	BRL	9 941 000	2. Dez. 2022	57 460
USD	902 057	BRL	4 605 000	10. Feb. 2023	72 644
USD	596 820	CAD	750 000	3. Okt. 2022	53 873
USD	460 718	CAD	600 000	4. Okt. 2022	26 360
USD	36 950 158	CAD	49 240 897	7. Okt. 2022	1 303 401
USD	1 082 766	CAD	1 400 000	11. Okt. 2022	69 277
USD	732 874	CAD	950 000	12. Okt. 2022	45 151
USD	541 468	CAD	700 000	13. Okt. 2022	34 726
USD	385 882	CAD	500 000	17. Okt. 2022	23 928
USD	2 633 725	CAD	3 450 000	19. Okt. 2022	136 262
USD	1 087 036	CAD	1 395 000	25. Okt. 2022	77 213
USD	857 338	CAD	1 100 000	27. Okt. 2022	61 067
USD	1 475 860	CAD	1 975 000	28. Okt. 2022	46 197
USD	80 000	CAD	100 000	1. Nov. 2022	7 613
USD	1 162 335	CAD	1 500 000	2. Nov. 2022	76 534
USD	26 837 732	CAD	36 818 903	7. Nov. 2022	185 372
USD	534 359	CAD	700 000	8. Nov. 2022	27 642
USD	945 550	CAD	1 200 000	9. Nov. 2022	76 891
USD	872 342	CAD	1 150 000	10. Nov. 2022	39 873
USD	382 664	CAD	500 000	15. Nov. 2022	20 713
USD	1 880 125	CAD	2 450 000	16. Nov. 2022	106 558
USD	1 129 450	CAD	1 500 000	18. Nov. 2022	43 585
USD	770 746	CAD	1 000 000	22. Nov. 2022	46 824
USD	769 902	CAD	1 000 000	28. Nov. 2022	45 961
USD	234 054	CAD	300 000	1. Dez. 2022	16 869
USD	1 458 982	CAD	1 910 000	6. Dez. 2022	76 146
USD	792 130	CAD	1 047 000	7. Dez. 2022	34 090
USD	7 099 187	CAD	9 457 000	21. Dez. 2022	250 354
USD	256 388	CAD	340 000	6. Mrz. 2023	9 921
USD	594 777	CAD	750 000	10. Apr. 2023	50 864
USD	317 158	CAD	400 000	11. Mai 2023	26 933
USD	533 649	CAD	700 000	15. Aug. 2023	25 085
USD	763 302	CAD	1 000 000	1. Sept. 2023	36 633
USD	989 996	CAD	1 300 000	8. Sept. 2023	45 247
USD	228 482	CAD	310 000	25. Sept. 2023	3 150
USD	34 820 357	CHF	33 968 598	7. Okt. 2022	384 882
USD	9 797 241	CHF	9 619 764	7. Nov. 2022	17 121
USD	335 630	CHF	320 000	21. Dez. 2022	8 614
USD	13 884 026	CLP	12 351 331 000	7. Okt. 2022	1 127 851
USD	562 231	CLP	485 768 000	12. Okt. 2022	60 806

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	723 409	CLP	654 794 000	14. Okt. 2022	47 753
USD	273 516	CLP	257 981 000	20. Okt. 2022	7 603
USD	387 756	CLP	382 909 000	3. Nov. 2022	(5 936)
USD	5 810 411	CLP	5 598 331 000	7. Nov. 2022	59 193
USD	399 157	CLP	356 048 000	1. Dez. 2022	35 195
USD	863 950	CLP	813 409 000	7. Dez. 2022	33 540
USD	3 193 176	CLP	3 097 727 000	21. Dez. 2022	40 466
USD	3 662 986	CNH	25 542 000	14. Okt. 2022	84 813
USD	28 597 815	CNH	204 633 635	7. Nov. 2022	(80 268)
USD	2 200 175	CNH	15 702 000	16. Dez. 2022	(2 475)
USD	4 590 943	CNH	32 043 000	21. Dez. 2022	95 303
USD	172 650	CNH	1 236 000	29. Dez. 2022	(805)
USD	1 003 908	CNY	7 121 000	21. Dez. 2022	(3 990)
USD	2 385 910	COP	10 821 200 000	7. Okt. 2022	39 900
USD	56 729	COP	252 420 000	11. Okt. 2022	2 046
USD	858 579	COP	3 814 325 000	12. Okt. 2022	32 435
USD	880 738	COP	4 056 000 000	4. Nov. 2022	6 435
USD	182 331	COP	824 200 000	21. Dez. 2022	6 168
USD	23 899 338	CZK	591 553 364	7. Okt. 2022	335 713
USD	9 380 460	CZK	240 487 681	7. Nov. 2022	(166 853)
USD	3 691 973	CZK	92 408 000	21. Dez. 2022	32 944
USD	524 051	DKK	3 875 000	21. Dez. 2022	9 979
USD	140 790 203	EUR	141 538 000	7. Okt. 2022	2 047 588
USD	2 070 277	EUR	2 048 000	11. Okt. 2022	62 179
USD	33 496 233	EUR	34 617 000	28. Okt. 2022	(487 849)
USD	5 351 666	EUR	5 545 000	31. Okt. 2022	(93 127)
USD	1 243 457	EUR	1 209 000	2. Nov. 2022	56 133
USD	33 744 135	EUR	34 875 000	7. Nov. 2022	(517 883)
USD	630 875	EUR	656 000	1. Dez. 2022	(14 710)
USD	21 855 790	EUR	21 874 000	21. Dez. 2022	282 372
USD	475 601	EUR	472 000	22. Dez. 2022	10 035
USD	1 352 324	EUR	1 393 000	27. Dez. 2022	(22 461)
USD	53 557 036	GBP	47831000	7. Okt. 2022	147 934
USD	1 046 129	GBP	836 000	11. Okt. 2022	112 553
USD	10 278 148	GBP	9 504 000	28. Okt. 2022	(339 223)
USD	20 675 653	GBP	19 104 000	7. Nov. 2022	(669 550)
USD	4 090 791	GBP	3 585 000	21. Dez. 2022	83 060
USD	553 033	HKD	4 338 000	7. Okt. 2022	354
USD	899 890	HKD	7 060 000	28. Okt. 2022	(56)
USD	789 534	HKD	6 193 000	7. Nov. 2022	(64)
USD	1 599 762	HKD	12 536 000	21. Dez. 2022	538
USD	13 557 027	HUF	5 545 372 000	7. Okt. 2022	721 246
USD	976 929	HUF	399 173 000	17. Okt. 2022	55 729
USD	964 343	HUF	410 810 000	28. Okt. 2022	19 525
USD	8 087 963	HUF	34 88 774 000	7. Nov. 2022	88 518
USD	227 813	HUF	99 782 000	21. Nov. 2022	(40)
USD	5 373 269	HUF	2 290 958 000	21. Dez. 2022	183 543
USD	3 689 520	IDR	55 203 000 000	7. Okt. 2022	64 609
USD	2 626 794	IDR	40 025 000 000	7. Nov. 2022	1 217

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	3 07 630	IDR	51 274 000 000	21. Dez. 2022	49 167
USD	7 141 989	IDR	104 598 000 000	21. Feb. 2023	306 263
USD	2 160 445	ILS	7 315 000	3. Okt. 2022	109 272
USD	4 981 040	ILS	16 971 921	7. Okt. 2022	220 480
USD	1 594 335	ILS	5 635 000	7. Nov. 2022	9 404
USD	297 912	ILS	1 020 000	2. Dez. 2022	10 394
USD	4 425 092	ILS	15 335 000	21. Dez. 2022	94 105
USD	20 636 410	INR	1 658 485 000	7. Okt. 2022	256 133
USD	527 968	INR	43 230 000	28. Okt. 2022	(2 089)
USD	9 711 604	INR	799 435 000	7. Nov. 2022	(80 583)
USD	1 066 251	INR	85 960 000	21. Dez. 2022	17 475
USD	2 105 326	JPY	282 400 000	3. Okt. 2022	154 106
USD	101 270 073	JPY	14 389 125 429	7. Okt. 2022	1 822 476
USD	1 056 961	JPY	142 400 000	11. Okt. 2022	72 434
USD	2 696 599	JPY	372 100 000	17. Okt. 2022	122 468
USD	692 331	JPY	94 600 000	24. Okt. 2022	37 458
USD	1 724 802	JPY	2475 00 000	28. Okt. 2022	10 804
USD	837 366	JPY	111 000 000	31. Okt. 2022	68 439
USD	13 993 460	JPY	2 010 773 000	7. Nov. 2022	53 833
USD	1 706 643	JPY	225 550 000	14. Nov. 2022	141 768
USD	2 385 203	JPY	322 550 000	21. Nov. 2022	145 536
USD	1 025 213	JPY	139 000 000	28. Nov. 2022	59 272
USD	2 758 830	JPY	383 500 000	5. Dez. 2022	91 431
USD	1 040 319	JPY	147 200 000	12. Dez. 2022	15 350
USD	4 103 772	JPY	583 000 000	19. Dez. 2022	39 785
USD	3 162 829	JPY	448 301 000	21. Dez. 2022	36 816
USD	4 631 911	JPY	657 850 000	6. Jan. 2023	33 533
USD	664 356	JPY	88650000	10. Jan. 2023	44 361
USD	2 146 703	JPY	307 000 000	11. Jan. 2023	(658)
USD	1 736 653	JPY	245 000 000	10. Mrz. 2023	9 635
USD	1 227 458	JPY	172 650 000	20. Apr. 2023	3 597
USD	19 305 443	KRW	26 346 800 000	7. Okt. 2022	889 295
USD	492 084	KRW	629 621 000	4. Nov. 2022	51 743
USD	4 652 929	KRW	6 675 707 000	7. Nov. 2022	(16 399)
USD	235 754	KRW	328 877 000	30. Nov. 2022	5 530
USD	5 143 502	KRW	7 168 819 000	21. Dez. 2022	116 845
USD	391 009	MXN	7 870 000	6. Okt. 2022	377
USD	31 633 762	MXN	637 389 062	7. Okt. 2022	2 359
USD	796 236	MXN	16 924 000	14. Okt. 2022	(42 544)
USD	3 818 052	MXN	78 180 000	7. Nov. 2022	(38 834)
USD	670 361	MXN	13 790 000	28. Nov. 2022	(7 272)
USD	445 242	MXN	9 123 000	30. Nov. 2022	(2 890)
USD	1 273 988	MXN	25 811 000	19. Dez. 2022	10 274
USD	2 521 432	MXN	51 222 000	21. Dez. 2022	14 438
USD	533 269	MXN	11 004 000	21. Feb. 2023	837
USD	22 727 210	NOK	236 491 000	7. Okt. 2022	1 008 204
USD	2 049 146	NOK	22 243 000	7. Nov. 2022	5 635
USD	210 880	NOK	2 110 000	21. Dez. 2022	16 718
USD	49 951 199	NZD	84 180 000	7. Okt. 2022	2 839 015

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
USD	18 912 430	NZD	33 325 000	7. Nov. 2022	260 078	
USD	365 664	NZD	624 000	30. Nov. 2022	16 341	
USD	1 584 380	NZD	2 675 000	21. Dez. 2022	86 626	
USD	3 821 472	PEN	14 898 000	7. Okt. 2022	83 321	
USD	5 645 589	PEN	22 543 000	7. Nov. 2022	13 172	
USD	3 266 898	PEN	12 858 000	21. Dez. 2022	68 406	
USD	3 321 436	PHP	187 830 000	7. Okt. 2022	117 759	
USD	3 159 727	PHP	187 830 000	7. Nov. 2022	(41 720)	
USD	218 670	PHP	12 989 000	2. Dez. 2022	(2 594)	
USD	5 474 980	PHP	316 620 000	21. Dez. 2022	84 052	
USD	20 919 480	PLN	102 255 000	7. Okt. 2022	299 574	
USD	1 337 987	PLN	6 310 000	11. Okt. 2022	66 297	
USD	3 473 855	PLN	17 460 000	7. Nov. 2022	(28 599)	
USD	17 041 246	PLN	77 030 000	17. Nov. 2022	1 612 733	
USD	166 831	PLN	845 000	21. Nov. 2022	(2 312)	
USD	4 337 604	PLN	21 450 000	21. Dez. 2022	68 877	
USD	481 054	RON	2 520 000	21. Dez. 2022	(12 684)	
USD	14 605 357	SEK	160 305 840	07. Okt. 2022	158 464	
USD	897 487	SEK	10 099 000	28. Okt. 2022	(13 516)	
USD	5 874 381	SEK	66 041 301	7. Nov. 2022	(86 116)	
USD	692 271	SEK	7 384 000	21. Dez. 2022	23 471	
USD	10 316 822	SGD	14 421 387	7. Okt. 2022	275 528	
USD	8 375 464	SGD	12 102 380	7. Nov. 2022	(53 750)	
USD	2 799 562	SGD	3 950 000	21. Dez. 2022	46 334	
USD	15 413 413	THB	564 737 100	7. Okt. 2022	439 763	
USD	583 897	THB	22 083 000	2. Nov. 2022	(2 410)	
USD	14 918 292	THB	565 850 800	7. Nov. 2022	(110 347)	
USD	12 451 894	THB	463 220 000	21. Dez. 2022	99 028	
USD	2 632 435	TRY	49 226 000	7. Okt. 2022	(15 195)	
USD	425 255	TRY	8 315 000	14. Nov. 2022	1 630	
USD	119 718	TRY	2 380 000	21. Nov. 2022	(474)	
USD	3 709 951	TRY	74 261 000	21. Dez. 2022	84 553	
USD	24 827 180	TWD	760 656 000	7. Okt. 2022	865 262	
USD	7 176 796	TWD	228 896 000	7. Nov. 2022	(46 466)	
USD	1 945 407	TWD	60 410 000	21. Dez. 2022	30 995	
USD	29 641 349	ZAR	527 468 440	7. Okt. 2022	507 370	
USD	1 529 591	ZAR	26 738 000	17. Okt. 2022	54 128	
USD	434 766	ZAR	7 830 000	7. Nov. 2022	3 531	
USD	406 685	ZAR	7 180 000	19. Dez. 2022	12 711	
USD	8 778 845	ZAR	153 712 000	21. Dez. 2022	346 050	
UYU	19 715 000	USD	470 682	21. Dez. 2022	(4 243)	
ZAR	526 291 191	USD	30 581 278	7. Okt. 2022	(1 512 324)	
ZAR	367 824 988	USD	20 423 716	7. Nov. 2022	(165 893)	
ZAR	62 010 000	USD	3 484 178	21. Dez. 2022	(82 248)	
					USD	5 310 080
Absicherung der Anteilsklasse						
BRL	103 254 818	USD	19 689 569	31. Okt. 2022	(677 093)	
CHF	10 192 915	USD	10 416 003	31. Okt. 2022	(60 380)	
EUR	179 603 695	USD	175 633 652	31. Okt. 2022	724 351	

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

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
GBP	62 335 724	USD	69 784 623	31. Okt. 2022	(141 683)
SGD	2 675 535	USD	1 880 781	31. Okt. 2022	(17 446)
USD	945 995	BRL	5 104 039	31. Okt. 2022	6 179
USD	32 958	CHF	32 077	31. Okt. 2022	368
USD	901 581	EUR	924 065	31. Okt. 2022	(5 786)
USD	659 435	GBP	604 187	31. Okt. 2022	(15 578)
USD	3 704	SGD	5 282	31. Okt. 2022	25
					USD (187 043)
					USD 5 123 037

Die Devisenterminkontrakte waren mit den folgenden Kontrahenten verbunden:

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend	HSBC	(1 025 562)
	UBS	12 037 667
		USD 11 012 105
Schroder GAIA Cat Bond	Brown Brothers Harriman & Co	2 442 746
	HSBC	5 293 526
		USD 7 736 272
Schroder GAIA Contour Tech Equity	HSBC	257 363
	Morgan Stanley	(65 732)
		USD 191 631
Schroder GAIA Egerton Equity	Brown Brothers Harriman & Co	(2 818 215)
	HSBC	(1 361 770)
		EUR (4 179 985)
Schroder GAIA Helix	Goldman Sachs	(4 975 253)
	HSBC	430 780
	J.P. Morgan	(2 458 465)
		USD (7 002 938)
Schroder GAIA Oaktree Credit	HSBC	16 797
	State Street	1 050 347
		USD 1 067 144
Schroder GAIA Sirius US Equity	HSBC	109 848
	Morgan Stanley	584 877
		USD 694 725
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	1 109 625
	Deutsche Bank	(457 221)
	HSBC	284 363
	Morgan Stanley	75 900
	Newedge Group	989 551
		USD 2 002 218

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

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	HSBC	90 379
		GBP
		90 379
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Bank of America	1 334 863
	Barclays Bank	1 096 555
	BNP Paribas	1 409 745
	Citi Bank	703 817
	Deutsche Bank	(58 960)
	Goldman Sachs	(933 812)
	HSBC	852 286
	J.P. Morgan	1 448 208
	Morgan Stanley	(1 588 547)
	Standard Chartered Bank	214 367
	UBS	644 515
		USD
		5 123 037

Kassageschäfte

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

Zum 30. September 2022 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					
CAD	345 794	USD	252 000	3. Okt. 2022	(1 669)
EUR	355 713	USD	346 365	3. Okt. 2022	2 251
GBP	418 524	USD	455 453	3. Okt. 2022	11 850
					USD
					12 432

Kontrahenten von Kassageschäften

Fonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Brown Brothers Harriman & Co	14 101
	Morgan Stanley	(1 669)
		USD
		12 432

Terminkontrakte

Terminkontrakte wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Terminkontrakten“ aufgeführt. Zum 30. September 2022 hielten die folgenden Teilfonds offene Terminkontrakte auf Indizes (in Aktien), festverzinsliche Wertpapiere und Währungen:

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long-Position	Marktpreis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Sep. 23	7	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	1 671 275	95,62	1 987
Dez. 23	5	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	1 195 513	95,68	487
Mrz. 24	3	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	718 550	95,77	(275)
Jun. 25	38	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9 199 963)	96,38	43 862

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

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Sept. 25	40	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9 694 550)	96,42	53 050
Dez. 25	40	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9 698 038)	96,44	54 038
Mrz. 26	39	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9 460 700)	96,46	56 337
Jun. 26	38	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9 217 250)	96,45	54 500
Sep. 26	38	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9 216 950)	96,45	54 675
Dez. 26	35	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(8 489 500)	96,44	51 000
Dez. 22	274	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(173 757 678)	9,91	39 907
Mrz. 23	163	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(103 252 357)	9,90	58 108
Jun. 23	136	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(86 123 528)	9,89	54 314
Sep. 23	13	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	8 237 346	9,89	(9 942)
Okt. 22	16	Amsterdam Index Future	Morgan Stanley	EUR	(2 044 913)	640,65	35 733
Dez. 22	78	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(5 926 719)	117,12	83 461
Dez. 22	332	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(22 838 794)	106,56	208 850
Mrz. 23	584	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(101 247 846)	95,53	278 650
Jun. 23	46	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(7 964 636)	95,59	6 588
Sep. 23	48	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(8 315 398)	95,70	2 226
Dez. 23	38	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(6 593 722)	95,85	2 145
Okt. 22	942	BIST 30 Index Future	Morgan Stanley	TRY	1 874 861	3 545,50	(68 603)
Okt. 22	14	CAC 40 Index Future	Morgan Stanley	EUR	787 318	5 763,50	3 474
Dez. 22	385	Canada 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	(34 674 847)	123,59	228 726
Nov. 22	1	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(29 950)	31,07	(1 122)
Dez. 22	3	Dax Index Future	Morgan Stanley	EUR	(916 886)	12 134,00	24 991
Dez. 22	9	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	J.P. Morgan	USD	(1 411 400)	28 801,00	115 355
Dez. 22	3	E-mini S&P 500 ESG Future	Morgan Stanley	USD	(524 610)	312,92	55 230
Dez. 22	22	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(4 378 158)	3 601,50	416 508
Jun. 23	17	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(4 038 394)	96,96	12
Sep. 23	12	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(2 849 201)	96,91	49
Dez. 23	15	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(3 564 074)	96,96	613
Mrz. 25	108	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(25 713 718)	97,10	21 071
Dez. 22	12	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(1 857 489)	146,64	132 914
Dez. 22	28	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	(954 804)	3 315,00	45 122
Dez. 22	55	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(6 508 728)	119,75	53 873
Dez. 22	44	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(5 018 268)	111,98	189 444
Dez. 22	25	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(3 468 426)	138,49	75 248
Dez. 22	95	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(12 828 541)	132,12	527 541
Dez. 22	12	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	948 230	6 914,50	(21 784)
Okt. 22	569	FTSE China A50 Future	Morgan Stanley	USD	(7 425 112)	12 916,00	75 908
Dez. 22	6	FTSE MIB Index Future	Morgan Stanley	EUR	621 964	20 529,00	(18 381)
Okt. 22	126	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	(6 063 029)	1 167,50	178 829
Dez. 22	133	FTSE/JSE Top 40 Future	Morgan Stanley	ZAR	(4 472 096)	57 811,00	224 106
Okt. 22	50	Hang Seng Index Future	Morgan Stanley	HKD	(5 496 755)	17 210,00	15 619
Okt. 22	95	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	(3 623 639)	5 914,00	44 945
Okt. 22	21	IBEX 35 Index Future	Morgan Stanley	EUR	(1 569 168)	7 363,40	53 703
Sep. 23	3	ICE 3-Monats-SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(789 429)	94,18	796
Dez. 23	2	ICE 3-Monats-SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(526 509)	94,20	614
Mrz. 24	2	ICE 3-Monats-SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(526 942)	94,27	656
Jun. 25	103	ICE 3-Monats-SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(27 688 848)	94,83	425 559
Dez. 22	36	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	(36 913 632)	148,30	25 634
Dez. 22	59	KOSPI2 Index Future	J.P. Morgan	KRW	(3 181 381)	282,45	269 424
Dez. 22	45	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(5 171 335)	96,40	327 741
Okt. 22	591	Mini Bovespa Future	Morgan Stanley	BRL	(2 440 274)	110 502,00	18 974
Dez. 22	47	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(4 341 960)	1 660,60	439 550
Dez. 22	95	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(4 649 510)	871,50	509 885
Okt. 22	350	MSCI Singapore Index ETS Future	Morgan Stanley	SGD	(6 802 110)	280,65	(37 054)

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

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)								
Dez. 22	9	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(2 191 319)	11 035,50	20 4929	
Dez. 22	2	Nikkei 225 (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	(363 919)	25 940,00	5 458	
Dez. 22	16	Nikkei 225 (SGX) Future	Morgan Stanley	JPY	1 499 067	25 980,00	(63 014)	
Okt. 22	103	OMXS30 Index Future	Morgan Stanley	SEK	1 717 208	1 830,00	(18 740)	
Dez. 22	18	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1 655 883)	1 669,80	153 063	
Dez. 22	5	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1 215 645)	2 208,20	111 545	
Dez. 22	32	S&P/TSX 60 Index Future	J.P. Morgan	CAD	(5 440 605)	1 117,70	262 135	
Dez. 22	920	SET 50 Index Future	J.P. Morgan	THB	4 739 759	951,80	(96 832)	
Okt. 22	17	SGX Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	(576 685)	17 088,00	(4 307)	
Dez. 22	254	Short-Term Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(26 460 046)	105,32	242 455	
Dez. 22	207	South Korea 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	(15 917 138)	107,25	399 734	
Dez. 22	424	South Korea 3 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	(30 602 090)	101,88	409 093	
Dez. 22	24	SPI 200 Future	Morgan Stanley	AUD	2 656 978	6 466,00	(175 392)	
Dez. 22	29	Stoxx Euro ESG-X Index Future	Morgan Stanley	EUR	(429 174)	144,20	19 336	
Dez. 22	66	Swiss Market Index Future	Morgan Stanley	CHF	(7 348 140)	10 259,00	485 933	
Dez. 22	15	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	2 005 838	1 836,00	(102 985)	
Dez. 22	51	WIG20 Index Future	Morgan Stanley	PLN	290 900	1 393,00	(4 257)	
							USD	7 313 025
Schroder GAIA Egerton Equity								
Dez. 22	125	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	(25 187 461)	3 601,50	2 219 883	
							EUR	2 219 883
Schroder GAIA Helix								
Dez. 22	11	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	(2 195 725)	3 601,50	214 900	
Dez. 22	151	Euro Stoxx 50 Future	Goldman Sachs	EUR	(5 174 752)	3 315,00	270 967	
Dez. 22	368	Euro Stoxx Future	J.P. Morgan	EUR	(7 191 777)	364,20	626 868	
Dez. 22	231	FTSE 100 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(18 994 910)	6 914,50	1 164 814	
Dez. 22	144	FTSE 250 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(6 244 868)	17 116,50	742 009	
Dez. 22	641	MSCI Asia Future	J.P. Morgan	USD	(33 644 800)	466,00	3 774 200	
Dez. 22	1 152	MSCI China Future	J.P. Morgan	USD	27 856 698	426,50	(3 290 298)	
Dez. 22	172	MSCI EAFE Index Future	J.P. Morgan	USD	(16 002 377)	1 660,60	1 721 217	
Dez. 22	260	MSCI Emerging Market Index Future	J.P. Morgan	USD	(12 386 610)	871,50	1 057 110	
Dez. 22	621	MSCI Europe Future	J.P. Morgan	EUR	(15 587 742)	244,40	719 360	
Dez. 22	144	MSCI Poland Future	Goldman Sachs	USD	(1 576 670)	99,10	149 630	
Dez. 22	751	MSCI World Index Future	J.P. Morgan	USD	(61 702 057)	7 457,00	5 699 987	
Dez. 22	172	Topix Index Future	J.P. Morgan	JPY	(22 827 455)	1 836,00	1 010 329	
							USD	13 861 093
Schroder GAIA Oaktree Credit								
Dez. 22	3	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(625 704)	102,70	9 532	
Dez. 22	9	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(1 001 212)	107,51	33 641	
							USD	43 173
Schroder GAIA Two Sigma Diversified								
Jun. 23	99	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	23 905 270	95,58	(249 220)	
Jun. 23	24	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	5 786 275	95,34	(66 175)	
Dez. 23	159	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	38 627 188	95,51	(661 962)	
Jun. 24	71	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	17 325 023	95,83	(315 198)	
Dez. 24	23	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	5 653 475	96,06	(130 312)	
Mrz. 25	42	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	10 196 738	96,12	(104 138)	
Jun. 25	27	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	6 549 863	96,16	(59 400)	
Okt. 22	18	Amsterdam Index Future	Newedge Group	EUR	2 406 317	640,65	(145 988)	
Dez. 22	114	Australia 10 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	(8 689 459)	117,12	149 313	
Dez. 22	63	Australia 3 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	4 336 724	106,56	(42 488)	
Dez. 22	5	Australian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	335 784	64,16	(15 009)	

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

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Mrz. 23	7	Bankers' Acceptance Future	Newedge Group	CAD	(1 216 138)	95,53	5 891
Dez. 22	1	British Pound Future	Morgan Stanley	USD	71 869	111,81	(1 988)
Okt. 22	50	CAC 40 Index Future	Newedge Group	EUR	3 030 805	5 763,50	(206 546)
Dez. 22	126	Canada 10 Year Bond Future	Newedge Group	CAD	(11 415 340)	123,59	142 064
Dez. 22	1	Canadian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(75 360)	72,40	2 965
Okt. 22	224	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(5 997 170)	31,52	(1 062 414)
Nov. 22	56	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(1 533 678)	31,07	(206 337)
Dez. 22	17	Dax Index Future	Newedge Group	EUR	5 610 586	12 134,00	(556 517)
Dez. 22	43	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Morgan Stanley	USD	6 622 885	28 801,00	(430 670)
Okt. 22	2	Dubai IRD FX Future	Newedge Group	USD	48 860	122,40	100
Dez. 22	294	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(58 458 273)	3 601,50	5 516 223
Mrz. 23	26	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	6 181 462	97,20	10 494
Sep. 23	83	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	19 969 217	96,91	(262 580)
Dez. 23	96	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	23 123 005	96,96	(316 850)
Mrz. 24	89	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	21 087 097	97,00	63 741
Dez. 22	3	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Newedge Group	EUR	(468 072)	146,64	36 928
Dez. 22	3	Euro FX Future	Morgan Stanley	USD	(377 126)	0,99	7 320
Dez. 22	466	Euro Stoxx 50 Future	Newedge Group	EUR	16 649 809	3 315,00	(1 510 095)
Dez. 22	5	Euro Stoxx Bank Future	Morgan Stanley	EUR	(20 135)	78,00	1 024
Dez. 22	99	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	11 825 420	119,75	(206 683)
Dez. 22	80	Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	9 184 895	111,98	(405 216)
Dez. 22	74	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	10 318 868	138,49	(275 061)
Dez. 22	78	Euro-OAT Future	Newedge Group	EUR	10 546 319	132,12	(446 551)
Dez. 22	69	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	7 262 925	107,17	(16 058)
Dez. 22	3	FTSE 100 Index Future	Newedge Group	GBP	231 126	6 914,50	486
Okt. 22	73	FTSE China A50 Future	Newedge Group	USD	(949 101)	12 916,00	6 233
Dez. 22	13	FTSE MIB Index Future	Newedge Group	EUR	(1 379 102)	20 529,00	71 338
Dez. 22	65	FTSE/JSE Top 40 Future	Newedge Group	ZAR	(2 275 530)	57 811,00	199 445
Okt. 22	25	IBEX 35 Index Future	Newedge Group	EUR	(1 982 886)	7 363,40	178 761
Mrz. 23	35	ICE 3-Monats-SONIA Index Future	Newedge Group	GBP	9 560 487	95,00	(279 165)
Dez. 22	55	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Newedge Group	JPY	56 340 582	148,30	16 082
Dez. 22	4	Japanese Yen Future	Morgan Stanley	USD	(351 900)	69,64	3 725
Dez. 22	203	KOSDAQ150 Index Future	Newedge Group	KRW	1 529 034	963,00	(162 647)
Dez. 22	95	KOSPI2 Index Future	Newedge Group	KRW	(5 107 033)	282,45	418 288
Dez. 22	173	Long Gilt Future	Newedge Group	GBP	(20 469 420)	96,40	1 848 493
Dez. 22	13	Mexican Peso Future	Morgan Stanley	USD	321 009	4,90	(2 444)
Dez. 22	42	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(3 950 480)	1 660,60	463 220
Dez. 22	211	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(10 373 330)	871,50	1 179 005
Okt. 22	171	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	(3 327 378)	280,65	(14 043)
Dez. 22	190	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(47 076 763)	11 035,50	5 141 863
Dez. 22	1	New Zealand Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(59 715)	56,14	3 580
Dez. 22	47	Nikkei 225 (OSE) Future	Newedge Group	JPY	(8 778 070)	25 940,00	354 246
Dez. 22	42	Nikkei 225 (YEN) Future	Morgan Stanley	JPY	(3 946 832)	25 930,00	184 447
Okt. 22	55	OMXS30 Index Future	Newedge Group	SEK	954 982	1 830,00	(48 034)
Dez. 22	121	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	11 242 282	1 669,80	(1 139 992)
Dez. 22	13	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	3 197 675	2 208,20	(327 015)
Dez. 22	45	S&P/TSX 60 Index Future	Newedge Group	CAD	7 838 805	1 117,70	(556 581)
Dez. 22	32	SET 50 Index Future	Newedge Group	THB	165 307	951,80	(3 814)
Okt. 22	193	SGX Nifty 50 Future	Newedge Group	USD	6 506 372	17 088,00	89 596
Dez. 22	56	Short-Term Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	5 844 597	105,32	(64 340)
Dez. 22	51	South Korea 10 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	3 873 747	107,25	(50 619)
Dez. 22	27	South Korea 3 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	1 940 351	101,88	(17 684)
Dez. 22	45	SPI 200 Future	Newedge Group	AUD	4 864 378	6 466,00	(211 404)

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

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Dez. 22	8	Stoxx 600 Bank Future	Newedge Group	EUR	(51 539)	118,85	4 947
Dez. 22	94	Stoxx Europe 600 Future	Newedge Group	EUR	1 970 732	387,50	(185 816)
Dez. 22	1	Swiss Franc Future	Morgan Stanley	USD	131 290	102,14	(3 615)
Okt. 22	19	TAIEX Future	Morgan Stanley	TWD	1 725 391	13 394,00	(122 279)
Dez. 22	111	Topix Index Future	Newedge Group	JPY	(14 623 755)	1 836,00	542 638
Dez. 22	1	UD Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	109 539	112,08	2 545
Dez. 22	721	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	81 697 563	112,06	(900 500)
Dez. 22	27	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	3 369 861	118,48	(170 782)
Dez. 22	289	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	60 190 725	102,70	(832 834)
Dez. 22	6	US 3 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	1 282 359	104,38	(29 766)
Dez. 22	155	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	17 022 799	107,51	(359 088)
Okt. 22	34	US Dollar Index Future	Newedge Group	KRW	331 247	1 432,20	9 110
Dez. 22	34	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(4 620 483)	126,41	322 670
Dez. 22	3	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	453 375	137,00	(42 375)
Okt. 22	110	VSTOXX Mini Future	Newedge Group	EUR	(300 933)	31,15	(34 881)
Dez. 22	25	WIG20 Index Future	Newedge Group	PLN	(153 887)	1 393,00	13 375
						USD	3 736 982
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund							
Dez. 22	24	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	(1 798 080)	6 914,50	138 600
						GBP	138 600
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Dez. 22	930	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	70 582 402	117,12	(912 790)
Dez. 22	24	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	1 652 620	106,56	(16 720)
Dez. 22	1 653	Canada 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	(149 394 795)	123,59	1 500 148
Dez. 22	70	Canada 5 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	(5 724 813)	112,39	29 442
Okt. 22	31	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	942 650	31,52	34 346
Dez. 22	3	Dax Index Future	Morgan Stanley	EUR	(906 938)	12 134,00	15 044
Dez. 22	6	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(1 497 190)	3 601,50	416 740
Dez. 22	52	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(7 593 564)	146,64	120 409
Dez. 22	42	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(5 057 460)	119,75	128 298
Dez. 22	220	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(24 184 919)	111,98	40 800
Dez. 22	81	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(11 457 656)	138,49	463 760
Dez. 22	31	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(4 180 021)	132,12	166 011
Dez. 22	129	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(13 674 030)	107,17	125 540
Okt. 22	6	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	(289 975)	1 167,50	9 776
Okt. 22	61	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	2 371 144	5 914,00	(73 245)
Dez. 22	43	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	(44 070 165)	148,30	9 500
Dez. 22	254	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(27 285 846)	96,40	(53 550)
Dez. 22	83	Micro E-mini Nasdaq-100 Index Future	Morgan Stanley	USD	1 952 065	11 035,50	(120 172)
Dez. 22	8	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(754 600)	1 660,60	90 360
Dez. 22	26	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	5 917 930	11 035,50	(179 470)
Dez. 22	5	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(463 940)	1 669,80	46 490
Okt. 22	22	SGX Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	(751 546)	17 088,00	(327)
Dez. 22	1 293	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	146 929 228	112,06	(2 032 416)
Dez. 22	38	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(4 657 513)	118,48	155 107
Dez. 22	252	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(52 015 846)	102,70	257 408
Dez. 22	377	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	40 519 938	107,51	10 508
Dez. 22	48	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	6 206 182	126,41	(138 682)
Dez. 22	144	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	20 422 055	137,00	(694 055)
						USD	(601 740)

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

Optionskontrakte

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

Zum 30. September 2022 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						
(1 156 704)	Put auf UBS ETC Linked to a Systematica Strategy Delta-1 Basket on Commodity Future Ausübungskurs 47,04 Läuft am 3. Okt. 2022 ab	UBS	USD	(3 879)	-	3 879
				USD	-	3 879
Schroder GAIA Helix						
380	Put auf Deutsche Börse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 11 600,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	UBS	EUR	196 632	311 773	115 141
30	Put auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 900,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	UBS	USD	30 012	115 650	85 638
80	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3 550,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	UBS	USD	197 898	634 400	436 502
				USD	1 061 823	637 281
Schroder GAIA Oaktree Credit						
2	Put auf S&P 500 Future Ausübungskurs 3 400,00 Läuft am 7. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	353	775	422
				USD	775	422
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
198	Call auf 3-Monats-SOFR-Optionen Ausübungskurs 97,25 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	71 373	8 663	(62 710)
(198)	Call auf 3-Monats-SOFR-Optionen Ausübungskurs 97,88 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(26 831)	(6 188)	20 643
135 777	Call auf Alibaba Group Holding Limited Ausübungskurs 109,92 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	HKD	93 288	22 920	(70 368)
(135 777)	Call auf Alibaba Group Holding Limited Ausübungskurs 146,57 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	HKD	(21 535)	(4 747)	16 788
48	Call auf Biogen Inc. Ausübungskurs 240,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	50 189	145 200	95 011
(48)	Call auf Biogen Inc. Ausübungskurs 290,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(20 163)	(24 000)	(3 837)
21 198	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 8,00 Läuft am 17. Mrz. 2023 ab	Goldman Sachs	EUR	16 245	15 241	(1 004)
30 396	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 9,00 Läuft am 17. Mrz. 2023 ab	Goldman Sachs	EUR	16 248	13 037	(3 211)
23 525	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 12,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	10 137	666	(9 471)
33 535	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 13,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	10 496	606	(9 890)
47 951	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 14,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	11 413	589	(10 824)
15 000	Call auf Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 559,36 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	CNY	112 365	7 912	(104 453)

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

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(15 000)	Call auf Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 639,27 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	CNY	(55 351)	(3 041)	52 310
353	Call auf DAX 30 Index Ausübungskurs 14 000,00 Läuft am 18. Nov. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	8 044	6 330	(1 714)
246	Call auf DAX 30 Index Ausübungskurs 14 000,00 Läuft am 18. Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	EUR	18 243	4 411	(13 832)
2 139	Call auf Euro Stoxx 50 Index Ausübungskurs 3 800,00 Läuft am 18. Nov. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	27 545	11 367	(16 178)
19 487 029	Call auf Euro Stoxx 50 Index versus S&P 500 Index Ausübungskurs 2,50 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	216 902	2 669	(214 233)
1 395 000	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 93,34 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Citi Bank	AUD	15 167	10 286	(4 881)
1 305 000	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 96,00 Läuft am 24. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	AUD	14 336	2 365	(11 971)
2 095 000	Call auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,64 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	AUD	23 476	19 895	(3 581)
(5 955 000)	Call auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,65 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	AUD	(106 852)	(77 686)	29 166
5 955 000	Call auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,68 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	AUD	37 261	24 688	(12 573)
(1 358 000)	Call auf EUR/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,13 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	(31 590)	(62 519)	(30 929)
(1 289 000)	Call auf EUR/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,33 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	(31 156)	(26 418)	4 738
(2 758 000)	Call auf EUR/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 145,00 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	(28 863)	(9 523)	19 340
1 422 000	Call auf EUR/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,78 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	19 548	21 306	1 758
1 074 000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,65 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	J.P. Morgan	EUR	12 573	58 850	46 277
1 316 000	Call auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,75 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	HSBC	EUR	12 316	36 003	23 687
1 358 000	Call auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,78 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Citi Bank	EUR	14 999	34 190	19 191
1 422 000	Call auf EUR/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,89 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	12 006	11 531	(475)
940 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,96 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	13 276	23 493	10 217
(4 087 000)	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,97 Läuft am 27. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	(92 680)	(134 136)	(41 456)
(8 242 000)	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,97 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	EUR	(207 771)	(316 914)	(109 143)

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

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
4 791 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,01 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	59 409	8 618	(50 791)
8 242 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,01 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	EUR	72 993	128 481	55 488
4 791 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,02 Läuft am 13. Okt. 2022 ab	Citi Bank	EUR	60 635	3 470	(57 165)
4 792 000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,02 Läuft am 14. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	59 666	4 970	(54 696)
(3 789 000)	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,04 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	Citi Bank	EUR	(29 200)	(16 878)	12 322
734 000	Call auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 161,21 Läuft am 5. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	11 763	8 773	(2 990)
(5 520 000)	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,07 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	Barclays Bank	GBP	(209 817)	(393 253)	(183 436)
5 738 000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,09 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	GBP	116 802	220 590	103 788
(1 202 000)	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	GBP	(15 044)	(33 025)	(17 981)
5 520 000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,14 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	Barclays Bank	GBP	69 820	174 029	104 209
4 152 000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,16 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	70 808	14 610	(56 198)
4 152 000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,17 Läuft am 13. Okt. 2022 ab	Citi Bank	GBP	70 630	8 773	(61 857)
4 153 000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,17 Läuft am 14. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	66 736	9 191	(57 545)
414 000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,42 Läuft am 4. Mai 2023 ab	Barclays Bank	GBP	35 096	613	(34 483)
(4 620 000)	Call auf NZD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 87,50 Läuft am 19. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	NZD	(17 583)	(685)	16 898
2 375 000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,57 Läuft am 1. Nov. 2022 ab	UBS	NZD	26 239	16 737	(9 502)
(6 525 000)	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,59 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	NZD	(98 374)	(38 720)	59 654
1 415 000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Bank of America	NZD	12 711	34	(12 677)
6 525 000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	NZD	33 222	11 215	(22 007)
1 748 000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,76 Läuft am 24. Jan. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	49 468	56 927	7 459
1 836 000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 6,23 Läuft am 26. Jan. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	43 262	27 073	(16 189)
1 489 000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Läuft am 5. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	13 890	70 165	56 275

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

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1 117 000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Läuft am 7. Dez. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	18 202	53 497	35 295
(4 939 000)	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,96 Läuft am 17. Okt. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	(81 098)	(137 386)	(56 288)
4 939 000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,96 Läuft am 17. Okt. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	48 150	137 386	89 236
788 000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,96 Läuft am 29. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	14 174	21 580	7 406
858 000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,97 Läuft am 11. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	15 590	14 037	(1 553)
5 525 000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,97 Läuft am 11. Nov. 2022 ab	Bank of America	USD	55 278	121 987	66 709
(5 525 000)	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,97 Läuft am 11. Nov. 2022 ab	Barclays Bank	USD	(97 296)	(121 987)	(24 691)
(8 287 000)	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,99 Läuft am 11. Nov. 2022 ab	Bank of America	USD	(48 586)	(114 795)	(66 209)
(1 756 000)	Call auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 892,00 Läuft am 29. Nov. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(78 054)	(164 573)	(86 519)
(1 918 000)	Call auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 943,85 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	USD	(84 933)	(123 307)	(38 374)
1 939 000	Call auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 945,00 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	43 852	71 163	27 311
(1 939 000)	Call auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 945,00 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	(94 497)	(71 163)	23 334
1 756 000	Call auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 971,00 Läuft am 29. Nov. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	33 522	71 834	38 312
1 815 000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,44 Läuft am 10. Mrz. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	34 921	170 027	135 106
872 000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,47 Läuft am 13. Mrz. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	17 575	77 725	60 150
3 944 000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,16 Läuft am 23. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	54 822	52 725	(2 097)
(1 805 000)	Call auf USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 25,74 Läuft am 3. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	(19 569)	(17 583)	1 986
9 473 000	Call auf USD/HKD-Devisenkurs Ausübungskurs 8,00 Läuft am 19. Dez. 2022 ab	Bank of America	USD	15 413	1 096	(14 317)
(2 841 000)	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 413,67 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	(113 583)	(215 876)	(102 293)
(1 805 000)	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 426,65 Läuft am 3. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	(29 692)	(70 450)	(40 758)
991 000	Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14 998,00 Läuft am 4. Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	17 184	21 891	4 707
1 052 000	Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 15 015,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	16 827	29 397	12 570

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

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1 532 000	Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 15 548,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	10 715	20 549	9 834
(3 518 000)	Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,31 Läuft am 30. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	(71 503)	(237 669)	(166 166)
1 035 000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 80,16 Läuft am 12. Dez. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	11 132	27 430	16 298
1 020 000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 80,42 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	HSBC	USD	11 118	16 417	5 299
(1 323 000)	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 81,30 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	(10 288)	(12 444)	(2 156)
3 610 000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 81,60 Läuft am 3. Nov. 2022 ab	UBS	USD	18 050	33 202	15 152
2 446 000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 81,65 Läuft am 7. Okt. 2022 ab	Citi Bank	USD	12 218	7 532	(4 686)
1 784 000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 82,07 Läuft am 16. Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	8 288	15 783	7 495
2 424 000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 82,26 Läuft am 25. Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	11 356	22 674	11 318
3 943 000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 84,80 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	24 132	22 217	(1 915)
800 000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 95,99 Läuft am 17. Jun. 2024 ab	BNP Paribas	USD	55 269	210 520	155 251
826 000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 137,58 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	17 983	40 867	22 884
4 771 000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 141,80 Läuft am 14. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	77 042	107 789	30 747
4 770 000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 141,98 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Citi Bank	USD	80 482	101 582	21 100
4 770 000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 142,25 Läuft am 13. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	77 989	95 290	17 301
876 000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 143,28 Läuft am 20. Okt. 2022 ab	Citi Bank	USD	13 092	14 392	1 300
(1 361 000)	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 144,38 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	(19 404)	(18 013)	1 391
(5 403 000)	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 145,50 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	USD	(35 930)	(49 340)	(13 410)
(8 253 000)	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 147,00 Läuft am 10. Nov. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(70 811)	(68 771)	2 040
(1 868 000)	Call auf USD/KRW-Devisenkurs Ausübungskurs 1 385,50 Läuft am 9. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	(40 900)	(75 151)	(34 251)
1 023 000	Call auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 56,51 Läuft am 24. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	15 946	40 370	24 424
1 038 000	Call auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 57,12 Läuft am 9. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	14 625	37 317	22 692

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

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
2 034 000	Call auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 57,54 Läuft am 8. Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	12 438	52 135	39 697
(1 784 000)	Call auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,86 Läuft am 15. Nov. 2022 ab	Bank of America	USD	(21 283)	(73 062)	(51 779)
1 004 000	Call auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,38 Läuft am 28. Okt. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	11 388	38 800	27 412
1 038 000	Call auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,40 Läuft am 9. Dez. 2022 ab	HSBC	USD	11 179	31 416	20 237
(4 736 000)	Call auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 36,53 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	(87 999)	(173 813)	(85 814)
(7 887 000)	Call auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 37,60 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(162 945)	(164 263)	(1 318)
2 228 000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 17,55 Läuft am 11. Okt. 2022 ab	HSBC	USD	39 881	73 660	33 779
2 841 000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 17,59 Läuft am 14. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	91 495	138 461	46 966
1 112 000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,07 Läuft am 7. Okt. 2022 ab	HSBC	USD	15 869	12 060	(3 809)
3 788 000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,64 Läuft am 14. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	45 967	81 071	35 104
68	Call auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 1 010,00 Läuft am 30. Sept. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	50 296	4 080	(46 216)
1 360	Call auf S&P Regional Banks Select Industry Index Ausübungskurs 2 020,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	50 039	5 070	(44 969)
315 702	Call auf Sinoma Science & Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 28,04 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	CNY	116 405	11 998	(104 407)
(315 702)	Call auf Sinoma Science & Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 33,39 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	CNY	(47 073)	(4 755)	42 318
1 145	Call auf XPeng Inc. Ausübungskurs 97,47 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	HKD	1 988	83	(1 905)
(1 145)	Call auf XPeng Inc. Ausübungskurs 120,68 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	HKD	(964)	(36)	928
(120)	Put auf 3-Monats-LIBOR-Optionen Ausübungskurs 99,00 Läuft am 18. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	EUR	(66 285)	(619 637)	(553 352)
120	Put auf 3-Monats-LIBOR-Optionen Ausübungskurs 99,50 Läuft am 18. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	EUR	107 751	756 354	648 603
714	Put auf A.P. Moeller – Maersk A/S Ausübungskurs 14 000,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	DKK	31 454	78 293	46 839
(135 777)	Put auf 3-Monats-LIBOR-Optionen Ausübungskurs 73,28 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	HKD	(64 060)	(106 885)	(42 825)
119	Put auf Apple Inc. Ausübungskurs 140,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	59 290	73 185	13 895

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

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(48)	Put auf Biogen Inc. Ausübungskurs 155,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(9 896)	(840)	9 056
(15 000)	Put auf Contemporary Ampere Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 452,82 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	CNY	(50 640)	(141 556)	(90 916)
(3 330)	Put auf Euro Stoxx 50 Index Ausübungskurs 2 950,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	(35 703)	(38 784)	(3 081)
3 330	Put auf Euro Stoxx 50 Index Ausübungskurs 3 300,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Goldman Sachs	EUR	212 642	259 883	47 241
1 395 000	Put auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 93,34 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Citi Bank	AUD	15 167	19 393	4 226
1 305 000	Put auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 96,00 Läuft am 24. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	AUD	14 336	34 668	20 332
2 095 000	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,64 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	AUD	23 476	26 896	3 420
(1 358 000)	Put auf EUR/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,13 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	(31 590)	(15 109)	16 481
(1 289 000)	Put auf EUR/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,33 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	(31 156)	(30 804)	352
1 422 000	Put auf EUR/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,78 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	19 548	15 841	(3 707)
1 074 000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,65 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	J.P. Morgan	EUR	12 573	147	(12 426)
(1 901 000)	Put auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,67 Läuft am 20. Dez. 2022 ab	Citi Bank	EUR	(10 360)	(1 215)	9 145
1 316 000	Put auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,75 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	HSBC	EUR	12 316	2 481	(9 835)
1 358 000	Put auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,78 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Citi Bank	EUR	14 880	4 852	(10 028)
1 422 000	Put auf EUR/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,89 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Bank of America	EUR	12 006	12 022	16
238 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,94 Läuft am 7. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	6 603	-	(6 603)
940 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,96 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	EUR	13 276	7 539	(5 737)
237 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,97 Läuft am 7. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	9 425	-	(9 425)
(3 789 000)	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,97 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	Citi Bank	EUR	(30 772)	(64 562)	(33 790)
(3 009 000)	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,97 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	EUR	(70 650)	(52 375)	18 275
(4 087 000)	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,97 Läuft am 27. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	EUR	(92 679)	(74 197)	18 482
4 791 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,01 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	59 408	137 877	78 469

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

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
4 791 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,02 Läuft am 13. Okt. 2022 ab	Citi Bank	EUR	60 636	197 985	137 349
4 792 000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,02 Läuft am 14. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	EUR	59 667	186 071	126 404
1 168 000	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,70 Läuft am 24. Okt. 2022 ab	Bank of America	GBP	13 417	6 796	(6 621)
734 000	Put auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 161,21 Läuft am 5. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	11 763	6 981	(4 782)
(1 202 000)	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,04 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	GBP	(10 847)	(5 983)	4 864
5 738 000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,09 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	GBP	117 052	79 682	(37 370)
4 152 000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,16 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	70 808	181 055	110 247
4 152 000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,17 Läuft am 13. Okt. 2022 ab	Citi Bank	GBP	70 630	231 112	160 482
4 153 000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,17 Läuft am 14. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	GBP	66 736	238 691	171 955
350 000	Put auf NZD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 80,00 Läuft am 28. Okt. 2022 ab	Bank of America	NZD	21 016	44 502	23486
(4 620 000)	Put auf NZD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 82,70 Läuft am 19. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	NZD	(17 584)	(71 519)	(53 935)
2 375 000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,57 Läuft am 1. Nov. 2022 ab	UBS	NZD	26 239	34 900	8 661
1 415 000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Bank of America	NZD	12 711	76 495	63 784
2 623 000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 4,87 Läuft am 16. Nov. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	41 174	7 807	(33 367)
1 805 000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,05 Läuft am 3. Nov. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	27 721	10 209	(17 512)
(1 836 000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,11 Läuft am 24. Jan. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	(36 445)	(29 668)	6 777
(1 836 000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,11 Läuft am 26. Jan. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	(36 355)	(29 759)	6 596
(2 623 000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,24 Läuft am 16. Nov. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	(115 819)	(43 810)	72 009
(1 805 000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,44 Läuft am 3. Nov. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	(79 460)	(51 451)	28 009
1 489 000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Läuft am 5. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	13 890	2	(13 888)
1 117 000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Läuft am 7. Dez. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	18 202	2 795	(15 407)
(3 943 000)	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,33 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	UBS	USD	(28 035)	(23 174)	4 861

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

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
788 000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,96 Läuft am 29. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	14 174	7 778	(6 396)
858 000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,97 Läuft am 11. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	15 590	2 892	(12 698)
4 767 000	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 880,00 Läuft am 19. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	72 292	30 838	(41 454)
5 841 000	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 930,20 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	89 075	111 267	22 192
(1 918 000)	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 943,85 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Bank of America	USD	(74 004)	(46 408)	27 596
(4 767 000)	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 944,50 Läuft am 19. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(210 811)	(116 146)	94 665
1 939 000	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 945,00 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	47 544	21 402	(26 142)
(1 939 000)	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 945,00 Läuft am 18. Okt. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	(94 497)	(21 402)	73 095
(5 841 000)	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 998,80 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(258 581)	(308 821)	(50 240)
1 815 000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,44 Läuft am 10. Mrz. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	34 921	988	(33 933)
872 000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,47 Läuft am 13. Mrz. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	17 575	593	(16 982)
3 944 000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,16 Läuft am 23. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	54 822	67 807	12 985
2 836 000	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4 249,40 Läuft am 14. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	35 393	11 624	(23 769)
(2 836 000)	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4 503,00 Läuft am 14. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(99 657)	(46 195)	53 462
1 805 000	Put auf USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 23,55 Läuft am 3. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	15 529	1 435	(14 094)
1 805 000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 372,89 Läuft am 3. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	23 916	688	(23 228)
5 916 000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 405,70 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	81 108	64 075	(17 033)
3 895 000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 412,02 Läuft am 5. Jan. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	61 444	61 682	238
(2 841 000)	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 413,67 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	(100 373)	(42 104)	58 269
(5 916 000)	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 432,45 Läuft am 22. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(232 174)	(188 881)	43 293
(3 895 000)	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 442,31 Läuft am 5. Jan. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	(174 917)	(174 885)	32
991 000	Put auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 14 998,00 Läuft am 4. Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	17 184	4 382	(12 802)

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

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1 052 000	Put auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 15 015,00 Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	16 827	9 546	(7 281)
(3 518 000)	Put auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,31 Läuft am 30. Nov. 2022 ab	Citi Bank	USD	(70 342)	(4 482)	65 860
(3 610 000)	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 78,39 Läuft am 3. Nov. 2022 ab	UBS	USD	(14 620)	(940)	13 680
(1 784 000)	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 78,85 Läuft am 16. Nov. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	(7 290)	(1 419)	5 871
1 035 000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 80,16 Läuft am 12. Dez. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	11 131	4 067	(7 064)
1 020 000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 80,42 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	HSBC	USD	11 118	2 019	(9 099)
(3 943 000)	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 80,69 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(19 715)	(25 219)	(5 504)
(1 323 000)	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 81,30 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	(10 288)	(7 857)	2 431
800 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 95,99 Läuft am 17. Jun. 2024 ab	BNP Paribas	USD	55 269	2 393	(52 876)
705 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 112,00 Läuft am 23. Feb. 2023 ab	Barclays Bank	USD	27 495	2 908	(24 587)
452 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 122,00 Läuft am 10. Nov. 2022 ab	Bank of America	USD	56 138	1 605	(54 533)
495 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 130,00 Läuft am 17. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	USD	25 245	1 378	(23 867)
216 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 132,00 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	USD	22 032	1 905	(20 127)
826 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 137,58 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	17 983	1 569	(16 414)
272 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 140,00 Läuft am 6. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	USD	34 952	6 749	(28 203)
(5 403 000)	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 140,00 Läuft am 25. Okt. 2022 ab	Barclays Bank	USD	(41 765)	(21 820)	19 945
4 771 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 141,80 Läuft am 14. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	77 042	16 852	(60 190)
4 770 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 141,98 Läuft am 12. Okt. 2022 ab	Citi Bank	USD	80 482	14 845	(65 637)
4 770 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 142,25 Läuft am 13. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	77 990	17 890	(60 100)
876 000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 143,28 Läuft am 20. Okt. 2022 ab	Citi Bank	USD	13 092	6 977	(6 115)
(1 361 000)	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 144,38 Läuft am 27. Okt. 2022 ab	Bank of America	USD	(19 404)	(17 724)	1 680
5 683 000	Put auf USD/KRW-Devisenkurs Ausübungskurs 1 342,00 Läuft am 19. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	40 508	15 899	(24 609)

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

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(1 868 000)	Put auf USD/KRW-Devisenkurs Ausübungskurs 1 385,50 Läuft am 9. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	(40 900)	(13 752)	27 148
(5 683 000)	Put auf USD/KRW-Devisenkurs Ausübungskurs 1 394,00 Läuft am 19. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	(122 639)	(59 090)	63 549
1 683 000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,41 Läuft am 28. Nov. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	19 627	6 202	(13 425)
2 487 000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,50 Läuft am 23. Nov. 2022 ab	Deutsche Bank	USD	29 464	10 029	(19 435)
4 726 000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,51 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	40 360	27 215	(13 145)
(1 743 000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,52 Läuft am 16. Feb. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	(20 536)	(15 964)	4 572
1 743 000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 20,64 Läuft am 16. Feb. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	61 296	54 555	(6 741)
1 023 000	Put auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 56,51 Läuft am 24. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	15 946	244	(15 702)
1 038 000	Put auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 57,12 Läuft am 9. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	14 625	2 862	(11 763)
(3 944 000)	Put auf USD/PHP-Devisenkurs Ausübungskurs 59,55 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(63 589)	(76 995)	(13 406)
1 784 000	Put auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,40 Läuft am 15. Nov. 2022 ab	Bank of America	USD	16 770	1 322	(15 448)
2 899 000	Put auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,52 Läuft am 10. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	41 511	14 283	(27 228)
2 899 000	Put auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,54 Läuft am 10. Jan. 2023 ab	Citi Bank	USD	41 325	15 915	(25 410)
3 965 000	Put auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,81 Läuft am 4. Jan. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	51 188	67 516	16 328
(2 899 000)	Put auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,83 Läuft am 10. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(123 353)	(57 229)	66 124
(2 899 000)	Put auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,86 Läuft am 10. Jan. 2023 ab	Citi Bank	USD	(123 092)	(63 244)	59 848
(3 965 000)	Put auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 5,10 Läuft am 4. Jan. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	(148 445)	(180 127)	(31 682)
1 004 000	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,38 Läuft am 28. Okt. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	11 388	317	(11 071)
1 038 000	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,40 Läuft am 9. Dez. 2022 ab	HSBC	USD	11 179	3 347	(7 832)
(4 736 000)	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 36,53 Läuft am 15. Dez. 2022 ab	J.P. Morgan	USD	(82 127)	(33 959)	48 168
(7 887 000)	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 37,60 Läuft am 3. Jan. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(162 946)	(172 661)	(9 715)
3 788 000	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 16,76 Läuft am 14. Dez. 2022 ab	Citi Bank	USD	43 922	16 276	(27 646)

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

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
2 841 000	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 17,59 Läuft am 14. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	83 512	42 314	(41 198)
1 038	Put auf FTSE China A50 Index Ausübungskurs 12 327,00 Läuft am 28. Okt. 2022 ab	BNP Paribas	CNY	27 320	24 656	(2 664)
15 740	Put auf InterContinental Hotels Group Ausübungskurs 40,00 Läuft am 17. Mrz. 2023 ab	Goldman Sachs	GBP	26 527	38 486	11 959
61	Put auf MSCI EAFE Index Ausübungskurs 1 630,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	273 116	194 895	(78 221)
93	Put auf Russell 2000 Index Ausübungskurs 1 620,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	364 185	328 755	(35 430)
13	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3 600,00 Läuft am 30. Sept. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	7 973	15 080	7 107
21	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3 750,00 Läuft am 21. Okt. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	144 970	392 070	247 100
(315 702)	Put auf Sinoma Science & Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 22,70 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	CNY	(59 016)	(159 562)	(100 546)
(1 145)	Put auf XPeng Inc. Ausübungskurs 69,62 Läuft am 29. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	HKD	(780)	(3 676)	(2 896)
USD					1 514 443	185 482

Swaptions

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

Zum 30. September 2022 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 Crossover Series 38 20/12/2027“, Call, Ausübungskurs 525,00, 19. Okt. 2022	Bank of America	EUR	24 069	8 420 000	7 842	(16 227)
Kauf	CDX „iTraxx Europe Crossover Series 38 20/12/2027“, Call, Ausübungskurs 525,00, 19. Okt. 2022	Barclays Bank	EUR	8 844	4 240 000	3 949	(4 895)
Kauf	CDX „iTraxx Europe Crossover Series 38 20/12/2027“, Call, Ausübungskurs 550,00, 16. Nov. 2022	J.P. Morgan	EUR	75 697	16 260 000	84 259	8 562
Kauf	CDX „iTraxx Europe Series 38 20/12/2027“, Call, Ausübungskurs 90,00, 21. Dez. 2022	Barclays Bank	EUR	43 938	51 720 000	43 085	(853)
Kauf	CDX „North America High Yield Series 38 20/06/2027“, Call, Ausübungskurs 100,00, 16. Nov. 2022	Goldman Sachs	USD	81 708	12 137 000	65 086	(16 622)
Kauf	IRS „Zahl 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	396 512	12 388

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

Swaptions (Forts.)

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 8,50% Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028“, Put, 8,50%, 6. Apr. 2028“	J.P. Morgan	MXN	95 925	17 150 000	57 021	(38 904)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 5,97% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2023“, Call, 5,97%, 30. Mrz. 2023“	J.P. Morgan	MXN	69 383	46 495 000	28	(69 355)
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	70 873	(470 803)
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	97 006	(299 518)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 8,50% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028“, Call, 8,50%, 6. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95 924	17 150 000	31 464	(64 460)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 9,15% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE May 2023“, Call 9,15%, 3. Mai 2023“	J.P. Morgan	MXN	192 030	301 280 000	96 013	(96 017)
Verkauf	IRS „Erhält Festzinssatz 8,35% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE May 2023“, Call 8,35%, 3. Mai 2023“	J.P. Morgan	MXN	(122 810)	(451 920 000)	(50 282)	72 528
USD						902 856	(984 176)

Total Return 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 Gesamtrendite der Referenzanlagen (Coupons und/oder Kapitalgewinne und/oder -verluste) zu erhalten. Bei der Referenzanlage kann es sich um fast jede beliebige Anlage handeln, die eine für die Teilfonds zulässige Anlage darstellt. Die Teilfonds können solche Instrumente für die Aufnahme von Positionen in einem qualifizierten Markt oder zu Absicherungszwecken einsetzen.

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

Zum 30. September 2022 waren folgende Teilfonds in Total Return 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	23 453 417	(2 156 046)	05. Dez. 2022	1 401 827
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	EUR	12 449 482	(4 259 028)	21. Feb. 2023	(3 985 153)
Kauf Long	Bekleidung	Morgan Stanley	EUR	18 366 811	653 335	05. Dez. 2022	525 069
Kauf Long	Wohngebäude-Bausträger	Goldman Sachs	GBP	16 887 477	(6 040 186)	7. Aug. 2024	(6 109 059)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	CHF	8 280 103	(2 638 337)	18. Jun. 2024	(1 901 545)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	1 710 282	343 188	27. Mrz. 2023	483 694
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	1 466 520	170 533	21. Aug. 2023	129 349
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	USD	5 951 250	13 833 80	18. Sept. 2023	1 396 953
Verkauf Short	Bekleidung	Merrill Lynch	USD	2 390 547	274 509	31. Okt. 2023	276 009
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	USD	856 577	102 116	13. Jul. 2023	104 104

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

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	EUR	2 200 399	711 937	5. Dez. 2022	641 250
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	971 992	195 736	19. Mai 2032	343 175
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	1 036 549	752 282	25. Sept. 2023	752 282
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	1 032 432	170 002	26. Apr. 2023	(26 502)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1 315 612	614 465	6. Mrz. 2023	897 878
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	613 072	41 922	26. Aug. 2025	43 122
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1 716 541	358 094	29. Sept. 2023	359 258
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	350 424	10 291	31. Okt. 2023	10 291
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	CHF	2 260 785	362 406	24. Jul. 2025	353 734
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	6 021 854	723 367	14. Jun. 2023	591 612
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	1 497 742	552 894	7. Aug. 2025	554 320
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	3 778 379	1 325 757	13. Jul. 2023	1 300 482
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	JPY	2 349 348	115 437	24. Okt. 2023	337 911
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 218 730	388 465	6. Aug. 2025	389 129
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	2 000 650	344 546	27. Feb. 2023	506 318
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	564 615	379 358	28. Feb. 2024	380 585
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	1 863 009	462 073	30. Jul. 2025	434 292
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	1 533 765	112 181	24. Okt. 2023	90 188
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	839 734	58 710	25. Sept. 2023	59 774
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	2 114 042	22 643	16. Jan. 2024	56 724
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	1 518 081	576 633	17. Sept. 2024	662 773
Verkauf Short	Lebensmitteldienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 409 496	389 401	24. Jul. 2024	714 283
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	HKD	6 015 936	2 869 800	23. Dez. 2022	3 246 114
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	1 191 644	28 721	31. Okt. 2023	28 721
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	SEK	1 380 101	776 324	26. Apr. 2023	563 759
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	1 169 830	55 655	18. Sept. 2025	55 655
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	1 784 803	(38 440)	5. Jun. 2023	152 419
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	USD	5 438 019	724 698	13. Jul. 2023	978 431
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	2 416 893	436 326	4. Sept. 2025	436 560
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	USD	2 448 826	441 280	7. Aug. 2025	446 544
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	885 460	37 757	24. Okt. 2023	37 757
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Goldman Sachs	USD	5 053 504	472 348	31. Jul. 2024	794 176
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Merrill Lynch	USD	2 365 182	146 949	31. Mai 2023	158 397
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	USD	1 747 944	386 902	13. Jul. 2023	462 807
Verkauf Short	Haushaltswaren	Merrill Lynch	USD	4 013 885	1 868 231	31. Jul. 2023	1 779 878
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	3 593 930	1 602 952	23. Jan. 2025	2 496 498
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	2 623 712	450 466	16. Apr. 2025	626 522
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	1 204 939	66 436	31. Okt. 2023	67 534
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	865 122	203 262	13. Jul. 2023	203 162
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Morgan Stanley	EUR	958 320	158 206	5. Dez. 2022	162 232
Verkauf Short	Maschinen - Bau u. Bergbau	Merrill Lynch	USD	681 872	(174 272)	30. Jun. 2023	(204 542)
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	EUR	1 375 171	154 741	29. Jul. 2025	158 387
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	SEK	3 094 641	118 404	9. Jul. 2025	109 663
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	1 338 924	695 685	5. Dez. 2024	692 186
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	888 993	54 553	13. Jul. 2023	55 076
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	CHF	2 208 086	644 014	24. Jul. 2024	686 563
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	2 030 476	128 173	16. Jul. 2025	98 019
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	3 783 473	445 356	6. Mrz. 2023	691 753
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	EUR	2 718 340	1 235 696	5. Dez. 2022	1 491 367
Verkauf Short	Büro- und Geschäftsausstattung	Morgan Stanley	JPY	2 343 905	77 076	24. Okt. 2023	155 413

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

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	J.P. Morgan	USD	5 267 197	1 821 217	21. Feb. 2023	2 094 644
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1 636 101	(525 964)	23. Jan. 2023	(486 132)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2 360 840	85 089	25. Sept. 2023	85 959
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	SEK	641 339	293 843	12. Jun. 2024	298 062
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	2 634 702	247 358	2. Jul. 2025	258 517
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	1 609 539	(95 955)	31. Okt. 2022	59 612
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	EUR	2 602 907	565 988	5. Dez. 2022	590 733
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	4 725 693	1 148 308	13. Jul. 2023	1 219 021
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	SEK	2 345 905	387 082	7. Mai 2025	383 442
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	621 767	41 908	28. Aug. 2023	41 830
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	1 205 825	3 119	30. Jun. 2023	104 453
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	553 086	572 467	5. Sept. 2024	587 143
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	7 522 489	2 638 910	30. Jun. 2023	3 043 817
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	2 255 083	476 420	28. Apr. 2023	507 531
Verkauf Short	Schiffbau	Morgan Stanley	SGD	701 781	(112 709)	8. Mai 2024	(110 049)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	1 987 643	440 523	22. Jul. 2025	441 585
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	899 046	7 299	18. Sept. 2025	7 046
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	1 304 689	488 776	31. Okt. 2022	644 862
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	907 734	165 403	11. Sept. 2023	165 403
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	5 637 099	1 417 217	28. Apr. 2023	1 488 314
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	4 084 155	232 357	31. Okt. 2023	233 102
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	5 156 858	806 191	13. Jul. 2023	1 385 295
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	4 674 322	759 676	25. Aug. 2023	766 891
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	1 509 218	360 368	13. Jul. 2023	360 368
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	CHF	1 174 453	175 982	28. Mai 2025	212 924
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	USD	1 725 380	221 904	13. Jul. 2023	225 675
Verkauf Short	Diverse*	Morgan Stanley	EUR	2 293 401	48 982	29. Dez. 2023	188 916
Verkauf Short	Diverse*	Morgan Stanley	USD	30 503 004	878 453	17. Mai 2023	2346 075
EUR							35 550 217
Schroder GAIA Helix							
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	EUR	40 498 435	315 808	5. Sept. 2023	3 158 08
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	JPY	47 068 312	64 700	5. Sept. 2023	64 700
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	USD	31 936 247	50 414	5. Sept. 2023	50 414
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	128 004 816	11 768 121	5. Sept. 2023	11 768 121
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	AUD	14 232 409	495 672	5. Sept. 2023	495 672
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	JPY	17 797 737	835 246	5. Sept. 2023	835 246
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	223 680 004	16 887 312	5. Sept. 2023	16 887 312
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	JPY	108 645 253	5 090 054	5. Sept. 2023	5 090 054
USD							35 507 327
Schroder GAIA Sirius US Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	3 805 503	39 279	13. Dez. 2023	39 279
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	4 841 791	(565 330)	27. Feb. 2023	(565 330)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	584 518	(94 756)	14. Aug. 2023	(94 756)
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	USD	75 4815	(57 344)	13. Dez. 2023	(57 344)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	15 055 815	(2 118 459)	27. Feb. 2023	(2 119 023)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	620 240	(35 058)	29. Mai 2024	(142 164)
Kauf Long	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	5 817 552	(1 285 242)	14. Mrz. 2023	(1 288 257)
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	USD	4 292 012	(736 051)	28. Jun. 2023	(736 051)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Barclays Bank	USD	2 007 840	106 334	17. Okt. 2022	96 144

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

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

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	2 730 206	309 961	13. Sept. 2023	310 201
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	1 179 839	45 204	27. Dez. 2022	45 493
Verkauf Short	Baustoffe	Merrill Lynch	USD	979 629	98 725	31. Jul. 2023	98 725
Verkauf Short	Baustoffe	Merrill Lynch	USD	287 823	30 901	19. Sept. 2023	30 901
Verkauf Short	Baustoffe	Merrill Lynch	USD	512 480	40 419	29. Sept. 2023	40 419
Verkauf Short	Chemie	Merrill Lynch	USD	292 035	96 103	18. Sept. 2023	96 103
Verkauf Short	Chemie	Merrill Lynch	USD	200 080	28 704	19. Sept. 2023	28 704
Verkauf Short	Chemie	Merrill Lynch	USD	422 117	25 919	2. Okt. 2023	25 919
Verkauf Short	Chemie	Merrill Lynch	USD	299 087	24 479	6. Okt. 2023	24 479
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	3 865 625	720 997	21. Feb. 2023	720 997
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	348 801	8 934	2. Okt. 2023	8 934
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	695 815	204 974	16. Okt. 2023	204 974
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	1 347 799	335 644	13. Sept. 2023	335 644
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Merrill Lynch	USD	1 575 874	121 997	30. Mai 2023	121 997
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	308 441	59 043	14. Mrz. 2023	59 043
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 250 838	393 960	13. Sept. 2023	393 960
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	117 577	28 620	3. Apr. 2023	28 620
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	740 680	117 148	14. Apr. 2023	120 099
Verkauf Short	Umweltschutz	Goldman Sachs	USD	478 935	61 998	15. Nov. 2022	61 998
Verkauf Short	Umweltschutz	Merrill Lynch	USD	796 620	60 936	9. Jun. 2023	60 936
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	3 930 624	704 618	17. Nov. 2022	704 618
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	9 271 819	1 196 173	14. Mrz. 2023	1 196 173
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	3 995 484	716 403	14. Jun. 2023	716 403
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	4 292 501	877 880	13. Sept. 2023	877 880
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	4 958 199	499 319	13. Dez. 2023	499 319
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	4 936 399	453 370	28. Mrz. 2023	453 370
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	3 926 953	486 081	26. Mai 2023	486 081
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	4 135 505	617 480	23. Aug. 2023	617 480
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	10 483 112	1 431 634	30. Aug. 2023	1 431 634
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	444 407	52 889	12. Jun. 2023	52 889
Verkauf Short	Forstprodukte und Papier	Merrill Lynch	USD	197 199	50 491	18. Sept. 2023	50 491
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	941 262	(367)	30. Okt. 2023	(367)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Merrill Lynch	USD	302 633	19 577	9. Mrz. 2023	19 577
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Merrill Lynch	USD	311 977	67 757	18. Apr. 2023	67 757
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	824 448	76 207	13. Sept. 2023	76 207
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Merrill Lynch	USD	509 660	106 365	25. Sept. 2023	106 365
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	USD	487 589	93 135	13. Sept. 2023	93 135
Verkauf Short	Versicherungen	Merrill Lynch	USD	443 529	385 52	27. Dez. 2022	38 552
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	983 805	166 197	30. Mai 2023	166 197
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	626 475	142 162	13. Jul. 2023	142 162
Verkauf Short	Freizeit	Merrill Lynch	USD	1 418 284	256 778	25. Sept. 2023	256 778
Verkauf Short	Medien	Merrill Lynch	USD	275 505	115 046	30. Mai 2023	115 046
Verkauf Short	Medien	Merrill Lynch	USD	470 531	22 076	30. Okt. 2023	22 076
Verkauf Short	Bergbau	Merrill Lynch	USD	200 621	(262)	2. Okt. 2023	(262)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Merrill Lynch	USD	3 305 162	362 245	25. Sept. 2023	362 640
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	423 567	78 381	13. Dez. 2023	80 075
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Goldman Sachs	USD	222 921	34 727	14. Jun. 2023	34 727
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Merrill Lynch	USD	195 483	7 493	23. Okt. 2023	7 493
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	918 720	16 872	13. Jun. 2023	16 872

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

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	516 186	42 611	25. Sept. 2023	42 611
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	1 152 156	120 722	24. Okt. 2023	121 143
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1 234 726	9 068	13. Sept. 2023	8 543
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	961 919	100 435	16. Jun. 2023	100 435
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	480 056	65 601	14. Mrz. 2023	65 601
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	825 460	90 232	27. Dez. 2022	90 232
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	1 365 645	54 994	14. Aug. 2023	57 245
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	508 111	25 606	16. Okt. 2023	25 606
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	1 170 950	105 145	7. Aug. 2023	105 217
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	349 116	18 170	16. Okt. 2023	18 170
Verkauf Short	Telekommunikation	Merrill Lynch	USD	479 783	75 467	17. Jul. 2023	79 655
Verkauf Short	Transport	Merrill Lynch	USD	995 051	339 215	25. Sept. 2023	339 111
USD							7 695 581
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	563 309 009	18 017 797	21. Okt. 2022	18 017 797
USD							18 017 797
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	80 081	4 120	24. Mai 2023	4 120
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	GBP	17 4936	(8 035)	24. Mai 2023	(8 035)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	J.P. Morgan	GBP	6 453	737	9. Mai 2023	737
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	GBP	188 979	(11 202)	15. Mai 2023	(11 202)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	USD	108 703	(11 793)	15. Mai 2023	(11 793)
Kauf Long	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	207	(52)	24. Mai 2023	(52)
Kauf Long	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	61 342	(14 080)	15. Mai 2023	(14 080)
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	USD	23 958	(1 344)	25. Mai 2023	(1 344)
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	J.P. Morgan	USD	20 353	(3 393)	9. Mai 2023	(3 393)
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	102 585	(4 444)	15. Mai 2023	(4 444)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	4 161 777	(114 814)	24. Mai 2023	(114 814)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	6 862 395	(576 496)	24. Mai 2023	(576 496)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	DKK	223 774	(17 899)	10. Mai 2023	(17 899)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	4 803 606	(82 942)	9. Mai 2023	(78 068)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	GBP	1 727 134	(181 642)	9. Mai 2023	(176 508)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	517 416	(9 466)	9. Mai 2023	(9 466)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	USD	2 517 912	(116 652)	9. Mai 2023	(116 652)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	EUR	759 782	(56 015)	15. Mai 2023	(56 015)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	JPY	357 287	(1 044)	15. Mai 2023	(1 044)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	545 389	(61 340)	30. Sept. 2022	(61 340)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	6 236 073	(384 146)	15. Mai 2023	(384 146)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	624 621	(29 731)	24. Mai 2023	(29 731)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	GBP	1 799	(105)	24. Mai 2023	(105)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	154 087	(10 140)	24. Mai 2023	(10 140)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	3 289 666	(86 152)	24. Mai 2023	(86 152)
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	803 934	(54 698)	9. Mai 2023	(54 698)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	234 055	(20 172)	15. Mai 2023	(20 172)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	GBP	86 705	(3 731)	15. Mai 2023	(3 731)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	8763 398	(356 173)	15. Mai 2023	(356 173)
Kauf Long	Baustoffe	Morgan Stanley	HKD	430	(81)	15. Mai 2023	(81)
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	HKD	95 790	(19 378)	24. Mai 2023	(19 378)

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

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

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	USD	280 116	(19 631)	25. Mai 2023	(19 631)
Kauf Long	Kohle	J.P. Morgan	USD	222 857	(16 541)	9. Mai 2023	(16 541)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	246 595	(30 751)	24. Mai 2023	(30 751)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	165 603	(16 592)	24. Mai 2023	(16 592)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	HKD	165	(29)	9. Mai 2023	(29)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	30 286	(4 003)	15. Mai 2023	(4 003)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1 245 228	(175 452)	15. Mai 2023	(175 452)
Kauf Long	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	GBP	213 937	(26)	15. Mai 2023	(26)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	699 499	(9 187)	24. Mai 2023	(9 187)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 150 930	(29 723)	24. Mai 2023	(29 723)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	335 661	(11 584)	9. Mai 2023	(11 584)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	79 673	(1 831)	9. Mai 2023	(1 831)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1 937 128	(33 038)	9. Mai 2023	(33 038)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	526 601	(6 321)	15. Mai 2023	(6 321)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	65 333	(2 128)	15. Mai 2023	(2 128)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	517 868	(27 306)	15. Mai 2023	(27 306)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	3 749 923	(323 631)	15. Mai 2023	(323 631)
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	EUR	62 470	(635)	24. Mai 2023	(635)
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	USD	390 984	(29 088)	24. Mai 2023	(29 088)
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	EUR	139 239	(13 954)	9. Mai 2023	(13 954)
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	USD	26 609	(3 959)	9. Mai 2023	(3 959)
Kauf Long	Elektrik	Morgan Stanley	USD	169 431	2 009	15. Mai 2023	2 009
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	J.P. Morgan	EUR	8 443	(103)	9. Mai 2023	(103)
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	391 596	(20 139)	24. Mai 2023	(20 139)
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	564	(42)	25. Mai 2023	(42)
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	USD	456 946	(27 388)	9. Mai 2023	(27 388)
Kauf Long	Elektronik	Morgan Stanley	USD	139 175	(16 012)	15. Mai 2023	(16 012)
Kauf Long	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	6 756	(379)	25. Mai 2023	(379)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	24 2719	(8 379)	24. Mai 2023	(8 379)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	129 671	(7 589)	25. Mai 2023	(7 589)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	144 304	(15 682)	15. Mai 2023	(15 682)
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	1 758	(257)	15. Mai 2023	(257)
Kauf Long	Aktienindex	J.P. Morgan	JPY	168 551	(6 095)	9. Mai 2023	(6 095)
Kauf Long	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	1 062 239	(42 641)	9. Mai 2023	(42 641)
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	1 207 268	(51 388)	15. Mai 2023	(51 388)
Kauf Long	Lebensmittel	Morgan Stanley	HKD	44 175	(3 379)	15. Mai 2023	(3 379)
Kauf Long	Gas	Morgan Stanley	HKD	74 088	(12 173)	15. Mai 2023	(12 173)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	CHF	98 136	(7 037)	24. Mai 2023	(7 037)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	EUR	190 862	(18 040)	24. Mai 2023	(18 040)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	GBP	29 970	356	24. Mai 2023	356
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	HKD	2 865	33	24. Mai 2023	33
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	4 287 279	(201 538)	24. Mai 2023	(201 538)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	90 718	(997)	25. Mai 2023	(997)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	EUR	2 030	(127)	9. Mai 2023	(127)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	2 842 743	(158 027)	9. Mai 2023	(158 027)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	CHF	125 486	(4 512)	15. Mai 2023	(4 512)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	EUR	56 821	(5 653)	15. Mai 2023	(5 653)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	GBP	123 529	(1 081)	15. Mai 2023	(1 081)

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

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	HKD	107 993	(8 395)	15. Mai 2023	(8 395)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	USD	907 128	(80 755)	15. Mai 2023	(80 755)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	CHF	5 790	252	24. Mai 2023	252
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	5 543 582	(223 072)	24. Mai 2023	(223 072)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	CHF	63 805	(3 499)	9. Mai 2023	(3 499)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	2 171 333	(158 015)	9. Mai 2023	(158 015)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	CHF	242 350	731	15. Mai 2023	731
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1 929 780	(132 938)	15. Mai 2023	(132 938)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	JPY	39 322	(3 513)	24. Mai 2023	(3 513)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	USD	4 373	(388)	25. Mai 2023	(388)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	J.P. Morgan	JPY	13 411	(1 028)	9. Mai 2023	(1 028)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	26 088	(2 634)	15. Mai 2023	(2 634)
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	JPY	101 445	(10 348)	24. Mai 2023	(10 348)
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	396 404	(41 567)	24. Mai 2023	(41 567)
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	GBP	438 882	(10 295)	9. Mai 2023	(10 295)
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	HKD	84 127	(11 569)	9. Mai 2023	(11 569)
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	JPY	457 815	(38 376)	9. Mai 2023	(38 376)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	231 699	(17 873)	15. Mai 2023	(17 873)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	HKD	47 916	(7 566)	15. Mai 2023	(7 566)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	JPY	769 320	(65 982)	15. Mai 2023	(65 982)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	391 950	(35 453)	15. Mai 2023	(35 453)
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	HKD	78 659	(9 377)	9. Mai 2023	(9 377)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	HKD	536	(56)	15. Mai 2023	(56)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	705 723	(129 874)	15. Mai 2023	(129 874)
Kauf Long	Investmentgesellschaften	J.P. Morgan	SEK	395 201	(14 952)	9. Mai 2023	(14 952)
Kauf Long	Investmentgesellschaften	Morgan Stanley	SEK	724 915	(36 121)	15. Mai 2023	(36 121)
Kauf Long	Eisen / Stahl	J.P. Morgan	USD	83 206	(16 988)	9. Mai 2023	(16 988)
Kauf Long	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	EUR	4 690	(140)	24. Mai 2023	(140)
Kauf Long	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	68 650	(3 396)	24. Mai 2023	(3 396)
Kauf Long	Maschinen - Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	60 467	(7 056)	15. Mai 2023	(7 056)
Kauf Long	Medien	Goldman Sachs	USD	21 283	(3 069)	24. Mai 2023	(3 069)
Kauf Long	Medien	J.P. Morgan	USD	105 591	(17 937)	9. Mai 2023	(17 937)
Kauf Long	Metallprodukte/Eisenwaren	Goldman Sachs	EUR	59 830	2 213	24. Mai 2023	2 213
Kauf Long	Metallprodukte/Eisenwaren	Morgan Stanley	SEK	33 231	118	15. Mai 2023	118
Kauf Long	Metallprodukte/Eisenwaren	Morgan Stanley	USD	309 322	(18 777)	15. Mai 2023	(18 777)
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	GBP	313 026	(150)	24. Mai 2023	(150)
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	GBP	482 573	(1 351)	9. Mai 2023	(1 351)
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	CAD	544 114	(11 838)	15. Mai 2023	(11 838)
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	USD	178 229	(14 282)	15. Mai 2023	(14 282)
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	3 797	(254)	25. Mai 2023	(254)
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	NOK	69 422	(2 699)	24. Mai 2023	(699)
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	USD	6 485	(413)	24. Mai 2023	(413)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	CAD	105 992	(4 368)	9. Mai 2023	(4 368)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	JPY	3 469	(332)	9. Mai 2023	(332)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	USD	1 718 748	(116 418)	9. Mai 2023	(116 418)
Kauf Long	Öl u. Gas	Morgan Stanley	CAD	142 915	(8 066)	15. Mai 2023	(8 066)
Kauf Long	Öl u. Gas	Morgan Stanley	USD	985 859	(102 070)	15. Mai 2023	(102 070)
Kauf Long	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	141 557	(5 532)	9. Mai 2023	(5 532)

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

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Öl- u. Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	HKD	964	(46)	15. Mai 2023	(46)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	1 034 755	(2 615)	24. Mai 2023	(2 615)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	446 210	15 804	24. Mai 2023	15 804
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	2 151 033	(10 920)	24. Mai 2023	(10 920)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	HKD	5 694	252	24. Mai 2023	252
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	1 712 935	82 802	24. Mai 2023	82 802
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	3 193 097	28 491	24. Mai 2023	28 491
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	139 043	(7 452)	9. Mai 2023	(7 452)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	439 969	(27 622)	9. Mai 2023	(27 622)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	HUF	125 316	(7 120)	9. Mai 2023	(7 120)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	304 372	(6 892)	9. Mai 2023	(6 892)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	4 158 242	(104 578)	9. Mai 2023	(104 578)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	181 509	(18 190)	15. Mai 2023	(18 190)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	GBP	208 604	5 989	15. Mai 2023	5 989
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	394 142	(635)	15. Mai 2023	(635)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2 082 127	(136 865)	15. Mai 2023	(136 865)
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	1 147 872	(68 921)	9. Mai 2023	(68 921)
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	CAD	361 535	(38 847)	15. Mai 2023	(38 847)
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	656 683	(59 352)	15. Mai 2023	(59 352)
Kauf Long	Private Equity	Goldman Sachs	USD	933 295	(149 008)	24. Mai 2023	(149 008)
Kauf Long	Private Equity	J.P. Morgan	USD	1 468 908	(223 713)	9. Mai 2023	(223 713)
Kauf Long	Private Equity	Morgan Stanley	USD	617 013	(65 166)	15. Mai 2023	(65 166)
Kauf Long	Immobilien	Goldman Sachs	SEK	203 809	4 395	24. Mai 2023	4 395
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	GBP	77 524	(9 763)	24. Mai 2023	(9 763)
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	USD	214 282	(26 912)	24. Mai 2023	(26 912)
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	GBP	84 786	(13 984)	9. Mai 2023	(13 984)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	98 957	(2 485)	24. Mai 2023	(2 485)
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	475 501	(52 659)	15. Mai 2023	(52 659)
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	EUR	2 469	(237)	24. Mai 2023	(237)
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	JPY	65 409	(7 224)	24. Mai 2023	(7 224)
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	57 027	(4 324)	24. Mai 2023	(4 324)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	JPY	22 272	(2 288)	9. Mai 2023	(2 288)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	218 562	(33 043)	9. Mai 2023	(33 043)
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	227 049	(34 071)	9. Mai 2023	(34 071)
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	496 008	(39 040)	15. Mai 2023	(39 040)
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	EUR	453 304	(50 909)	15. Mai 2023	(50 909)
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	27 189 493	330 563	27. Mrz. 2023	330 563
Kauf Long	Wasser	Morgan Stanley	USD	127 212	(2 733)	15. Mai 2023	(2 733)
Verkauf Short	Werbung	Goldman Sachs	USD	802 681	32 598	24. Mai 2023	32 598
Verkauf Short	Fluggesellschaften	Goldman Sachs	USD	132 653	27 325	24. Mai 2023	27 325
Verkauf Short	Fluggesellschaften	Morgan Stanley	USD	125 723	16 332	15. Mai 2023	16 332
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	EUR	164 152	6 293	9. Mai 2023	6 293
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	EUR	49 834	3 346	24. Mai 2023	3 346
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	HKD	65 344	5 905	24. Mai 2023	5 905
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	633 871	79 408	24. Mai 2023	79 408
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	USD	71 369	3 670	9. Mai 2023	3 670
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	HKD	97 588	12 328	15. Mai 2023	12 328
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	921 464	111 926	15. Mai 2023	111 926

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

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

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	HKD	164 825	9 955	24. Mai 2023	9 955
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	JPY	113 549	3 028	24. Mai 2023	3 028
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	USD	223 217	20 443	24. Mai 2023	20 443
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	J.P. Morgan	USD	1 063	169	9. Mai 2023	169
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	JPY	2 172	65	15. Mai 2023	65
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	264 052	39 787	15. Mai 2023	39 787
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	AUD	535 873	31 086	24. Mai 2023	31 086
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CZK	158 803	3 437	24. Mai 2023	3 437
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	5 897 573	441 655	24. Mai 2023	442 933
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	GBP	1 793 461	177 476	24. Mai 2023	177 476
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	PLN	774 836	46 809	24. Mai 2023	46 809
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SEK	814 549	24 297	24. Mai 2023	24 297
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	13 179 606	1 069 922	24. Mai 2023	1 069 922
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	CHF	443 042	24 865	9. Mai 2023	24 865
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	CZK	409 250	(40 773)	9. Mai 2023	(40 773)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	6 960 206	442 397	9. Mai 2023	421 076
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	GBP	1 929 442	154 793	9. Mai 2023	146 929
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	1 302 943	(25 876)	9. Mai 2023	(25 876)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SGD	2 643	5	9. Mai 2023	5
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	2 110 092	57 025	9. Mai 2023	57 025
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	AUD	718 325	28 596	15. Mai 2023	28 596
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CAD	1 268 559	48 446	15. Mai 2023	48 446
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	EUR	995 173	97 890	15. Mai 2023	97 890
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	17 908 113	1 361 538	15. Mai 2023	1 361 538
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	HKD	63 780	636	24. Mai 2023	636
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	HKD	961	(63)	9. Mai 2023	(63)
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	HKD	4 517	(186)	15. Mai 2023	(186)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	AUD	418 246	(2 825)	24. Mai 2023	(2 825)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	CHF	564 080	41 279	24. Mai 2023	41 279
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	EUR	190 876	12 068	24. Mai 2023	12 068
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	256 881	4 053	24. Mai 2023	4 053
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	NOK	76 234	4 717	24. Mai 2023	4 717
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	1 602 082	(26 115)	24. Mai 2023	(26 115)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	AUD	2 387	75	9. Mai 2023	75
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	CHF	50 030	3 466	9. Mai 2023	3 466
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	EUR	14 869	701	9. Mai 2023	701
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	HKD	118 509	11 379	9. Mai 2023	11 379
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	NOK	15 442	3 925	9. Mai 2023	3 925
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	2 194 020	165 739	9. Mai 2023	165 739
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	AUD	546 556	4 695	15. Jun. 2032	4 695
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	HKD	79 676	5 913	15. Mai 2023	5 913
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	NOK	154 214	47 300	15. Mai 2023	47 300
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	6 210 406	643 920	15. Mai 2023	643 920
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	CHF	4 460	144	24. Mai 2023	144
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	417 639	7 759	24. Mai 2023	7 759
Verkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	JPY	115 154	2 453	9. Mai 2023	2 453
Verkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	USD	54 657	(10)	9. Mai 2023	(10)
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	175 000	2 678	15. Mai 2023	2 678

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

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	USD	165 264	10 849	24. Mai 2023	10 849
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	USD	3 415	(95)	25. Mai 2023	(95)
Verkauf Short	Chemie	Morgan Stanley	USD	879 684	31 739	15. Mai 2023	31 739
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	177 651	18 171	24. Mai 2023	18 171
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	85 822	12 627	9. Mai 2023	12 627
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1 500 258	119 086	15. Mai 2023	119 086
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	59 151	7 050	24. Mai 2023	7 050
Verkauf Short	Computer	J.P. Morgan	USD	92 051	964	9. Mai 2023	964
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	1 585 237	92 805	15. Mai 2023	92 805
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	EUR	144 206	1 627	24. Mai 2023	1 627
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	JPY	2 978	(21)	24. Mai 2023	(21)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	47 788	1 703	15. Mai 2023	1 703
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	USD	241 620	19 672	15. Mai 2023	19 672
Verkauf Short	Rentenfonds	Goldman Sachs	EUR	111 364	1 458	24. Mai 2023	1 458
Verkauf Short	Rentenfonds	Goldman Sachs	USD	5 579	117	24. Mai 2023	117
Verkauf Short	Rentenfonds	Morgan Stanley	EUR	4 093 723	79 126	15. Mai 2023	79 126
Verkauf Short	Rentenfonds	Morgan Stanley	USD	255 385	5 945	15. Mai 2023	5 945
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Goldman Sachs	EUR	260 444	3 399	24. Mai 2023	3 399
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Goldman Sachs	USD	125 803	8 125	24. Mai 2023	8 125
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	J.P. Morgan	USD	129 689	1 330	5. Mai 2023	1 330
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Morgan Stanley	USD	142 701	5 136	15. Mai 2023	5 136
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	1 575 919	140 673	24. Mai 2023	140 673
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	1 269 603	105 040	24. Mai 2023	105 040
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	SEK	172 747	(10 542)	24. Mai 2023	(10 542)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	3 176 651	233 262	24. Mai 2023	233 262
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	691 476	41 862	9. Mai 2023	41 862
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	215 540	10 467	9. Mai 2023	10 467
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	15 400	1 003	9. Mai 2023	1 003
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	SEK	216 931	26 477	9. Mai 2023	26 477
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	SGD	2 633	(4)	9. Mai 2023	(4)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1 796 327	122 288	9. Mai 2023	122 288
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	544 919	104 781	15. Mai 2023	104 781
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	582 358	25 053	15. Mai 2023	25 053
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	653 180	59 330	15. Mai 2023	59 330
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	SEK	455 840	(8 555)	15. Mai 2023	(8 555)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	253 501	15 461	30. Sept. 2022	15 461
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	4 886 018	335 668	15. Mai 2023	335 668
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	5 399 202	649 580	24. Mai 2023	649 580
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	863 212	97 002	5. Mai 2023	97 002
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	1 695 777	203 453	9. Mai 2023	203 453
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	HKD	53 402	5 566	15. Mai 2023	5 566
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	2 373 890	242 801	15. Mai 2023	242 801
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	28 770	2 940	24. Mai 2023	2 940
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley	USD	409 719	64 874	15. Mai 2023	64 874
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	JPY	824 140	14 864	24. Mai 2023	14 864
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	JPY	61 256	2 952	9. Mai 2023	2 952
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	EUR	156 136	81 910	15. Mai 2023	81 910
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	477 549	43 203	15. Mai 2023	43 203

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	NOK	167 935	(2 669)	24. Mai 2023	(2 669)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	SEK	28 094	(51)	24. Mai 2023	(51)
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	270 415	22 850	24. Mai 2023	22 850
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	HKD	1 101	177	9. Mai 2023	177
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	SEK	92 587	13 483	9. Mai 2023	13 483
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	274 144	30 079	9. Mai 2023	30 079
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	NOK	31 570	1 737	15. Mai 2023	1 737
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	SEK	46 319	2 042	15. Mai 2023	2 042
Verkauf Short	Energie-Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	USD	504 300	73 538	15. Mai 2023	73 538
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	246 581	9 594	24. Mai 2023	9 594
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	171 980	2 915	24. Mai 2023	2 915
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	EUR	155 163	24 206	9. Mai 2023	24 206
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	388 762	38 981	15. Mai 2023	38 981
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	96 167	2 737	15. Mai 2023	2 737
Verkauf Short	Umweltschutz	Morgan Stanley	USD	90 070	16 649	15. Mai 2023	16 649
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	EUR	308 101	26 698	24. Mai 2023	26 698
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	JPY	1 936 851	89 783	24. Mai 2023	89 783
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	7 011 862	306 810	24. Mai 2023	306 810
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	712 252	(3 018)	5. Mai 2023	(3 018)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	5 448 272	522 204	9. Mai 2023	528 884
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	3 277 270	272 511	15. Mai 2023	272 511
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	24 914 303	2 267 906	15. Mai 2023	2 268 911
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	EUR	106 765	4 833	24. Mai 2023	4 833
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	GBP	26 001	5 657	24. Mai 2023	5 657
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	129 798	4 202	24. Mai 2023	4 202
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	147 194	12 203	9. Mai 2023	12 203
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	JPY	3 755	(35)	9. Mai 2023	(35)
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	USD	63 464	665	22. Mai 2023	665
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	257 959	13 398	15. Mai 2023	13 398
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	GBP	56 784	15 144	15. Mai 2023	15 144
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	131 816	(2 544)	15. Mai 2023	(2 544)
Verkauf Short	Gas	Goldman Sachs	USD	1 252 302	134 432	24. Mai 2023	134 432
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	USD	260 305	28 370	15. Mai 2023	28 370
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	CHF	512 343	19 273	24. Mai 2023	19 273
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	DKK	123 842	(1 233)	24. Mai 2023	(1 233)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	HKD	38 688	4 098	24. Mai 2023	4 098
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	SEK	388 386	5 217	24. Mai 2023	5 217
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	958 898	66 389	24. Mai 2023	66 389
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	DKK	138 032	9 457	9. Mai 2023	9 457
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	SEK	210 388	8 751	9. Mai 2023	8 751
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	327 979	(5 262)	9. Mai 2023	(5 262)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	HKD	213 328	25 815	15. Mai 2023	25 815
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	SEK	167 547	7 038	15. Mai 2023	7 038
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	USD	856 439	67 954	15. Mai 2023	67 954
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	490 706	14 798	24. Mai 2023	14 798
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	JPY	224 355	7 930	24. Mai 2023	7 930
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	2 181 651	107 829	24. Mai 2023	107 829
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	235 592	21 112	9. Mai 2023	21 112
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	32 637	2 904	9. Mai 2023	2 904

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

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	476 324	41 759	9. Mai 2023	41 759
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	541 066	39 872	15. Mai 2023	39 872
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	220 365	8 371	15. Mai 2023	8 371
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	902 106	73 219	15. Mai 2023	73 219
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	161 799	9 437	24. Mai 2023	9 437
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	208 454	8 584	15. Mai 2023	8 354
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	USD	169 670	12 886	15. Mai 2023	12 886
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	CHF	92 781	7 924	24. Mai 2023	7 924
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	EUR	739 973	(4 505)	24. Mai 2023	(4 505)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	GBP	1 633 875	139 492	24. Mai 2023	139 492
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	4 051 062	291 464	24. Mai 2023	291 464
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	AUD	451 839	-	9. Mai 2023	-
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	CHF	217 026	15 337	9. Mai 2023	15 337
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	EUR	789 276	6 957	9. Mai 2023	6 957
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	GBP	88 514	12 034	9. Mai 2023	12 034
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	JPY	425 448	19 168	9. Mai 2023	19 168
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	USD	1 564 824	64 701	9. Mai 2023	64 701
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	CHF	422 836	47 389	15. Mai 2023	47 389
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	445 957	35 669	30. Sept. 2022	35 669
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	222 971	9 912	15. Mai 2023	9 912
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	JPY	424 378	36 971	15. Mai 2023	36 971
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	395 133	26 381	30. Sept. 2022	26 381
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	3 130 178	175 967	15. Mai 2023	178 793
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	EUR	123 253	30 623	24. Mai 2023	30 623
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	GBP	17 453	2 905	15. Mai 2023	2 905
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	HKD	118 339	(2 757)	15. Mai 2023	(2 757)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	146 110	13 551	15. Mai 2023	13 551
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Goldman Sachs	SEK	46 769	363	24. Mai 2023	363
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Goldman Sachs	USD	451 506	66 982	24. Mai 2023	66 982
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	J.P. Morgan	SEK	409 610	16 903	9. Mai 2023	16 903
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Morgan Stanley	SEK	1 481 483	75 227	15. Mai 2023	75 227
Verkauf Short	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	USD	166 415	552	15. Mai 2023	552
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	JPY	115 229	837	24. Mai 2023	837
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	USD	309 741	12 013	9. Mai 2023	12 013
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	CAD	85 720	1 639	15. Mai 2023	1 639
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	JPY	2 208	33	15. Mai 2023	33
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	110 784	18 391	15. Mai 2023	18 391
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	GBP	194 608	23 274	24. Mai 2023	23 274
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	USD	106 964	8 585	9. Mai 2023	8 585
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	GBP	163 617	22 946	15. Mai 2023	22 946
Verkauf Short	Maschinen - Bau u. Bergbau	Goldman Sachs	USD	215 724	16 859	24. Mai 2023	16 859
Verkauf Short	Maschinen - Bau u. Bergbau	Morgan Stanley	USD	219 067	22 675	15. Mai 2023	23 637
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	245 658	18 739	24. Mai 2023	18 739
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	227 531	16 095	15. Mai 2023	16 095
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	391 898	49 491	15. Mai 2023	49 491
Verkauf Short	Bergbau	J.P. Morgan	USD	109 832	4 386	5. Mai 2023	4 474
Verkauf Short	Bergbau	Morgan Stanley	USD	18 255	1 502	15. Mai 2023	1 502
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	151 825	10 670	24. Mai 2023	10 670

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

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	688 558	50 620	15. Mai 2023	51 345
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	AUD	214 656	19 486	24. Mai 2023	19 486
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	CAD	188 208	10 460	25. Mai 2023	10 460
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	EUR	609 721	2 139	24. Mai 2023	2 139
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	JPY	294 865	28 837	24. Mai 2023	28 837
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	USD	1 690 728	74 686	24. Mai 2023	74 686
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	CAD	928 472	92 424	9. Mai 2023	92 424
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	EUR	114 727	13 536	9. Mai 2023	13 536
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	USD	7 288 436	787 045	9. Mai 2023	796 239
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	AUD	114 891	11 979	15. Jun. 2032	11 979
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	CAD	1 955 589	144 738	15. Mai 2023	144 738
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	HKD	2 898	22	15. Mai 2023	22
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	USD	3 030 840	368 725	15. Mai 2023	368 725
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	663 874	72 108	24. Mai 2023	72 108
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1 125 907	56 531	9. Mai 2023	56 531
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	189 143	10 279	15. Mai 2023	10 279
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Goldman Sachs	USD	2 958	63	22. Mai 2023	63
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Goldman Sachs	USD	171 399	10 418	24. Mai 2023	10 418
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Morgan Stanley	USD	214 608	20 747	15. Mai 2023	20 747
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	DKK	631 748	(19 964)	24. Mai 2023	(19 964)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	1 194 272	23 648	24. Mai 2023	23 648
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	68 738	6 954	24. Mai 2023	6 954
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	HKD	165 304	10 885	24. Mai 2023	10 885
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	274 054	(272)	24. Mai 2023	(272)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	692 272	42 882	24. Mai 2023	42 882
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	17 791	228	25. Mai 2023	228
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	DKK	17 724	480	9. Mai 2023	480
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	38 694	924	9. Mai 2023	924
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	165 963	25 914	9. Mai 2023	25 914
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	2 506	(12)	9. Mai 2023	(12)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	28 746	2 128	9. Mai 2023	2 128
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	DKK	259 837	2 346	15. Mai 2023	2 346
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	5 338	142	15. Mai 2023	142
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	HKD	16 024	1 980	15. Mai 2023	1 980
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	587 645	9 569	15. Mai 2023	9 569
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1 075 679	22 519	15. Mai 2023	22 519
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	1 030 628	72 547	24. Mai 2023	72 547
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	1 829 441	216 637	9. Mai 2023	216 637
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	USD	523 937	64 623	15. Mai 2023	64 623
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	USD	1 409 093	92 738	24. Mai 2023	92 738
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	USD	179 677	2 440	9. Mai 2023	2 440
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	SEK	154 070	20 334	15. Mai 2023	20 334
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	USD	1 407 043	120 103	15. Mai 2023	120 103
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	SEK	536 917	21 772	24. Mai 2023	21 772
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	USD	642	110	25. Mai 2023	110
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	SEK	348 941	46 677	9. Mai 2023	46 677
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	USD	5 058	527	9. Mai 2023	527
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	SEK	621 479	49 762	15. Mai 2023	49 762

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

Total Return Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	EUR	9 843	1 107	24. Mai 2023	1 107
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	1 542 014	290 642	24. Mai 2023	290 642
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	SGD	2 508	99	9. Mai 2023	99
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	USD	22 565	2 964	9. Mai 2023	2 964
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	1 164 291	156 626	15. Mai 2023	156 626
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	JPY	3 657	50	24. Mai 2023	50
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	SEK	5 263	162	24. Mai 2023	162
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	631 689	32 251	24. Mai 2023	32 251
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	HKD	421 939	62 556	9. Mai 2023	62 556
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	1 084 889	120 407	9. Mai 2023	120 407
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	HKD	404 196	62 840	15. Mai 2023	62 840
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	JPY	1 582	2	15. Mai 2023	2
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	SEK	15 046	604	15. Mai 2023	604
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	SGD	2 626	137	15. Mai 2023	137
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	1 612 267	103 478	15. Mai 2023	103 478
Verkauf Short	Spar- und Darlehensgeschäft	Goldman Sachs	USD	691 559	59 331	24. Mai 2023	59 331
Verkauf Short	Spar- und Darlehensgeschäft	Morgan Stanley	USD	615 821	28 819	15. Mai 2023	28 819
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	187 624	22 994	24. Mai 2023	22 994
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	EUR	108 512	6 548	9. Mai 2023	6 548
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	442 487	43 675	15. Mai 2023	43 675
Verkauf Short	Schiffbau	Morgan Stanley	USD	159 563	16 567	15. Mai 2023	16 567
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	CHF	33 751	2 664	24. Mai 2023	2 664
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	GBP	18 364	1 802	24. Mai 2023	1 802
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	156 548	(14 051)	24. Mai 2023	(14 051)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	570 573	21 091	24. Mai 2023	21 091
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	AUD	162 264	4 263	9. Mai 2023	4 263
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	51 257	5 126	9. Mai 2023	5 126
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	45 501	2 900	15. Mai 2023	2 900
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	EUR	29 922	299	15. Mai 2023	299
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	685 175	74 617	15. Mai 2023	74 617
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	329 881	22 483	24. Mai 2023	22 483
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	JPY	80 424	8 613	9. Mai 2023	8 613
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	171 846	42 473	9. Mai 2023	42 473
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	318 613	26 990	15. Mai 2023	26 990
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	DKK	76 208	4 344	24. Mai 2023	4 344
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	JPY	662 873	131 926	24. Mai 2023	131 926
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	USD	111 004	19 997	24. Mai 2023	19 997
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	DKK	314 143	51 379	9. Mai 2023	51 379
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	JPY	46 669	10 195	9. Mai 2023	10 195
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	USD	150 627	16 143	9. Mai 2023	16 143
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	DKK	43 772	4 401	15. Mai 2023	4 401
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	HKD	52 714	4 929	15. Mai 2023	4 929
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	JPY	45 481	8 762	15. Mai 2023	8 762
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	USD	276 752	8 285	15. Mai 2023	8 806
Verkauf Short	Wasser	Goldman Sachs	USD	96 161	9 469	24. Mai 2023	9 469
Verkauf Short	Wasser	Morgan Stanley	USD	483 431	45 507	15. Mai 2023	45 507
USD							12 526 162

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

Differenzkontrakte

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

Zum 30. September 2022 wiesen die folgenden Teilfonds Differenzkontrakte auf Finanzindizes und Futures-Kontrakte auf:

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD auf den Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Bank of America	(1 082)	(505 605)	43 179
CFD auf den Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Bank of America	(857)	(100 016)	(330)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Bank of America	45	24 194	(6 152)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Bank of America	(623)	(643 396)	30 745
CFD auf den Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Bank of America	(1 347)	(610 678)	50 663
CFD auf den Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Bank of America	(891)	(466 826)	40 009
CFD auf den Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Bank of America	281	204 260	(11 765)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Bank of America	276	252 722	(11 913)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Index	Bank of America	(1 125)	(622 095)	55 869
CFD auf den Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Bank of America	467	125 780	(89 802)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Media Price Index	Bank of America	(1 437)	(423 218)	15 274
CFD auf den Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Bank of America	576	174 484	(13 385)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Bank of America	(218)	(189 602)	1 448
CFD auf den Stoxx Europe 600 Retail Price Index	Bank of America	(583)	(142 094)	15 181
CFD auf den Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Bank of America	(1 367)	(698 266)	61 393
CFD auf den Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Bank of America	992	187 141	(27 309)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Bank of America	(2 962)	(498 110)	39 225
CFD auf den Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Bank of America	968	307 138	(30 016)
CFD auf den S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	(940)	(1 054 974)	83 864
CFD auf den S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	(8)	(5 566)	429
CFD auf den S&P 500 Energy Sector Index	Goldman Sachs	229	126 536	(13 566)
CFD auf den S&P 500 Financials Sector Index	Goldman Sachs	(3 575)	(1 803 197)	145 674
CFD auf den S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	(709)	(1 000 652)	(61 702)
CFD auf den S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	(1 849)	(1 295 406)	31 904
CFD auf den S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	(692)	(1 439 253)	162 548
CFD auf den S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	(2 771)	(1 185 345)	153 046
CFD auf den S&P 500 Utilities Sector Index	Goldman Sachs	1 380	458 881	(85 800)
			USD (10 823 163)	578 711
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
CFD auf australische Aktien	Morgan Stanley	(56 367)	334 592	334 592
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	260 000	278 625	278 625
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	(151 937)	338 380	338 380
CFD auf neuseeländische Aktien	Morgan Stanley	(40 917)	299 019	299 019
CFD auf norwegische Aktien	Morgan Stanley	408 000	322 248	322 248
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	(38 517)	109 773	109 773
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(1 027 576)	6 515 711	6 529 607
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(1 971 428)	8 202 479	8 217 327
			USD 16 400 827	16 429 571
Schroder GAIA Helix				
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	3 044 520	(738 984)	(738 984)
CFD auf australische Aktien	J.P. Morgan	1 408 819	(510 869)	(510 869)
CFD auf österreichische Aktien	Goldman Sachs	78 259	(25 175)	(24 365)
CFD auf österreichische Aktien	J.P. Morgan	21 623	(51 019)	(56 521)
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	46 935	(96 858)	(96 749)

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

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf belgische Aktien	J.P. Morgan	7 388	(26 818)	(26 818)
CFD auf brasilianische Aktien	Goldman Sachs	218	(6 573)	(6 573)
CFD auf brasilianische Aktien	J.P. Morgan	781	(82 255)	(82 255)
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	1 880 690	(2 406 757)	(2 374 401)
CFD auf britische Aktien	J.P. Morgan	2 014 789	(472 271)	(472 271)
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	18 466	(24 831)	(24 831)
CFD auf kanadische Aktien	J.P. Morgan	11 782	(49 093)	(49 093)
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	13 316 895	(5 552 136)	(5 554 769)
CFD auf chinesische Aktien	J.P. Morgan	5 638 834	(2 284 290)	(2 284 290)
CFD auf dänische Aktien	Goldman Sachs	51 256	(192 562)	(192 562)
CFD auf dänische Aktien	J.P. Morgan	39 612	(68 056)	(68 056)
CFD auf niederländische Aktien	Goldman Sachs	778 654	(640 735)	(641 697)
CFD auf niederländische Aktien	J.P. Morgan	112 773	(136 614)	(136 614)
CFD auf finnische Aktien	Goldman Sachs	68 555	355 671	366 836
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	366 741	(1 296 388)	(1 303 894)
CFD auf französische Aktien	J.P. Morgan	340 369	(607 998)	(607 998)
CFD auf georgische Aktien	Goldman Sachs	(39 384)	33 853	33 853
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	268 990	(1 026 145)	(1 026 774)
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	52 127	(86 892)	(86 892)
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	4 748 801	(2 065 264)	(2 061 036)
CFD auf Aktien aus Hongkong	J.P. Morgan	1 709 900	(594 041)	(594 041)
CFD auf ungarische Aktien	Goldman Sachs	(25 015)	31 394	31 394
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	90 161	(190 620)	(190 620)
CFD auf indische Aktien	J.P. Morgan	81 335	(586 256)	(595 178)
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	200 699	(220 087)	(220 087)
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	4 501	(79 713)	(79 713)
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	161 304	(105 526)	(97 462)
CFD auf italienische Aktien	J.P. Morgan	379 003	(256 834)	(256 834)
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	1 268 400	(813 682)	(813 682)
CFD auf japanische Aktien	J.P. Morgan	15 737 000	(9 963 828)	(9 963 828)
CFD auf luxemburgische Aktien	Goldman Sachs	23 374	(22 435)	(22 110)
CFD auf Aktien aus Macau	Goldman Sachs	262 000	141 849	141 849
CFD auf Aktien aus Monaco	J.P. Morgan	3 583	(4 192)	(4 192)
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	342 464	(97 921)	(97 921)
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P. Morgan	511 325	(8 677)	(8 677)
CFD auf norwegische Aktien	Goldman Sachs	90 862	(254 102)	(254 102)
CFD auf norwegische Aktien	J.P. Morgan	75 114	(148 943)	(148 943)
CFD auf portugiesische Aktien	J.P. Morgan	115 005	(39 660)	(39 660)
CFD auf russische Aktien	Goldman Sachs	6 978	-	-
CFD auf saudi-arabische Aktien	J.P. Morgan	221 073	(34 256)	(34 256)
CFD auf Aktien aus Singapur	Goldman Sachs	653 174	(38 538)	(38 538)
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	1 610 800	(245 264)	(245 264)
CFD auf südkoreanische Aktien	Goldman Sachs	(36 336)	107 823	107 823
CFD auf südkoreanische Aktien	J.P. Morgan	(19 122)	(33 459)	(33 459)
CFD auf spanische Aktien	Goldman Sachs	371 362	(210 959)	(210 959)
CFD auf spanische Aktien	J.P. Morgan	896 108	(278 613)	(278 613)
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	262 120	(200 656)	(203 062)
CFD auf schwedische Aktien	J.P. Morgan	120 050	(14 525)	(14 525)
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	19 876	(79 121)	(80 064)
CFD auf Schweizer Aktien	J.P. Morgan	8 392	(51 631)	(51 631)
CFD auf taiwanische Aktien	Goldman Sachs	11 844	(135 851)	(135 851)

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

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf taiwanische Aktien	J.P. Morgan	(1 425 891)	143 416	143 416
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	1 740 483	(4 727 028)	(4 739 142)
CFD auf US-Aktien	J.P. Morgan	757 474	(1 039 483)	(1 042 929)
CFD auf FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(251)	381 004	381 004
CFD auf GS UK Custom Basket	Goldman Sachs	(55 905)	414 674	414 674
CFD auf GS Tactical Factor Value United States Bottom PR USD	Goldman Sachs	(6 681)	1 031 279	1 031 279
CFD auf GS Tactical Factor Value United States Top PR USD	Goldman Sachs	9 859	(1 199 150)	(1 199 150)
CFD auf HXE Europe Banks Index	Goldman Sachs	77 817	(474 737)	(474 737)
CFD auf HXE Pharma Index	Goldman Sachs	84 335	148 782	148 782
CFD auf HXE Staples Index	Goldman Sachs	202 383	(220 140)	(220 140)
CFD auf HXE-Telefonindex	Goldman Sachs	51 402	(89 889)	(89 889)
CFD auf MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(57 757)	8 165 107	8 165 107
CFD auf MSCI EM Europe 10/40 Index	Goldman Sachs	(838)	24 622	24 622
			USD (29 928 926)	(29 916 932)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	(1 221 894)	(114 327)	(111 365)
CFD auf niederländische Aktien	Morgan Stanley	46 784	(26 199)	(26 199)
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(62 441)	134 368	134 368
CFD auf FTSE 250 Index	Bank of America	(94)	127 821	127 821
CFD auf MSBEUK01 Index	Morgan Stanley	(23 338)	138 628	138 628
			GBP 260 291	263 253

Credit Default Index-Swapkontrakte

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

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

Am 30. September 2022 waren die folgenden Teilfonds Credit Default Index-Kontrakte auf Finanzindizes eingegangen:

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten %	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 38 20/12/2027	J.P. Morgan	EUR	10 000 000	5,00	20. Dez. 2027	504 426
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 38 20/12/2027	J.P. Morgan	EUR	42 000 000	1,00	20. Dez. 2027	636 426
Verkauf	CDX North America High Yield Series 39 20/12/2027	J.P. Morgan	USD	7 000 000	5,00	20. Dez. 2027	276 581
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 39 20/12/2027	J.P. Morgan	USD	24 000 000	1,00	20. Dez. 2027	72 480
						USD	1 489 913
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 38 20/12/2027	Citi Bank	EUR	10 000 000	5,00	20. Dez. 2027	(196 908)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 38 20/12/2027	Citi Bank	EUR	10 000 000	1,00	20. Dez. 2027	75 184
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							

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

Credit Default Index Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten %	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 38 20/12/2027	Citi Bank	EUR	74 000 000	1,00	20. Dez. 2027	460 221
Verkauf	CDX North America High Yield Series 39 20/12/2027	Citi Bank	USD	20 000 000	5,00	20. Dez. 2027	44 214
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 39 20/12/2027	Citi Bank	USD	30 000 000	1,00	20. Dez. 2027	153 396
USD							536 107
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	CDX Emerging Markets Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	USD	9 882 000	1,00	20. Dez. 2027	21 522
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	2 380 000	5,00	20. Dez. 2027	22 736
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 37 20/06/2027	Morgan Stanley	EUR	10 380 000	1,00	20. Jun. 2027	150 842
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	1 000 000	1,00	20. Dez. 2027	7 226
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 36 20/12/2026	Morgan Stanley	EUR	4 405 000	1,00	20. Dez. 2026	(26 448)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	23 360 000	1,00	20. Dez. 2027	33 750
Verkauf	CDX iTraxx Europe Subordinated Financial Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	3 970 000	1,00	20. Dez. 2027	45 888
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 39 20/12/2027	Morgan Stanley	USD	6 445 000	1,00	20. Dez. 2027	(6 821)
USD							248 695

Credit Default 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 Swapkontrakten“ aufgeführt.

Zum 30. September 2022 war der folgende Teilfonds Credit-Default-Swap-Kontrakte eingegangen:

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	Österreich	Telekommunikation	Morgan Stanley	EUR	5 530 000	20. Dez. 2027	44 713
Verkauf	Belgien	Chemie	Morgan Stanley	EUR	1 280 000	20. Dez. 2027	5 473
Verkauf	China	Banken	Goldman Sachs	USD	2 255 000	20. Jun. 2027	(9 822)
Verkauf	China	Banken	Morgan Stanley	USD	6 717 428	20. Jun. 2027	74 715
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	8 927 382	20. Jun. 2027	(105 219)
Verkauf	Dänemark	Getränke	Morgan Stanley	EUR	1 270 000	20. Dez. 2027	3 191
Verkauf	Finnland	Forstprodukte und Papier	Morgan Stanley	EUR	4 090 000	20. Dez. 2027	62 145
Verkauf	Frankreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1 210 000	20. Dez. 2027	11 478
Verkauf	Frankreich	Bekleidung	Morgan Stanley	EUR	3 715 000	20. Dez. 2027	19 832
Verkauf	Frankreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	710 000	20. Jun. 2027	18 854
Verkauf	Frankreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	700 000	20. Dez. 2027	25 444
Kauf	Frankreich	Banken	Barclays Bank	EUR	2 173 750	20. Dez. 2026	75 932
Verkauf	Frankreich	Banken	Morgan Stanley	EUR	114 500	20. Dez. 2026	2 164
Verkauf	Frankreich	Baustoffe	Morgan Stanley	EUR	3 040 000	20. Jun. 2027	43 445

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

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

Credit Default Swaps (Forts.)

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Verkauf	Frankreich	Elektrik	Morgan Stanley	EUR	2 110 000	20. Jun. 2027	8 384
Verkauf	Frankreich	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	2 160 000	20. Jun. 2027	35 716
Verkauf	Frankreich	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	1 430 000	20. Dez. 2027	12 675
Verkauf	Frankreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	2 375 000	20. Dez. 2027	7 863
Verkauf	Frankreich	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	EUR	1 685 000	20. Dez. 2027	6 907
Verkauf	Frankreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	3 550 000	20. Dez. 2027	21 606
Verkauf	Frankreich	REITS	Morgan Stanley	EUR	27 600 00	20. Dez. 2027	45 225
Verkauf	Frankreich	Telekommunikation	Morgan Stanley	EUR	350 000	20. Jun. 2027	(2 995)
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Barclays Bank	EUR	1 440 000	20. Jun. 2027	(14 350)
Kauf	Deutschland	Automobilhersteller	Barclays Bank	EUR	1 765 000	20. Dez. 2027	18 629
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	4 851 000	20. Jun. 2027	131 017
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1 795 000	20. Dez. 2027	11 160
Verkauf	Deutschland	Banken	Morgan Stanley	EUR	1 420 000	20. Dez. 2027	7 471
Verkauf	Deutschland	Chemie	Morgan Stanley	EUR	1 825 000	20. Jun. 2027	116 449
Verkauf	Deutschland	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	EUR	895 000	20. Dez. 2027	2 230
Verkauf	Deutschland	Medien	Morgan Stanley	EUR	3 210 000	20. Dez. 2027	27 389
Kauf	Italien	Banken	BNP Paribas	EUR	1 385 000	20. Dez. 2027	5 038
Verkauf	Luxemburg	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	EUR	850 000	20. Jun. 2027	87 407
Verkauf	Niederlande	Chemie	Morgan Stanley	EUR	2 715 000	20. Dez. 2027	9 036
Verkauf	Niederlande	Medien	Morgan Stanley	EUR	1 050 000	20. Jun. 2027	(8 025)
Verkauf	Niederlande	Transport	Morgan Stanley	EUR	1 280 000	20. Dez. 2027	3 966
Verkauf	Südkorea	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2 855 000	20. Dez. 2024	58 597
Verkauf	Schweiz	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	1 930 000	20. Jun. 2027	33 699
Verkauf	Schweiz	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	700 000	20. Dez. 2027	4 439
Verkauf	Vereinigte Arabische Emirate	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2 655 000	20. Dez. 2027	7 009
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1 355 000	20. Dez. 2027	13 991
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	410 000	20. Dez. 2025	50 905
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	805 000	20. Jun. 2027	72 571
Kauf	Vereinigtes Königreich	Banken	Goldman Sachs	EUR	3 765 000	20. Dez. 2027	14 615
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Banken	Morgan Stanley	EUR	2 110 000	20. Dez. 2027	24 235
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	5 520 000	20. Dez. 2027	22 749
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	4 095 000	20. Dez. 2027	26 925
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Unterhaltung	Morgan Stanley	EUR	205 000	20. Dez. 2026	(10 568)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Unterhaltung	Morgan Stanley	EUR	460 000	20. Jun. 2027	(12 262)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Unterhaltung	Morgan Stanley	EUR	130 000	20. Dez. 2027	(2 084)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	475 000	20. Dez. 2024	(81 724)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	255 000	20. Dez. 2026	(62 097)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmitteldienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	1 895 000	20. Dez. 2027	7 675
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	590 000	20. Dez. 2026	3 053
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	2 610 000	20. Jun. 2027	93 031
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	2 980 000	20. Dez. 2027	78 327
Verkauf	Vereinigte Staaten	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1 935 000	20. Dez. 2027	42 981
Kauf	Vereinigte Staaten	Banken	Barclays Bank	USD	2 910 000	20. Jun. 2027	8 971
Kauf	Vereinigte Staaten	Banken	J.P. Morgan	USD	940 000	20. Jun. 2027	7 792
Verkauf	Vereinigte Staaten	Banken	Morgan Stanley	USD	2 920 000	20. Jun. 2027	16 304
Kauf	Vereinigte Staaten	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	500 000	20. Dez. 2024	35 867
Verkauf	Vereinigte Staaten	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	910 000	20. Jun. 2025	(35 017)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	3 595 000	20. Dez. 2027	20 380
Kauf	Vereinigte Staaten	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	USD	1 035 000	20. Dez. 2027	10 732

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

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

Credit Default Swaps (Forts.)

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	1 035 000	20. Dez. 2027	(11 417)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Medien	Morgan Stanley	USD	1 155 000	20. Dez. 2024	160 625
Kauf	Vereinigte Staaten	Immobilien	J.P. Morgan	USD	705 000	20. Jun. 2024	17 878
Kauf	Vereinigte Staaten	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	630 000	20. Dez. 2027	(269)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	960 000	20. Dez. 2027	(410)
USD							1 422 646

Cross-Currency 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 einem bestimmten Jahr auf zwei verschiedene Währungen lautende Zinszahlungen auszutauschen.

Zum 30. September 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	12 436 000	USD	1 807 295	15. Mrz. 2025	2,96%	USD SOFR 1 Tag	2 594
HSBC	CNH	773 000	USD	110 492	15. Mrz. 2025	2,96%	USD SOFR 1 Tag	161
Morgan Stanley	USD	26 174 214	AUD	35 860 000	15. Mrz. 2028	USD SOFR 1 Tag	AUD BBR 3 Monate	(6 901)
Morgan Stanley	USD	25 181 581	CAD	31 827 000	15. Mrz. 2028	USD SOFR 1 Tag	CAD BA 3 Monate	8 349
Morgan Stanley	USD	23 684 003	GBP	18 883 000	21. Dez. 2027	USD SOFR 1 Tag	GBP SONIA 1 Tag	105 301
Morgan Stanley	USD	27 410 471	NOK	242 558 000	15. Mrz. 2028	USD SOFR 1 Tag	NOK NIBOR 3 Monate	(66 718)
Morgan Stanley	USD	27 152 378	NZD	39 977 000	15. Mrz. 2028	USD SOFR 1 Tag	NZD BBR 3 Monate	(7 278)
Morgan Stanley	USD	26 799 244	SEK	259 414 000	15. Mrz. 2028	USD SOFR 1 Tag	SEK STIBOR 3 Monate	(41 476)
USD								(5 968)

Inflationsswaps

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

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

Nennbetrag	Währung	Kontrahent	Wertpapierbeschreibung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
4 804 000	EUR	Goldman Sachs	Zahlt Festzinssatz 2,78%, Erhält variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Jul. 2027	10 781
1 832 000	EUR	Goldman Sachs	Zahlt Festzinssatz 3,45%, Erhält variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Mrz. 2027	3 659
1 835 000	EUR	Goldman Sachs	Zahlt Festzinssatz 3,53%, Erhält variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Mrz. 2027	(3 554)
4 088 000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 3,00%, Erhält variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Jul. 2027	(34 944)
3 235 000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 3,28%, Erhält variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Mrz. 2027	33 835
USD					9 777

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 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 30. September 2022 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Zinssätze engagiert:

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Zahlt Festzinssatz 12,44%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	47 523 796	BRL	2. Jan. 2024	10 427
Zahlt Festzinssatz 10,62%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	32 476 204	BRL	2. Jan. 2024	105 531
Erhält Festzinssatz 4,34%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	5 000 000	USD	21. Dez. 2024	18 849
Erhält Festzinssatz 3,37%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	1 000 000	USD	21. Dez. 2042	9 118
Erhält Festzinssatz 3,20%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	1 000 000	USD	21. Dez. 2047	9 767
Erhält Festzinssatz 2,02%					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	2 000 000	CHF	21. Dez. 2027	27 695
Erhält Festzinssatz 3,96%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	3 000 000	USD	21. Dez. 2026	14 743
Erhält Festzinssatz 3,71%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	2 000 000	USD	21. Dez. 2029	12 143
Zahlt Festzinssatz 0,78%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	900 000 000	JPY	21. Dez. 2042	184 659
Zahlt Festzinssatz 0,78%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	800 000 000	JPY	21. Dez. 2042	164 142
Zahlt Festzinssatz 0,95%					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	4 000 000	CHF	21. Dez. 2027	159 613
Zahlt Festzinssatz 0,95%					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	8 000 000	CHF	21. Dez. 2027	319 227
Zahlt Festzinssatz 1,24%					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	4 000 000	CHF	21. Dez. 2032	322 620
Zahlt Festzinssatz 1,24%					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	2 000 000	CHF	21. Dez. 2032	161 310
Zahlt Festzinssatz 2,34%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	12 263 788	USD	21. Dez. 2029	975 736
Zahlt Festzinssatz 2,35%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	20 364 366	USD	21. Dez. 2026	1 134 920
Zahlt Festzinssatz 2,46%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	33 718 921	USD	21. Dez. 2024	1 116 587
Zahlt Festzinssatz 2,50%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	1 500 000	USD	21. Dez. 2047	165 805
Zahlt Festzinssatz 2,50%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	4 000 000	USD	21. Dez. 2047	442 146
Zahlt Festzinssatz 2,68%					

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Zahlt Festzinssatz 11,72%	J.P. Morgan	7 000 000	USD	21. Dez. 2042	645 207
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day Erhält Festzinssatz 3,35%	J.P. Morgan	2 220 718	BRL	2. Jan. 2025	(2 800)
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 3,65%	J.P. Morgan	1 000 000	USD	21. Dez. 2042	5 734
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 3,74%	J.P. Morgan	2 000 000	USD	21. Dez. 2029	4 780
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 3,87%	J.P. Morgan	263 788	USD	21. Dez. 2029	2 008
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 4,02%	J.P. Morgan	3 000 000	USD	21. Dez. 2026	4 453
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 4,44%	J.P. Morgan	2 364 366	USD	21. Dez. 2026	16 821
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 10,80%	J.P. Morgan	3 718 921	USD	21. Dez. 2024	21 238
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day Zahlt Festzinssatz 3,98%	J.P. Morgan	2 220 718	BRL	2. Jan. 2025	(4 127)
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months Zahlt Festzinssatz 4,23%	J.P. Morgan	2 000 000	NZD	21. Dez. 2032	48 446
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months Erhält Festzinssatz 3,64%	J.P. Morgan	2 000 000	NZD	21. Dez. 2032	26 799
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 8,56%	J.P. Morgan	50 000 000	SEK	21. Dez. 2024	15 760
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 1,27%	J.P. Morgan	100 000 000	ZAR	21. Dez. 2024	16 835
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 2,87%	J.P. Morgan	16 193 851	EUR	21. Dez. 2024	515 005
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 3,44%	J.P. Morgan	50 000 000	SEK	21. Dez. 2032	121 051
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 2,55%	J.P. Morgan	6 193 851	EUR	21. Dez. 2024	56 367
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 2,55%	J.P. Morgan	100 000 000	SEK	21. Dez. 2024	156 660
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 7,36%	J.P. Morgan	50 000 000	SEK	21. Dez. 2024	78 330
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,39%	J.P. Morgan	400 000 000	ZAR	21. Dez. 2024	411 685
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,39%	J.P. Morgan	50 000 000	ZAR	21. Dez. 2027	63 432
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 2,64%	J.P. Morgan	100 000 000	ZAR	21. Dez. 2027	126 865
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 9,49%	J.P. Morgan	80 000 000	SEK	21. Dez. 2027	233 645
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,08%	J.P. Morgan	394 235 953	MXN	18. Dez. 2024	189 015
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 7,97%	J.P. Morgan	21 220 930	MXN	8. Dez. 2032	(73 389)

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	85 425 776	MXN	15. Dez. 2027	(210 466)
Erhält Festzinssatz 8,52%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	194 235 953	MXN	18. Dez. 2024	(258 337)
Zahlt Festzinssatz 8,94%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	185 425 776	MXN	15. Dez. 2027	112 988
Erhält Festzinssatz 3,20%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	5 000 000	EUR	21. Dez. 2024	22 677
Erhält Festzinssatz 8,38%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	100 000 000	ZAR	21. Dez. 2024	(686)
Erhält Festzinssatz 8,96%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	50 000 000	ZAR	21. Dez. 2027	(513)
				USD	7 700 521
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Zahlt Festzinssatz 6,79%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	BNP Paribas	2 591 114 000	COP	20. Dez. 2026	39 045
Erhält Festzinssatz 1,38%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10 789 000	USD	20. Mrz. 2027	(249 446)
Erhält Festzinssatz 1,35%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10 320 000	USD	20. Mrz. 2026	(438 411)
Zahlt Festzinssatz 1,45%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2 185 000	USD	20. Mrz. 2034	336 387
Erhält Festzinssatz 1,36%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10 370 000	USD	20. Mrz. 2026	(440 251)
Zahlt Festzinssatz 1,46%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2 190 000	USD	20. Mrz. 2034	335 838
Erhält Festzinssatz 1,40%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10 300 000	USD	20. Mrz. 2026	(429 009)
Zahlt Festzinssatz 1,48%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2 180 000	USD	20. Mrz. 2034	331 648
Zahlt Festzinssatz 1,47%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2 177 000	USD	20. Mrz. 2034	331 746
Erhält Festzinssatz 1,38%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10 299 000	USD	20. Mrz. 2026	(432 159)
Zahlt Festzinssatz 1,49%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	440 000	USD	20. Mrz. 2034	66 485
Erhält Festzinssatz 1,38%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6 240 000	USD	20. Mrz. 2026	(262 465)
Erhält Festzinssatz 1,38%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2 080 000	USD	20. Mrz. 2026	(87 412)
Zahlt Festzinssatz 1,48%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1 320 000	USD	20. Mrz. 2034	2001 96
Erhält Festzinssatz 1,35%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10 400 000	USD	20. Mrz. 2026	(442 569)
Zahlt Festzinssatz 1,47%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2 200 000	USD	20. Mrz. 2034	335 428
Zahlt Festzinssatz 1,45%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2 200 000	USD	20. Mrz. 2034	339 974
Erhält Festzinssatz 1,28%					

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 1,26%	Morgan Stanley	10 400 000	USD	20. Mrz. 2026	(455 329)
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Zahlt Festzinssatz 1,41%	Morgan Stanley	12 476 000	USD	20. Mrz. 2026	(552 198)
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 5,62%	Morgan Stanley	2 642 000	USD	20. Mrz. 2034	416 713
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 1,73%	Morgan Stanley	265 567 000	CLP	17. Mrz. 2032	(276)
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 1,64%	Morgan Stanley	2 110 000	USD	20. Mrz. 2034	277 838
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Zahlt Festzinssatz 1,77%	Morgan Stanley	9 835 000	USD	20. Mrz. 2026	(367 011)
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 1,68%	Morgan Stanley	485 000	USD	20. Mrz. 2034	62 470
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Zahlt Festzinssatz 6,16%	Morgan Stanley	2 100 000	USD	20. Mrz. 2026	(76 533)
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day Zahlt Festzinssatz 6,25%	Morgan Stanley	186 645 000	INR	19. Jun. 2027	37 820
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day Zahlt Festzinssatz 1,63%	Bank of America	57 301 200	INR	19. Jun. 2027	9 531
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 0,59%	Morgan Stanley	1 745 000	USD	6. Feb. 2028	117 190
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day Zahlt Festzinssatz 1,65%	Morgan Stanley	1 581 000	GBP	16. Jun. 2032	(91 259)
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 1,48%	Morgan Stanley	2 550 000	USD	4. Mrz. 2034	354 495
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Zahlt Festzinssatz 1,66%	Morgan Stanley	11 960 000	USD	4. Mrz. 2026	(485 537)
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 1,50%	Morgan Stanley	2 860 000	USD	4. Mrz. 2034	395 399
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 1,51%	Morgan Stanley	13 395 000	USD	4. Mrz. 2026	(537 416)
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Zahlt Festzinssatz 1,66%	Morgan Stanley	6 697 740	USD	4. Mrz. 2026	(268 263)
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 1,52%	Morgan Stanley	1 428 070	USD	4. Mrz. 2034	196 568
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Zahlt Festzinssatz 1,66%	Morgan Stanley	15 787 200	USD	4. Mrz. 2026	(628 912)
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Zahlt Festzinssatz 7,58%	Morgan Stanley	3 365 000	USD	4. Mrz. 2034	463 046
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day Zahlt Festzinssatz 7,52%	Goldman Sachs	378 716 000	INR	18. Sep. 2027	(83 742)
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day Zahlt Festzinssatz 2,74%	Bank of America	253 612 000	INR	18. Sep. 2027	(51 458)
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Zahlt Festzinssatz 2,74%	Morgan Stanley	3 315 000	USD	18. Mai 2033	196 902
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 2,78%	Morgan Stanley	3 315 000	USD	18. Mai 2033	197 477

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	14 885 000	USD	18. Mai 2025	(353 870)
Erhält Festzinssatz 2,77%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	14 885 000	USD	18. Mai 2025	(354 577)
Erhält Festzinssatz 5,80%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 411 000	PLN	15. Sept. 2032	(6 707)
Erhält Festzinssatz 2,69%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	62 645 000	USD	20. Mrz. 2026	(1 119 491)
Zahlt Festzinssatz 2,75%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	9 076 000	USD	20. Mrz. 2034	445 360
Zahlt Festzinssatz 2,75%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	7 425 000	USD	20. Mrz. 2034	367 970
Zahlt Festzinssatz 2,60%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6 632 000	USD	18. Mai 2033	472 203
Erhält Festzinssatz 2,75%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	29 764 000	USD	18. Mai 2025	(722 131)
Erhält Festzinssatz 8,73%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	38 250 000	MXN	25. Apr. 2042	(93 700)
Erhält Festzinssatz 2,73%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	9 660 000	SGD	18. Sep. 2027	(112 614)
Zahlt Festzinssatz 3,04%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	28 958 000	ILS	21. Dez. 2024	119 558
Erhält Festzinssatz 8,96%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	9 402 752 000	COP	15. Dez. 2032	(22 636)
Erhält Festzinssatz 7,47%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	117 339 000	INR	21. Dez. 2027	38 991
Erhält Festzinssatz 2,81%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	5 912 000	USD	15. Dez. 2032	(77 322)
Zahlt Festzinssatz 3,08%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2 465 000	SGD	21. Dez. 2027	29 140
Zahlt Festzinssatz 3,11%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2 467 000	SGD	21. Dez. 2027	26 603
Erhält Festzinssatz 2,53%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	9 014 000	GBP	21. Dez. 2027	(1 027 724)
Erhält Festzinssatz 2,78%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	2 549 000	GBP	20. Dez. 2024	(58 123)
Erhält Festzinssatz 3,72%					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	9 646 000	CAD	21. Dez. 2032	125 038
Zahlt Festzinssatz 0,63%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	78 928 000	JPY	15. Dez. 2032	(3 300)
Zahlt Festzinssatz 0,53%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	159 370 000	JPY	17. Jun. 2032	(4 282)
Zahlt Festzinssatz 0,28%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	633 915 000	JPY	17. Jun. 2027	(10 684)
Erhält Festzinssatz 2,81%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	39 599 000	GBP	21. Dez. 2024	(178 439)
Erhält Festzinssatz 12,55%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	5 628 755	BRL	1. Feb. 2025	21 732
Erhält Festzinssatz 2,95%					

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	8 755 000	ILS	21. Dez. 2027	(75 738)
Zahlt Festzinssatz 2,85%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	3 053 000	SGD	21. Dez. 2027	58 804
Zahlt Festzinssatz 2,80%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	8 346 000	SGD	20. Dez. 2024	46 278
Erhält Festzinssatz 9,00%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29 400 000	MXN	17. Jun. 2032	(17 729)
Erhält Festzinssatz 3,40%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	393 8821 000	KRW	21. Dez. 2027	(88 396)
Erhält Festzinssatz 2,50%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Standard Chartered Bank	4 339 000	CNY	21. Dez. 2024	2 920
Zahlt Festzinssatz 3,13%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	3 527 632 000	KRW	21. Dez. 2032	139 468
Erhält Festzinssatz 3,25%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	8 551 473 000	KRW	21. Dez. 2027	(231 832)
Zahlt Festzinssatz 9,05%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	50 730 000	MXN	13. Jul. 2027	24 126
Erhält Festzinssatz 8,48%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	62 737 000	MXN	18. Dez. 2024	(85 554)
Zahlt Festzinssatz 8,22%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	34 117 500	MXN	28. Jul. 2027	70 305
Erhält Festzinssatz 6,36%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	24 152 000	PLN	21. Dez. 2024	(102 143)
Erhält Festzinssatz 8,77%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	80 430 000	MXN	18. Dez. 2024	(89 037)
Zahlt Festzinssatz 8,13%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	34 117 500	MXN	30. Jul. 2027	76 259
Erhält Festzinssatz 12,06%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	7 111 934	BRL	2. Jan. 2025	10 302
Erhält Festzinssatz 11,97%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	5 281 640	BRL	4. Jan. 2027	14 992
Erhält Festzinssatz 11,97%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	BNP Paribas	4 758 179	BRL	2. Jan. 2025	5 207
Erhält Festzinssatz 11,92%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	12 706 584	BRL	2. Jan. 2025	11 058
Erhält Festzinssatz 11,88%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	12 715 349	BRL	2. Jan. 2025	9 165
Erhält Festzinssatz 8,48%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	103 955 000	MXN	8. Aug. 2025	(155 799)
Erhält Festzinssatz 11,78%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Barclays Bank	6 524 367	BRL	2. Jan. 2029	2 965
Erhält Festzinssatz 2,16%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	2 830 000	ILS	21. Dez. 2027	(52 396)
Erhält Festzinssatz 6,16%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7 011 000	PLN	21. Dez. 2027	(46 406)
Erhält Festzinssatz 12,03%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Goldman Sachs	12 459 473	BRL	2. Jan. 2025	18 239
Zahlt Festzinssatz 3,71%					

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months Erhält Festzinssatz 3,06%	Morgan Stanley	6 528 383 000	KRW	21. Dez. 2024	58 189
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,64%	Morgan Stanley	10 870 000	ILS	21. Dez. 2027	(78 427)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 10,28%	Morgan Stanley	38 158 000	MXN	15. Dez. 2027	45 298
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 10,35%	Morgan Stanley	9 851 431 000	COP	21. Dez. 2024	23 814
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 10,63%	Morgan Stanley	2 216 652 000	COP	21. Dez. 2024	4 741
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 3,17%	Morgan Stanley	6 843 801 000	COP	21. Dez. 2024	7 537
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 9,77%	Morgan Stanley	5 572 000	SGD	21. Dez. 2024	51 281
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 2,38%	Morgan Stanley	4 406 237 000	COP	21. Dez. 2027	16 022
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 3,02%	Morgan Stanley	4 400 000	EUR	21. Dez. 2027	121 964
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months Erhält Festzinssatz 2,97%	Morgan Stanley	837 000	SGD	15. Mrz. 2028	18 819
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 3,17%	Morgan Stanley	10 919 000	SGD	15. Mrz. 2033	(407 313)
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 5,78%	Morgan Stanley	26 454 000	SGD	21. Sept. 2025	308927
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 7,66%	Morgan Stanley	50 952 000	PLN	20. Mrz. 2025	91333
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 3,16%	Morgan Stanley	990 523 000	HUF	15. Dez. 2032	(35 105)
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day Zahlt Festzinssatz 3,16%	Morgan Stanley	10 477 000	GBP	15. Mrz. 2033	1 087 616
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Zahlt Festzinssatz 3,81%	Morgan Stanley	5 173 000	USD	20. Mrz. 2025	33 259
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Zahlt Festzinssatz 3,16%	Morgan Stanley	15 102 000	USD	15. Mrz. 2024	81 587
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 3,22%	Morgan Stanley	40 650 000	USD	15. Mrz. 2028	1 097 389
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months Erhält Festzinssatz 6,48%	Morgan Stanley	1 409 000	CAD	19. Mrz. 2028	63 000
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 11,23%	Morgan Stanley	1 177 170 000	CLP	21. Dez. 2032	(24 031)
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day Erhält Festzinssatz 13,24%	Bank of America	8 759 217	BRL	4. Jan. 2027	(21 946)
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 3,09%	Morgan Stanley	309 595 000	HUF	21. Dez. 2024	6 165
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 3,47%	Morgan Stanley	7 498 000	USD	15. Mrz. 2033	(172 161)
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day Erhält Festzinssatz 4,19%	Morgan Stanley	3 4292 000	USD	15. Mrz. 2025	(250 098)

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months Erhält Festzinssatz 3,47%	Morgan Stanley	24 025 000	AUD	15. Mrz. 2033	(241 191)
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 7,36%	Morgan Stanley	43 242 000	NOK	15. Mrz. 2033	(10 453)
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 2,54%	Morgan Stanley	293 636 000	HUF	15. Dez. 2032	(15 570)
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Erhält Festzinssatz 3,79%	Morgan Stanley	11 410 000	CNY	15. Mrz. 2028	9 877
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 3,71%	Morgan Stanley	1 082 000	CLP	18. Mrz. 2031	(64)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 7,26%	Citi Bank	6 005 000	CLP	18. Mrz. 2031	(374)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 7,35%	Morgan Stanley	11 240 000	MXN	16. Mai 2041	(96 637)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 2,16%	Morgan Stanley	11 400 000	MXN	5. Jul. 2041	(94 191)
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months Erhält Festzinssatz 2,74%	Morgan Stanley	1 303 000	CAD	17. Mrz. 2032	(30 501)
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Zahlt Festzinssatz 4,54%	HSBC	12 007 000	CNY	20. Mrz. 2027	834
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 4,35%	Morgan Stanley	2 849 984 000	HUF	15. Mrz. 2024	478 737
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 4,48%	Morgan Stanley	1 018 668 000	HUF	15. Mrz. 2024	174 952
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 1,96%	Morgan Stanley	1 471 536 000	HUF	15. Mrz. 2024	248 892
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months Erhält Festzinssatz 5,60%	Morgan Stanley	4 238 234 000	KRW	21. Jun. 2024	69 168
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 5,59%	Morgan Stanley	550 861 000	CLP	16. Jun. 2032	(1 629)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 1,36%	Morgan Stanley	550 866 000	CLP	17. Mrz. 2032	(985)
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 2,89%	Citi Bank	13 095 000	ILS	19. Jun. 2027	208 637
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 4,28%	Morgan Stanley	32 702 000	CZK	16. Jun. 2032	(80 758)
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 3,03%	Morgan Stanley	28 786 000	PLN	21. Jun. 2024	168 038
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 3,60%	Morgan Stanley	28 555 000	CZK	16. Jun. 2032	(64 471)
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 2,97%	J.P. Morgan	2 898 000	MYR	19. Jun. 2027	10 064
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months Zahlt Festzinssatz 9,05%	Morgan Stanley	24 474 000	NZD	16. Mrz. 2032	(855 586)
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 4,16%	Morgan Stanley	16 655 000	ZAR	17. Jun. 2032	44 883
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 2,16%	Morgan Stanley	5 720 000	PLN	18. Sep. 2027	61 602

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 5,31%	Morgan Stanley	9 385 000	ILS	15. Sept. 2032	(143 379)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 2,75%	Morgan Stanley	1 206 227 000	CLP	15. Sept. 2032	(15 825)
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months Zahlt Festzinssatz 5,30%	Morgan Stanley	8 221 000	AUD	18. Sep. 2027	76 474
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,33%	Morgan Stanley	38 924 000	PLN	21. Jun. 2024	158 320
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,32%	Morgan Stanley	10 028 000	MXN	9. Jun. 2032	8 698
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,33%	Morgan Stanley	18 257 000	MXN	9. Jun. 2032	16 137
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,32%	Morgan Stanley	27 621 000	MXN	9. Jun. 2032	23 888
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,32%	Morgan Stanley	27 469 000	MXN	9. Jun. 2032	24 153
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,28%	Morgan Stanley	18 353 000	MXN	9. Jun. 2032	16 181
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,23%	Morgan Stanley	27 374 000	MXN	9. Jun. 2032	25 308
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,29%	Morgan Stanley	36 569 000	MXN	9. Jun. 2032	36 131
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,28%	Morgan Stanley	27 417 000	MXN	9. Jun. 2032	25 262
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,28%	Morgan Stanley	18 270 000	MXN	9. Jun. 2032	16 886
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,25%	Morgan Stanley	27 475 000	MXN	9. Jun. 2032	25 657
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,20%	Morgan Stanley	18 286 000	MXN	9. Jun. 2032	17 644
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,32%	Morgan Stanley	18 286 000	MXN	9. Jun. 2032	18 853
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,32%	Morgan Stanley	19 666 000	MXN	8. Sept. 2032	17 381
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,45%	Morgan Stanley	19 708 000	MXN	8. Sept. 2032	17 418
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,47%	Morgan Stanley	29 921 000	MXN	8. Sept. 2032	21 841
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,11%	Morgan Stanley	29 778 000	MXN	8. Sept. 2032	20 907
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,79%	Morgan Stanley	60 639 000	MXN	8. Sept. 2032	68 728
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 6,01%	Morgan Stanley	195 604 000	MXN	18. Sept. 2024	76 032
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 5,99%	Morgan Stanley	871 469 000	CLP	15. Sept. 2032	7 331
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 6,02%	Morgan Stanley	1 248 262 000	CLP	16. Jun. 2032	11 727

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	885 334 000	CLP	16. Jun. 2032	9 222
Zahlt Festzinssatz 9,53%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	46 838 000	ZAR	15. Sept. 2032	96 130
Zahlt Festzinssatz 9,63%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32 804 000	ZAR	15. Sept. 2032	62 636
Zahlt Festzinssatz 9,61%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	3 555 000	ZAR	15. Sept. 2032	6 874
Erhält Festzinssatz 3,62%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	43 933 000	CZK	15. Sept. 2032	(59 387)
Zahlt Festzinssatz 9,76%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	17 495 000	ZAR	15. Sept. 2032	30 308
Zahlt Festzinssatz 8,65%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	104 871 000	MXN	9. Jun. 2032	49 645
Zahlt Festzinssatz 8,52%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	35 149 500	MXN	8. Sept. 2032	22 489
Zahlt Festzinssatz 8,52%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	46 924 500	MXN	8. Sept. 2032	30 386
Zahlt Festzinssatz 9,97%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	41 861 000	ZAR	15. Sept. 2032	60 316
Zahlt Festzinssatz 8,58%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	45 850 500	MXN	8. Sept. 2032	26 330
Zahlt Festzinssatz 8,82%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29 081 000	MXN	8. Sept. 2032	7 969
Erhält Festzinssatz 3,05%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	9 821 000	ILS	15. Sept. 2032	(57 718)
Erhält Festzinssatz 9,03%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	9 351 169 000	COP	15. Sept. 2032	(18 044)
Erhält Festzinssatz 2,61%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Citi Bank	15 750 000	CNY	18. Sep. 2027	(13 131)
Erhält Festzinssatz 5,80%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 173 000	PLN	15. Sept. 2032	(10 304)
Erhält Festzinssatz 5,51%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4 600 000	PLN	15. Sept. 2032	(29 186)
Erhält Festzinssatz 2,50%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Citi Bank	26 082 000	CNY	18. Sep. 2027	(33 238)
Erhält Festzinssatz 2,52%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Citi Bank	36 629 000	CNY	18. Sep. 2027	(43 281)
Zahlt Festzinssatz 2,13%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9 313 000	EUR	21. Dez. 2032	189 684
Erhält Festzinssatz 2,00%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 497 000	EUR	18. Dez. 2027	(25 131)
Zahlt Festzinssatz 3,59%					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	39 837 000	CAD	21. Dez. 2027	(364 428)
Zahlt Festzinssatz 3,72%					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	49 798 000	CAD	21. Dez. 2024	43 885
Erhält Festzinssatz 9,22%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	21 865 000	MXN	4. Jun. 2025	(13 401)
Erhält Festzinssatz 9,19%					

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	141 985 000	MXN	4. Jun. 2025	(92 021)
Zahlt Festzinssatz 6,43%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	6 223 573 000	CLP	20. Dez. 2024	98 893
Erhält Festzinssatz 5,78%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 159 043 000	CLP	15. Dez. 2032	242
Erhält Festzinssatz 5,84%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 338 964 000	CLP	15. Dez. 2032	4 190
Erhält Festzinssatz 1,94%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12 624 000	EUR	21. Dez. 2027	(88 439)
Erhält Festzinssatz 2,38%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12 203 000	EUR	15. Dez. 2032	(312 569)
Zahlt Festzinssatz 5,40%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	53 539 000	CZK	21. Dez. 2027	(485)
Erhält Festzinssatz 5,15%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11 469 000	CZK	21. Dez. 2032	5578
Zahlt Festzinssatz 9,03%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	16 725 734 000	COP	21. Dez. 2027	162 685
Zahlt Festzinssatz 3,93%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	41 452 000	MYR	21. Dez. 2024	(11 392)
Erhält Festzinssatz 4,14%					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	25 927 000	MYR	21. Dez. 2027	10 398
Zahlt Festzinssatz 6,76%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	31 529 000	PLN	21. Dez. 2032	44 753
Erhält Festzinssatz 9,76%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	157 644 000	MXN	20. Dez. 2023	(65 952)
Erhält Festzinssatz 9,52%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	242 814 000	MXN	18. Dez. 2024	(108 864)
Erhält Festzinssatz 3,14%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	2 673 000	ILS	21. Dez. 2032	(30 128)
Erhält Festzinssatz 3,16%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3 470 000	ILS	21. Dez. 2032	(37 241)
Zahlt Festzinssatz 3,84%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	21 459 000	AUD	21. Dez. 2024	38 980
Zahlt Festzinssatz 4,22%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	23 576 000	AUD	15. Dez. 2032	29 662
Zahlt Festzinssatz 2,91%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	160 101 000	SEK	18. Dez. 2027	398 920
Erhält Festzinssatz 2,84%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	314 154 000	SEK	21. Dez. 2027	(339 736)
Zahlt Festzinssatz 2,88%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	76 079 000	SEK	15. Dez. 2032	(4 333)
Zahlt Festzinssatz 3,22%					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	132 207 000	NOK	18. Dez. 2027	52 957
Erhält Festzinssatz 3,22%					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	20 575 000	NOK	15. Dez. 2032	(20 027)
Erhält Festzinssatz 3,03%					

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 7,69%	Morgan Stanley	14 723 000	ILS	21. Dez. 2027	(112 476)
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 9,66%	Morgan Stanley	1 024 275 000	HUF	21. Dez. 2032	(277 272)
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 9,30%	Morgan Stanley	2 527 416 000	HUF	21. Dez. 2023	213 061
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 9,27%	Morgan Stanley	1 512 110 000	HUF	21. Dez. 2024	194 652
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 8,11%	Morgan Stanley	2 867 726 000	HUF	21. Dez. 2024	372 405
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 7,14%	Morgan Stanley	2 335 126 000	HUF	21. Dez. 2027	469 476
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 9,10%	Morgan Stanley	146 974 000	ZAR	21. Dez. 2023	62 533
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 7,48%	Morgan Stanley	502 78 000	ZAR	21. Dez. 2032	(119 071)
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 4,50%	Morgan Stanley	6 638 000	PLN	21. Dez. 2027	24 931
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months Erhält Festzinssatz 7,61%	Morgan Stanley	7 225 000	AUD	20. Dez. 2024	(9 514)
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 0,30%	Morgan Stanley	4 333 000	PLN	21. Dez. 2027	20 749
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day Zahlt Festzinssatz 0,55%	Morgan Stanley	633 920 000	JPY	17. Jun. 2027	(15 094)
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day Zahlt Festzinssatz 10,42%	Morgan Stanley	159 370 000	JPY	17. Jun. 2032	(6 383)
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 9,64%	Morgan Stanley	1 199 216 000	HUF	21. Dez. 2023	83 105
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 10,27%	Morgan Stanley	155 190 000	MXN	17. Sept. 2025	2 069
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 6,69%	Morgan Stanley	42 554 000	ZAR	15. Sept. 2032	43 267
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 6,67%	Morgan Stanley	14 187 000	PLN	15. Sept. 2032	3 793
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 8,92%	Morgan Stanley	12 100 000	PLN	15. Sept. 2032	1 614
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 3,84%	Morgan Stanley	64 660 000	MXN	21. Jun. 2027	46 571
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months Erhält Festzinssatz 9,35%	Morgan Stanley	15 638 000	CAD	21. Dez. 2023	(74 436)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 9,10%	Morgan Stanley	111 050 000	MXN	25. Jun. 2025	(49 946)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 6,15%	Morgan Stanley	96 450 000	MXN	24. Jun. 2027	36 427
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 3,76%	Morgan Stanley	17 792 000	PLN	15. Dez. 2032	(50 584)
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 9,38%	Standard Chartered Bank	13 166 000	MYR	21. Dez. 2027	(44 095)

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 9,37%	Morgan Stanley	27 774 000	ZAR	21. Dez. 2032	(38 144)
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,62%	Morgan Stanley	62 629 000	ZAR	21. Dez. 2032	(88 907)
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,63%	Morgan Stanley	103 042 000	ZAR	21. Dez. 2027	78 403
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 9,29%	Morgan Stanley	45 219 000	ZAR	21. Dez. 2027	33 809
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 9,19%	Morgan Stanley	8 380 053 000	COP	21. Dez. 2027	63 875
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Erhält Festzinssatz 3,31%	Morgan Stanley	2 868 341 000	COP	21. Dez. 2027	24 159
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months Zahlt Festzinssatz 3,09%	Morgan Stanley	6 865 157 000	KRW	21. Dez. 2027	(172 656)
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months Erhält Festzinssatz 3,62%	Morgan Stanley	1 822 064 000	KRW	21. Dez. 2032	77 132
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 6,21%	J.P. Morgan	7 790 000	MYR	21. Dez. 2027	(36 573)
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 2,33%	Morgan Stanley	2 431 000	PLN	21. Dez. 2032	21 229
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Zahlt Festzinssatz 8,76%	Morgan Stanley	62 663 000	CNY	21. Dez. 2024	10 491
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 2,34%	Morgan Stanley	155 183 000	MXN	8. Dez. 2032	58 423
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Erhält Festzinssatz 6,30%	Morgan Stanley	10 074 000	CNY	21. Dez. 2024	2 216
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 7,59%	Morgan Stanley	7 689 000	PLN	21. Dez. 2027	(42 439)
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 9,02%	Morgan Stanley	9 247 000	PLN	21. Dez. 2023	(4 457)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,92%	Morgan Stanley	50 730 000	MXN	14. Jul. 2027	26 992
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,94%	Morgan Stanley	15 500 000	MXN	7. Jul. 2032	(13 378)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 7,27%	Morgan Stanley	15 505 000	MXN	6. Jul. 2032	(12 659)
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 2,65%	Morgan Stanley	67 514 000	PLN	21. Dez. 2023	(71 499)
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Zahlt Festzinssatz 8,55%	Morgan Stanley	30 506 000	CNY	18. Dez. 2027	(26 751)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 9,19%	Morgan Stanley	95 045 000	MXN	21. Jul. 2027	136 592
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,45%	Morgan Stanley	106 925 000	MXN	24. Jul. 2024	(91 642)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 9,19%	Morgan Stanley	28 805 000	MXN	14. Jul. 2032	(67 386)
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 8,94%	Morgan Stanley	60 491 000	ZAR	21. Dez. 2032	(124 989)

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 9,13%	Morgan Stanley	30 245 000	ZAR	21. Dez. 2032	(88 822)
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,16%	Morgan Stanley	60 106 000	ZAR	21. Dez. 2032	(135 939)
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,17%	Morgan Stanley	48 934 000	ZAR	21. Dez. 2027	86 826
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 7,85%	Morgan Stanley	48 934 000	ZAR	21. Dez. 2027	85 748
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 7,87%	Morgan Stanley	234 144 000	ZAR	21. Dez. 2024	126 746
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 8,95%	Morgan Stanley	234 145 000	ZAR	21. Dez. 2024	122 066
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 6,77%	Morgan Stanley	30 245 000	ZAR	21. Dez. 2032	(87 747)
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 9,29%	Morgan Stanley	16 561 000	PLN	21. Dez. 2024	(46 394)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,29%	Morgan Stanley	228 408 000	MXN	20. Dez. 2023	(152 161)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 6,38%	Morgan Stanley	128 252 000	MXN	8. Dez. 2032	356 545
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day Erhält Festzinssatz 8,52%	Morgan Stanley	110 651 000	INR	21. Dez. 2027	(31 976)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,53%	Morgan Stanley	13 167 000	MXN	18. Dez. 2024	(17 547)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,51%	Morgan Stanley	73 766 000	MXN	18. Dez. 2024	(97 655)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,52%	Morgan Stanley	69 435 000	MXN	18. Dez. 2024	(92 839)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,49%	Morgan Stanley	69 434 000	MXN	18. Dez. 2024	(92 532)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,64%	Morgan Stanley	55 531 000	MXN	28. Dez. 2024	(75 493)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 2,16%	Morgan Stanley	78 199 000	MXN	18. Dez. 2024	(95 607)
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Erhält Festzinssatz 6,66%	Morgan Stanley	51 815 000	CNY	21. Dez. 2024	(13 575)
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 8,73%	Morgan Stanley	15 317 000	PLN	21. Dez. 2024	(49 184)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,78%	Morgan Stanley	602 55 000	MXN	18. Dez. 2024	(69 020)
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 2,93%	Morgan Stanley	60 255 000	MXN	18. Dez. 2024	(66 363)
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months Erhält Festzinssatz 3,03%	Morgan Stanley	1 382 492 000	KRW	21. Dez. 2032	70 980
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months Erhält Festzinssatz 9,00%	Morgan Stanley	6 292 551 000	KRW	21. Dez. 2027	(214 650)
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 8,93%	Morgan Stanley	10 205 000	ZAR	21. Dez. 2032	(27 703)

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 5,78%	Morgan Stanley	10 205 000	ZAR	21. Dez. 2032	(30 513)
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 9,22%	Morgan Stanley	43 883 000	CZK	21. Dez. 2024	(19 634)
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 7,98%	Morgan Stanley	284 179 000	HUF	21. Dez. 2032	15 313
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 8,18%	Morgan Stanley	169 995 000	HUF	21. Dez. 2032	39 054
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 8,81%	Morgan Stanley	21 103 000	ZAR	18. Dez. 2027	(32 019)
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Erhält Festzinssatz 8,87%	Morgan Stanley	3 729 155 000	COP	21. Dez. 2032	(55 017)
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Erhält Festzinssatz 6,27%	Morgan Stanley	3 388 388 000	COP	21. Dez. 2032	(47 317)
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day Zahlt Festzinssatz 8,22%	Morgan Stanley	249 795 000	INR	21. Dez. 2027	(86 190)
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 8,16%	Morgan Stanley	66 910 000	MXN	6. Aug. 2027	139 775
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 8,53%	Morgan Stanley	66 910 000	MXN	6. Aug. 2027	147 529
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Erhält Festzinssatz 2,16%	Morgan Stanley	103 955 000	MXN	8. Aug. 2025	(149 344)
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 6,26%	Morgan Stanley	1 963 000	ILS	21. Dez. 2027	(36 344)
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day Erhält Festzinssatz 5,83%	Morgan Stanley	38 328 000	INR	21. Dez. 2024	5 733
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 5,83%	Morgan Stanley	5 113 000	PLN	21. Dez. 2027	(47 095)
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 10,42%	Morgan Stanley	4 562 000	PLN	21. Dez. 2027	(42 020)
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,64%	Morgan Stanley	12 224 000	ZAR	15. Dez. 2032	10 781
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 3,18%	Morgan Stanley	8 094 000	MXN	15. Dez. 2027	9 588
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 3,18%	Morgan Stanley	52 779 000	ILS	20. Dez. 2024	68 973
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 3,07%	Morgan Stanley	22 315 000	ILS	20. Dez. 2024	29 162
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,15%	Morgan Stanley	6 520 000	ILS	21. Dez. 2027	(46 431)
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 9,00%	Morgan Stanley	106 910 000	ZAR	21. Dez. 2027	192 051
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 7,76%	Morgan Stanley	19 415 000	ZAR	21. Dez. 2032	(52 878)
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 3,50%	Morgan Stanley	119 340 000	ZAR	21. Dez. 2024	(75 933)
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,76%	Morgan Stanley	12 325 000	CAD	15. Dez. 2032	28 628

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days Zahlt Festzinssatz 9,58%	Morgan Stanley	31 497 000	MXN	15. Dez. 2027	30 003
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 9,68%	Morgan Stanley	1 887 991 000	COP	21. Dez. 2027	9 872
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 9,74%	Morgan Stanley	1 833 693 000	COP	21. Dez. 2027	7 999
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 9,77%	Morgan Stanley	1 836 015 000	COP	21. Dez. 2027	7 062
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 10,62%	Morgan Stanley	1 836 007 000	COP	21. Dez. 2027	6 608
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 10,60%	Morgan Stanley	2 343 767 000	COP	21. Dez. 2024	2 670
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 8,17%	Morgan Stanley	9 562 571 000	COP	21. Dez. 2024	11 297
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 10,59%	Morgan Stanley	95 281 000	ZAR	20. Dez. 2024	27 611
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Zahlt Festzinssatz 3,93%	Morgan Stanley	6 831 305 000	COP	21. Dez. 2024	8 565
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 10,46%	Standard Chartered Bank	11 112 000	MYR	18. Dez. 2027	21 498
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 9,25%	Morgan Stanley	56 211 000	ZAR	15. Dez. 2032	46 154
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 9,24%	Morgan Stanley	9 148 050 000	CLP	21. Dez. 2024	(96 110)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 9,22%	Morgan Stanley	4 993 835 000	CLP	21. Dez. 2024	(52 915)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 7,04%	Morgan Stanley	4 977 240 000	CLP	21. Dez. 2024	(54 533)
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 7,04%	Morgan Stanley	8 975 175 000	CLP	21. Dez. 2027	167 342
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 7,05%	Morgan Stanley	4 124 130 000	CLP	21. Dez. 2027	76 894
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 6,46%	Morgan Stanley	4 440 260 000	CLP	21. Dez. 2027	80 976
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 6,48%	Morgan Stanley	2 448 505 000	CLP	21. Dez. 2032	(52 779)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 6,47%	Morgan Stanley	2 104 505 000	CLP	21. Dez. 2032	(41 761)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Zahlt Festzinssatz 2,36%	Morgan Stanley	1 190 770 000	CLP	21. Dez. 2032	(24 819)
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Zahlt Festzinssatz 2,35%	Morgan Stanley	29 845 000	CNY	21. Dez. 2027	52 128
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Erhält Festzinssatz 10,06%	Morgan Stanley	10 215 000	CNY	21. Dez. 2027	18 523
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Erhält Festzinssatz 10,04%	Morgan Stanley	12 856 145 000	COP	21. Dez. 2027	(15 767)

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	30 552 425 000	COP	21. Dez. 2027	(42 513)
Erhält Festzinssatz 10,05%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	24 417 815 000	COP	21. Dez. 2027	(31 962)
Zahlt Festzinssatz 9,82%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1 290 840 000	COP	21. Dez. 2032	1 627
Zahlt Festzinssatz 9,82%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	17 971 060 000	COP	21. Dez. 2032	20 844
Zahlt Festzinssatz 9,81%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	7 353 745 000	COP	21. Dez. 2032	9 611
Erhält Festzinssatz 11,14%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	733 905 000	HUF	21. Dez. 2027	38 070
Zahlt Festzinssatz 9,44%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	25 375 000	HUF	21. Dez. 2032	586
Erhält Festzinssatz 7,10%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	66 760 000	PLN	21. Dez. 2024	(110 556)
Zahlt Festzinssatz 6,35%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	56 395 000	PLN	21. Dez. 2027	287 798
Erhält Festzinssatz 6,13%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9 730 000	PLN	21. Dez. 2032	(95 188)
Zahlt Festzinssatz 8,44%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	186 805 000	ZAR	21. Dez. 2027	216 219
Zahlt Festzinssatz 13,53%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 737 392 000	HUF	15. Mrz. 2025	(82 116)
Zahlt Festzinssatz 10,70%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 181 413 000	HUF	15. Mrz. 2028	(49 769)
Erhält Festzinssatz 9,34%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4 672 545 000	CLP	21. Dez. 2024	(41 512)
Erhält Festzinssatz 6,49%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 262 700 000	CLP	21. Dez. 2032	(24 516)
Zahlt Festzinssatz 7,11%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4 210 365 000	CLP	21. Dez. 2027	66 470
Zahlt Festzinssatz 8,70%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	73 193 000	MXN	2. Mrz. 2033	98 278
Erhält Festzinssatz 9,69%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	216 664 000	MXN	13. Mrz. 2024	(81 019)
Erhält Festzinssatz 9,19%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	82 879 000	MXN	12. Mrz. 2025	(41 410)
Zahlt Festzinssatz 10,63%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	44 722 000	ZAR	15. Dez. 2032	26621
Erhält Festzinssatz 4,65%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	423 73 000	CZK	15. Mrz. 2033	(34 785)
Zahlt Festzinssatz 4,36%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	50 575 000	CZK	19. Mrz. 2028	15 761
Zahlt Festzinssatz 5,10%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	15 170 000	CZK	15. Mrz. 2028	4 181
Zahlt Festzinssatz 3,65%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	10122000	MYR	15. Mrz. 2025	12046
Zahlt Festzinssatz 3,96%					

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 3,81%	Bank of America	10 050 000	MYR	19. Mrz. 2028	20 358
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 3,28%	Standard Chartered Bank	7 825 000	MYR	15. Mrz. 2028	(26 239)
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 3,53%	Morgan Stanley	6 743 000	ILS	15. Mrz. 2033	(53 775)
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 3,38%	Morgan Stanley	106 993 000	ILS	15. Mrz. 2024	125 192
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 3,20%	Morgan Stanley	55 134 000	ILS	15. Mrz. 2025	121 443
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Erhält Festzinssatz 3,33%	Morgan Stanley	7 428 000	ILS	15. Mrz. 2028	(38 865)
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months Zahlt Festzinssatz 6,31%	Morgan Stanley	17 861 000	ILS	15. Mrz. 2033	(57 173)
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day Erhält Festzinssatz 6,36%	Morgan Stanley	846 211 000	INR	15. Mrz. 2025	114 758
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day Zahlt Festzinssatz 2,40%	Morgan Stanley	219 225 000	INR	15. Mrz. 2028	(64 794)
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days Zahlt Festzinssatz 5,70%	Morgan Stanley	40 779 000	CNY	15. Mrz. 2028	73 041
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 5,79%	Morgan Stanley	9 836 000	PLN	15. Mrz. 2033	147 437
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 9,26%	Morgan Stanley	33 326 000	PLN	15. Mrz. 2028	(300 118)
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 7,99%	Morgan Stanley	188 973 000	ZAR	15. Mrz. 2033	(396 805)
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Zahlt Festzinssatz 8,07%	Morgan Stanley	261 013 000	ZAR	15. Mrz. 2024	46 088
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months Erhält Festzinssatz 9,35%	Morgan Stanley	279 142 000	ZAR	15. Mrz. 2025	132 786
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day Erhält Festzinssatz 3,41%	Morgan Stanley	5 417 353 000	COP	15. Mrz. 2033	(2 868)
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months Erhält Festzinssatz 3,55%	Morgan Stanley	1 141 138 000	KRW	19. Mrz. 2028	(9 816)
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months Erhält Festzinssatz 6,52%	Morgan Stanley	6 388 952 000	KRW	15. Mrz. 2028	(109 434)
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day Erhält Festzinssatz 6,20%	Morgan Stanley	1 169 520 000	CLP	21. Dez. 2032	(20 538)
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 4,59%	Morgan Stanley	684 730 000	CZK	21. Dez. 2024	(95 364)
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months Zahlt Festzinssatz 5,10%	Morgan Stanley	132 115 000	CZK	21. Dez. 2032	(171 513)
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months Erhält Festzinssatz 9,33%	Morgan Stanley	589 125 000	CZK	21. Dez. 2027	301 942
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4 698 565 000	CLP	21. Dez. 2024	(42 589)

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 7,11%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4 209 425 000	CLP	21. Dez. 2027	66 455
Erhält Festzinssatz 6,54%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 169 345 000	CLP	21. Dez. 2032	(18 742)
Erhält Festzinssatz 9,23%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4 691 380 000	CLP	21. Dez. 2024	(50 387)
Zahlt Festzinssatz 7,04%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3 642 375 000	CLP	21. Dez. 2027	67 912
Erhält Festzinssatz 7,75%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	774 145 000	HUF	15. Dez. 2032	(23 406)
Zahlt Festzinssatz 3,26%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	9 714 277 000	KRW	15. Mrz. 2033	52 271
Erhält Festzinssatz 3,75%					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	6 804 000	CAD	20. Mrz. 2025	106 705
Erhält Festzinssatz 2,53%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14 116 000	EUR	15. Mrz. 2025	(74 090)
Erhält Festzinssatz 9,20%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	206 353 000	HUF	21. Dez. 2032	(11 630)
Erhält Festzinssatz 9,19%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	256 163 000	HUF	21. Dez. 2032	(14 889)
Erhält Festzinssatz 13,24%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	623 390 000	HUF	21. Dez. 2024	12 415
Erhält Festzinssatz 13,44%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	832 456 000	HUF	21. Dez. 2024	22 859
Erhält Festzinssatz 4,34%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	6 611 000	NZD	15. Mrz. 2024	(21 649)
Erhält Festzinssatz 13,34%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	916 887 000	HUF	21. Dez. 2024	21 719
Erhält Festzinssatz 3,06%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7 926 000	NZD	20. Mrz. 2025	(19 277)
Zahlt Festzinssatz 3,72%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1 498 000	NZD	15. Mrz. 2025	8 325
Erhält Festzinssatz 4,34%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4 691 000	NZD	19. Mrz. 2028	(28 796)
Zahlt Festzinssatz 4,09%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	3 391 000	NZD	15. Mrz. 2028	39 499
Zahlt Festzinssatz 4,16%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5 086 000	NZD	15. Mrz. 2033	27 924
Erhält Festzinssatz 4,13%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7 837 000	NZD	15. Mrz. 2033	(135 363)
Zahlt Festzinssatz 6,24%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3 114 239 000	CLP	15. Mrz. 2033	78 234
Zahlt Festzinssatz 10,09%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	13 463 226 000	CLP	15. Mrz. 2024	107 980
Zahlt Festzinssatz 7,22%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 316 550 000	CLP	20. Mrz. 2025	5 373
Zahlt Festzinssatz 8,57%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	14 883 349 000	CLP	15. Mrz. 2025	171 117

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 6,67%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4 257 628 000	CLP	15. Mrz. 2028	86 408
Zahlt Festzinssatz 6,71%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 172 259 000	CLP	15. Mrz. 2028	41 030
Zahlt Festzinssatz 6,69%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 259 150 000	CLP	15. Mrz. 2028	44 033
Zahlt Festzinssatz 2,88%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	105 692 000	SEK	15. Mrz. 2033	119 813
Zahlt Festzinssatz 5,98%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9 290 000	PLN	21. Dez. 2032	109 766
Erhält Festzinssatz 6,16%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	20 712 000	PLN	21. Dez. 2027	(137 093)
Erhält Festzinssatz 10,60%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	28 970 000	ZAR	15. Dez. 2032	(18 414)
Zahlt Festzinssatz 8,81%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19 115 000	MXN	15. Dez. 2027	16 105
Zahlt Festzinssatz 8,85%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	24 110 000	MXN	15. Dez. 2027	18 894
Zahlt Festzinssatz 8,82%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19 726 000	MXN	15. Dez. 2027	16 498
Erhält Festzinssatz 3,53%					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	369 637 000	NOK	15. Mrz. 2028	132 382
Zahlt Festzinssatz 3,81%					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	734 540 000	NOK	15. Mrz. 2025	(264 125)
Zahlt Festzinssatz 4,03%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	6 033 000	AUD	15. Mrz. 2028	(13 848)
Zahlt Festzinssatz 4,14%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Bank of America	5 982 000	MYR	18. Dez. 2027	4 325
Erhält Festzinssatz 6,80%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6 147 000	PLN	21. Dez. 2027	(9 790)
Erhält Festzinssatz 8,23%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	92 250 000	ZAR	21. Dez. 2024	(15 359)
Erhält Festzinssatz 9,41%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	26 052 000	ZAR	21. Dez. 2032	(33 003)
Zahlt Festzinssatz 8,63%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	84 660 000	ZAR	21. Dez. 2027	62 552
Erhält Festzinssatz 10,05%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	109 138 000	MXN	20. Sept. 2024	(8 567)
Erhält Festzinssatz 9,02%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29 306 000	MXN	10. Sept. 2032	(16 765)
Zahlt Festzinssatz 9,17%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	96 402 000	MXN	17. Sep. 2027	21 646
Zahlt Festzinssatz 3,69%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	39 241 000	ILS	15. Mrz. 2025	22 157
Erhält Festzinssatz 5,96%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	161 044 000	CZK	15. Mrz. 2025	(12 955)
Zahlt Festzinssatz 2,51%					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	18 586 000	CNY	15. Mrz. 2028	19 732

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

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 2,57%					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	11 411 000	CNY	15. Mrz. 2028	7 231
Zahlt Festzinssatz 5,49%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	116 980 000	CZK	21. Dez. 2027	(18 348)
Erhält Festzinssatz 5,05%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	32 300 000	CZK	21. Dez. 2032	5 416
Erhält Festzinssatz 6,61%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	137 350 000	CZK	21. Dez. 2024	22 356
Zahlt Festzinssatz 2,59%					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	21 609 000	CNY	15. Mrz. 2028	11 222
Erhält Festzinssatz 8,05%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 410 663 000	HUF	15. Mrz. 2033	(23 076)
Zahlt Festzinssatz 2,60%					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	55 375 000	CNY	15. Mrz. 2028	25 140
Zahlt Festzinssatz 3,64%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2 137 405 000	KRW	15. Mrz. 2033	(9 305)
Zahlt Festzinssatz 3,95%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	402 290 000	KRW	15. Mrz. 2033	(3 004)
Zahlt Festzinssatz 3,98%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	366 659 040	KRW	15. Mrz. 2033	(3 508)
Erhält Festzinssatz 8,43%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	438 016 000	HUF	15. Mrz. 2033	2 285
Erhält Festzinssatz 6,93%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11 108 000	PLN	15. Mrz. 2033	14 736
Zahlt Festzinssatz 3,92%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 762 167 000	KRW	15. Mrz. 2033	(11 090)
Zahlt Festzinssatz 3,50%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	5 630 000	SGD	15. Mrz. 2028	(14 126)
Zahlt Festzinssatz 9,42%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 663 784 000	CLP	15. Mrz. 2025	(5 846)
Zahlt Festzinssatz 9,44%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 231 021 000	CLP	15. Mrz. 2025	5 105
Zahlt Festzinssatz 3,83%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2 218 384 740	KRW	15. Mrz. 2033	(1 500)
Zahlt Festzinssatz 9,44%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 459 597 000	CLP	15. Mrz. 2025	(5 567)
Erhält Festzinssatz 13,03%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 454 735 000	HUF	21. Dez. 2024	17 445
Zahlt Festzinssatz 10,78%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	415 410 000	HUF	21. Dez. 2027	(9 066)
Zahlt Festzinssatz 4,34%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4 640 000	NZD	15. Mrz. 2033	3 229
				USD	(1 308 497)

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

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

Zum 30. September 2022 gestaltete sich die Exponierung bei in Bezug auf Derivatkontrakte zu erhaltenden Sicherheiten je Kontrahent folgendermassen:

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Wahrung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA BlueTrend	J.P. Morgan	Barmittel	CHF	1 224 595
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	1 923 698
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	76 035 888
	J.P. Morgan	Barmittel	NZD	134 492
	J.P. Morgan	Barmittel	SEK	7 472 866
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	13 897 682
	J.P. Morgan	Barmittel	ZAR	11 596 821
	Merrill Lynch	Barmittel	EUR	816 004
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	325 139
	UBS	Barmittel	USD	7 660 000
			USD	27 761 577
Schroder GAIA Egerton Equity	HSBC	Barmittel	EUR	1 440 000
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	3
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	11 589 882
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	11 204
			EUR	13 037 844
Schroder GAIA Helix	Barclays Bank	Barmittel	USD	1 390 000
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	1 526 616
	Goldman Sachs	Barmittel	GBP	3 682 180
	Goldman Sachs	Barmittel	HKD	967 140
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	8 247 098
	J.P. Morgan	Barmittel	CAD	12 794
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	6 056 183
	J.P. Morgan	Barmittel	GBP	139 724
	J.P. Morgan	Barmittel	HKD	2 589 797
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	103 355 789
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	25 229 019
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	3 590 000
				USD
Schroder GAIA Sirios US Equity	Goldman Sachs	Barmittel	USD	3 060 000
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	1 340 000
			USD	4 400 000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	Barmittel	EUR	1 991 731
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	37 116 284
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	103 067 770
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	256 132
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	40 856 941
	Morgan Stanley	Barmittel	ZAR	1 028 385
	Societe Generale	Barmittel	AUD	10 812 146
	Societe Generale	Barmittel	CAD	587 622
	Societe Generale	Barmittel	CHF	15
	Societe Generale	Barmittel	EUR	46
	Societe Generale	Barmittel	GBP	7 707 673
	Societe Generale	Barmittel	JPY	68 897 501
	Societe Generale	Barmittel	SEK	13 452 711
	Societe Generale	Barmittel	USD	1 075 065
				USD

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

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
	HSBC	Barmittel	GBP	793 628
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	30 835
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	10
			GBP	824 472
Schroder GAIA Wellington Pagosa				
	Barclays Bank	Barmittel	USD	930 000
	BNP Paribas	Barmittel	USD	5 040 000
	Citi Bank	Barmittel	USD	740 000
	Deutsche Bank	Barmittel	USD	1 280 000
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	2 987 665
	HSBC	Barmittel	USD	1 490 000
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	4 311 000
	Merrill Lynch	Barmittel	USD	900 000
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	144 455
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	565 862
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	1 051 527
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	115 636
	Morgan Stanley	Barmittel	HKD	77 714
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	130
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	139
	Morgan Stanley	Barmittel	THB	95 588
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	4 742 077
	Morgan Stanley	Barmittel	ZAR	5 910
	Standard Chartered Bank	Barmittel	USD	520 000
	UBS	Barmittel	USD	480 000
			USD	25 095 308

Ausweis von Transaktionskosten

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

Die Transaktionskosten für das Berichtsjahr fielen wie folgt aus:

Teilfonds	Währung	Provisionen
Schroder GAIA BlueTrend	USD	75 908
Schroder GAIA Cat Bond	USD	49 820
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	519 253
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	347 228
Schroder GAIA Helix	USD	1 610 841
Schroder GAIA Oaktree Credit	USD	160
Schroder GAIA Sirios US Equity	USD	560 248
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	226 176
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	GBP	59 978
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	1 303 784

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

Dividenden

Während des Berichtsjahres haben die folgende Teilfonds Dividendenausschüttungen vorgenommen:

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoausschüttung	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
14. Jan. 2022	21. Jan. 2022	28. Jan. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	191 961,17	USD	9,970574
			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
8. Apr. 2022	22. Apr. 2022	29. Apr. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	259 273,09	USD	13,155949
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	542,92	USD	3,359030
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1 148,77	SGD	4,496345
13. Mai 2022	20. Mai 2022	27. Mai 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	761,69	USD	4,712553
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1 628,67	SGD	6,373925
10. Jun. 2022	17. Jun. 2022	24. Jun. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	567,24	USD	3,509265
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1 204,21	SGD	4,711851
29. Jun. 2022	30. Jun. 2022	8. Jul. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	299 943,50	USD	15,201275
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch.	8,68	USD	0,578667
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch. (in CHF abgesichert)	52,71	CHF	0,527052
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch. (in GBP abgesichert)	55,09	GBP	0,550939
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch.	9,66	USD	0,644000
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert)	59,24	CHF	0,592384
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	61,91	GBP	0,619105
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse E Aussch.	10,15	USD	0,676667
Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse E Aussch. (in CHF abgesichert)	61,22	CHF	0,612156			
8. Jul. 2022	15. Jul. 2022	22. Jul. 2022	Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	63,96	GBP	0,639571
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	689,07	USD	4,262977
12. Aug. 2022	19. Aug. 2022	26. Aug. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1 463,18	SGD	5,724255
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	925,51	USD	5,725388
9. Sept. 2022	16. Sept. 2022	23. Sept. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1 929,00	SGD	7,545489
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	801,79	USD	4,959744
9. Sept. 2022	16. Sept. 2022	23. Sept. 2022	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1 753,38	SGD	6,856927
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch.	376 938,65	USD	19,227551
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse PI Aussch.	19,28	USD	12,853333
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse PI Aussch. (in GBP abgesichert)	133,91	GBP	1,339085

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

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoausschüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
29. Sept. 2022	30. Sept. 2022	7. Okt. 2022	Schroder GAIA Helix Klasse S Aussch.	474 999,88	USD	3,944310
			Schroder GAIA Helix Klasse S Aussch. (in EUR abgesichert)	110 933,13	EUR	3,974666
			Schroder GAIA Helix Klasse S Aussch. (in GBP abgesichert)	5 595 083,18	GBP	4,193738
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch.	14,14	USD	0,936978
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch. (in CHF abgesichert)	91,72	CHF	0,912095
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch. (in EUR abgesichert)	88,91	EUR	0,889150
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse A2 Aussch. (in GBP abgesichert)	96,23	GBP	0,956773
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch.	16,05	USD	1,062993
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert)	104,15	CHF	1,035021
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch. (in EUR abgesichert)	101,04	EUR	1,010356
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	109,26	GBP	1,085429
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse E Aussch.	17,49	USD	1,157709
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse E Aussch. (in CHF abgesichert)	107,91	CHF	1,072140
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse E Aussch. (in EUR abgesichert)	104,60	EUR	1,045962
			Schroder GAIA Oaktree Credit Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	113,16	GBP	1,123977

Wechselkurs

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

1 Euro = 0,98005 US-Dollar

1 Euro = 0,87775 Pfund Sterling

Ukraine/Russland-Sanktionen

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

Der folgende Teilfonds ist in russischen und ukrainischen Wertpapieren engagiert:

Schroder GAIA Helix

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

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

HSBC Continental Europe, Luxemburg

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

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

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

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

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

Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NAV	Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NAV
Schroder GAIA BlueTrend			Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)		
Klasse A Thes.	202 626	2,76%	Klasse PI Aussch.	0	0,00%
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	1 232	1,86%	Klasse PI Aussch. (in GBP abgesichert)	0	0,00%
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	704 119	1,67%	Klasse Y Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00%	Klasse Y Thes. (in CHF abgesichert)	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes.	1 335 729	3,03%	Klasse Y Thes. (in EUR abgesichert)	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	1 114 656	3,56%	Klasse Y1 Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	17 219	2,15%	Klasse Y1 Thes. (in CHF abgesichert)	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	655 397	2,25%	Klasse Y1 Thes. (in EUR abgesichert)	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1 857 512	2,69%	Schroder GAIA Contour Tech Equity		
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	9 546	2,58%	Klasse A Thes.	1 500	0,01%
Klasse E Thes.	239 240	2,87%	Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	26	0,01%
Klasse E Thes. CHF	0	0,00%	Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	332	0,01%
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00%	Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00%
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	15 730	2,67%	Klasse A1 Thes.	275	0,01%
Klasse E Thes. GBP	0	0,00%	Klasse C Thes.	7 947	0,01%
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	0	0,00%	Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00%
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	495 783	2,81%	Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1 314	0,00%
Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	40	0,00%
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	118 777	2,27%	Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	58	0,00%
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	5 216	2,81%	Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00%
Klasse N Thes. (in SEK abgesichert)	17 610	0,76%	Klasse E Thes.	98	0,00%
Schroder GAIA Cat Bond			Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00%
Klasse A Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00%
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	0	0,00%
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	0	0,00%
Klasse C Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00%
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Schroder GAIA Egerton Equity		
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Klasse A Thes.	34 908	0,04%
Klasse F Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	2	0,00%
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	17 315	0,02%
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Klasse A Aussch. GBP	0	0,00%
Klasse F Aussch.	n. z.#	n. z.#	Klasse A1 Thes.	0	0,00%
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	3 327	0,02%
Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes.	606 239	0,20%
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	9 205	0,01%
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	173 958	0,10%
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Klasse C Aussch.	4 133	0,29%
Klasse IF Thes.	n. z.#	n. z.#	Klasse C Aussch. GBP	1 284	0,07%
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Klasse E Thes.	992	0,72%
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	n. z.#	n. z.#	Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	n. z.#	n. z.#
Klasse IF Aussch.	n. z.#	n. z.#	Klasse X Thes.	2 970	0,00%
Klasse PI Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00%			
Klasse PI Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00%			

Für die Anteilsklasse werden keine Performancegebühren erhoben.

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

Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse (Forts.)

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NAV
Schroder GAIA Helix		
Klasse A Thes.	0	0,00%
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00%
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00%
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	0	0,00%
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00%
Klasse C Thes.	0	0,00%
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00%
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00%
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1	0,00%
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	0	0,00%
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00%
Klasse C1 Thes.	0	0,00%
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00%
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00%
Klasse E Thes.	0	0,00%
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	0	0,00%
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	116	0,00%
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	0	0,00%
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00%
Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	n. z.#	n. z.#
Klasse IZ Thes. (in GBP abgesichert)	0	0,00%
Klasse S Aussch.	0	0,00%
Klasse S Aussch. (in EUR abgesichert)	0	0,00%
Klasse S Aussch. (in GBP abgesichert)	0	0,00%
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	0	0,00%
Schroder GAIA Sirius US Equity		
Klasse A Thes.	60 728	0,06%
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	191	0,02%
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	27 617	0,15%
Klasse C Thes.	216 287	0,29%
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1 249	0,05%
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	139 139	0,32%
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	9 198	0,09%
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	1 113	0,26%
Klasse E Thes.	262	0,41%
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	3 000	0,11%
Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse X Thes.	0	0,00%
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	21 983	1,89%

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NAV
Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
Klasse C Thes.	331	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.	n. z.#	n. z.#
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.	n. z.#	n. z.#
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%

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Klasse A Thes.	96 529	0,67%
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	1 298	0,39%
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	67 880	0,42%
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	12 202	0,62%
Klasse A1 Thes.	0	0,00%
Klasse C Thes.	1 954 773	0,77%
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	156 938	0,70%
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	22 216	0,53%
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	540 387	0,51%
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	358 206	0,64%
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00%
Klasse C1 Thes.	0	0,00%
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	298	0,50%
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	11 498	0,58%
Klasse E Thes.	42 150	0,69%
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	6 107	0,54%
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	90 126	0,54%
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	46 649	0,60%
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	0	0,00%
Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#

Für den Schroder GAIA Oaktree Credit wird Performancegebühr erhoben.
Für die Anteilsklasse werden keine Performancegebühren erhoben.

Gesamtkostenquote („TER“)

für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr
Schroder GAIA BlueTrend		
Klasse A Thes.	4,76%	2,76%
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	3,89%	1,86%
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	3,70%	1,67%
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	1,98%	0,00%
Klasse C Thes.	4,43%	3,03%
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	4,99%	3,56%
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	3,58%	2,15%
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	3,68%	2,25%
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	4,12%	2,69%
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	4,01%	2,58%
Klasse E Thes.	4,27%	2,87%
Klasse E Thes. CHF	1,17%	0,00%
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,35%	0,00%
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	4,10%	2,67%
Klasse E Thes. GBP	1,24%	0,00%
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	1,36%	0,00%
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	4,24%	2,81%
Klasse N Thes. (in EUR abgesichert)	3,70%	2,27%
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	4,24%	2,81%
Klasse N Thes. (in SEK abgesichert)	1,76%	0,76%

Schroder GAIA Cat Bond		
Klasse A Thes.	1,78%	n. z.#
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	1,82%	n. z.#
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	1,82%	n. z.#
Klasse C Thes.	1,38%	n. z.#
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,41%	n. z.#
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,40%	n. z.#
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,44%	n. z.#
Klasse F Thes.	1,72%	n. z.#
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	1,73%	n. z.#
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	1,73%	n. z.#
Klasse F Aussch.	1,72%	n. z.#
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1,74%	n. z.#
Klasse I Thes.	0,14%	n. z.#
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	0,15%	n. z.#
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	0,13%	n. z.#
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	0,12%	n. z.#
Klasse IF Thes.	1,32%	n. z.#
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	1,33%	n. z.#
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	1,33%	n. z.#
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	1,33%	n. z.#
Klasse IF Aussch.	1,32%	n. z.#
Klasse PI Thes. (in CHF abgesichert)	0,69%	0,00%
Klasse PI Thes. (in EUR abgesichert)	0,69%	0,00%
Klasse PI Aussch.	0,68%	0,00%
Klasse PI Aussch. (in GBP abgesichert)	0,69%	0,00%
Klasse Y Thes.	1,07%	n. z.#

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr
Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)		
Klasse Y Thes. (in CHF abgesichert)	1,14%	n. z.#
Klasse Y Thes. (in EUR abgesichert)	1,14%	n. z.#
Klasse Y1 Thes.	1,42%	n. z.#
Klasse Y1 Thes. (in CHF abgesichert)	1,54%	n. z.#
Klasse Y1 Thes. (in EUR abgesichert)	1,54%	n. z.#

Schroder GAIA Contour Tech Equity		
Klasse A Thes.	2,43%	0,01%
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,46%	0,01%
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,46%	0,01%
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	2,45%	0,00%
Klasse A1 Thes.	2,93%	0,01%
Klasse C Thes.	1,68%	0,01%
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,70%	0,00%
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,70%	0,00%
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,70%	0,00%
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	1,70%	0,00%
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	1,65%	0,00%
Klasse E Thes.	1,42%	0,00%
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,46%	0,00%
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,45%	0,00%
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	1,45%	0,00%
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	1,45%	0,00%
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	1,40%	0,00%

Schroder GAIA Egerton Equity		
Klasse A Thes.	2,47%	0,04%
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	2,46%	0,00%
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	2,48%	0,02%
Klasse A Aussch. GBP	2,43%	0,00%
Klasse A1 Thes.	2,93%	0,00%
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	2,98%	0,02%
Klasse C Thes.	1,87%	0,20%
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,72%	0,01%
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	1,80%	0,10%
Klasse C Aussch.	1,97%	0,29%
Klasse C Aussch. GBP	1,75%	0,07%
Klasse E Thes.	2,38%	0,72%
Klasse X Thes.	1,57%	0,00%

Schroder GAIA Helix		
Klasse A Thes.	2,42%	0,00%
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,46%	0,00%
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,46%	0,00%
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	2,46%	0,00%
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	2,44%	0,00%
Klasse C Thes.	1,36%	0,00%
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,41%	0,00%
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,40%	0,00%

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.

Legende:

#: Performancegebühr wird der Anteilsklasse/dem Teilfonds nicht berechnet

^ Die Gesamtkostenquote (TER) wurde im Einklang mit den Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der Gesamtkostenquote (TER) von kollektiven Kapitalanlagen vom 16. Mai 2008 der Asset Management Association Switzerland AMAS berechnet. Transaktionskosten sind gegebenenfalls im Kauf-/Verkaufspreis der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als Betriebskosten behandelt werden, werden bei der Berechnung der TER nicht berücksichtigt. Die TER wird für die letzten zwölf Monate berechnet. Die TER wird für Zeiträume von weniger als einem Jahr annualisiert.

Gesamtkostenquote („TER“)

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

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performance-gebühr
Schroder GAIA Helix (Forts.)		
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,40%	0,00%
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	1,37%	0,00%
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	1,39%	0,00%
Klasse C1 Thes.	1,29%	0,00%
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	1,34%	0,00%
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	1,35%	0,00%
Klasse E Thes.	1,00%	0,00%
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,00%	0,00%
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	0,99%	0,00%
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	0,97%	0,00%
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	0,96%	0,00%
Klasse I Thes.	0,14%	n. z.#
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	0,17%	n. z.#
Klasse IZ Thes. (in GBP abgesichert)	1,16%	0,00%
Klasse S Aussch.	0,62%	0,00%
Klasse S Aussch. (in EUR abgesichert)	0,66%	0,00%
Klasse S Aussch. (in GBP abgesichert)	0,67%	0,00%
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	0,74%	0,00%

Schroder GAIA Oaktree Credit		
Klasse A2 Thes.	1,35%	n. z.#
Klasse A2 Thes. (in CHF abgesichert)	1,57%	n. z.#
Klasse A2 Thes. (in EUR abgesichert)	1,57%	n. z.#
Klasse A2 Aussch.	1,43%	n. z.#
Klasse A2 Aussch. (in CHF abgesichert)	1,59%	n. z.#
Klasse A2 Aussch. (in EUR abgesichert)	1,58%	n. z.#
Klasse A2 Aussch. (in GBP abgesichert)	1,59%	n. z.#
Klasse C Thes.	1,07%	n. z.#
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,09%	n. z.#
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,07%	n. z.#
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,07%	n. z.#
Klasse C Aussch.	0,93%	n. z.#
Klasse C Aussch. (in CHF abgesichert)	1,09%	n. z.#
Klasse C Aussch. (in EUR abgesichert)	1,08%	n. z.#
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	1,09%	n. z.#
Klasse E Thes.	0,91%	n. z.#
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	0,91%	n. z.#
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	0,93%	n. z.#
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	0,92%	n. z.#
Klasse E Aussch.	0,60%	n. z.#
Klasse E Aussch. (in CHF abgesichert)	0,94%	n. z.#
Klasse E Aussch. (in EUR abgesichert)	0,93%	n. z.#
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	0,94%	n. z.#
Klasse I Thes.	0,14%	n. z.#

Schroder GAIA Sirios US Equity		
Klasse A Thes.	2,49%	0,06%
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,48%	0,02%
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,61%	0,15%
Klasse C Thes.	1,97%	0,29%

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performance-gebühr
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)		
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,76%	0,05%
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	2,02%	0,32%
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,79%	0,09%
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	1,94%	0,26%
Klasse E Thes.	1,78%	0,41%
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,51%	0,11%
Klasse X Thes.	1,51%	0,00%
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	3,49%	1,89%

Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
Klasse C Thes.	1,82%	0,00%
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,86%	0,00%
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,85%	0,00%
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,86%	0,00%
Klasse K Thes.	2,33%	0,00%
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	2,35%	0,00%
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	2,36%	0,00%

Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund		
Klasse C Thes.	1,14%	0,00%
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,16%	0,00%
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,15%	0,00%
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	1,15%	0,00%
Klasse I Thes.	0,08%	n. z.#
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	1,65%	0,00%
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	1,64%	0,00%
Klasse R Thes.	1,13%	0,00%
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	1,16%	0,00%
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	1,15%	0,00%

Schroder GAIA Wellington Pagosa		
Klasse A Thes.	3,10%	0,67%
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,85%	0,39%
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,88%	0,42%
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	3,08%	0,62%
Klasse A1 Thes.	2,86%	0,00%
Klasse C Thes.	2,45%	0,77%
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	2,41%	0,70%
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	2,23%	0,53%
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	2,22%	0,51%
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	2,35%	0,64%
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	1,60%	0,00%
Klasse C1 Thes.	1,56%	0,00%
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	2,25%	0,50%
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	2,29%	0,58%
Klasse E Thes.	1,87%	0,69%
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,74%	0,54%
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,75%	0,54%
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	1,81%	0,60%
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	1,14%	0,00%

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.

Legende:

#: Performancegebühr wird der Anteilsklasse/dem Teilfonds nicht berechnet

^ Die Gesamtkostenquote (TER) wurde im Einklang mit den Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der Gesamtkostenquote (TER) von kollektiven Kapitalanlagen vom 16. Mai 2008 der Asset Management Association Switzerland AMAS berechnet. Transaktionskosten sind gegebenenfalls im Kauf-/Verkaufspreis der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als Betriebskosten behandelt werden, werden bei der Berechnung der TER nicht berücksichtigt. Die TER wird für die letzten zwölf Monate berechnet. Die TER wird für Zeiträume von weniger als einem Jahr annualisiert.

Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)

Risikoprofil und Hebelung

1. Commitment-Ansatz

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

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

2. Absoluter VaR-Ansatz

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

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

Teilfonds	Ausschöpfung des regulatorischen VaR-Limits			Durchschnittliche Hebelung
	Niedrigstes	Höchstes	Durchschnitt	
Schroder GAIA BlueTrend	21,60%	64,15%	37,95%	1505,29%
Schroder GAIA Contour Tech Equity	22,71%	47,45%	38,12%	139,78%
Schroder GAIA Egerton Equity	36,44%	53,57%	44,64%	158,31%
Schroder GAIA Helix	7,52%	12,23%	10,09%	602,33%
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	23,00%	34,06%	28,43%	520,03%
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	10,42%	16,70%	13,36%	99,90%
Schroder GAIA Wellington Pagosa	6,08%	16,97%	10,16%	957,56%

Angaben zum VaR-Modell

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

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

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

Diese Angaben sind Bestandteil des ungeprüften Teils dieses Jahresberichts und Abschlusses und sollten in Verbindung mit dem Vergütungsbericht der Schroders plc auf den Seiten 77 bis 99 des Jahresberichts und Abschlusses für 2021 (verfügbar auf der Website der Gruppe – <https://www.schroders.com/en/investor-relations/results-and-reports/annual-report-and-accounts-2021/>) gelesen werden, der weitere Informationen zu den Aktivitäten unseres Vergütungsausschusses und zu unseren Vergütungsgrundsätzen und -richtlinien bietet.

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

Der Vergütungsausschuss der Schroders plc hat eine Vergütungsrichtlinie aufgestellt, um sicherzustellen, dass die Anforderungen der OGAW-Richtlinie für alle OGAW-MRTs eingehalten werden. Der Vergütungsausschuss und der Verwaltungsrat der Schroders plc prüfen die Vergütungsstrategie mindestens jährlich. Der Verwaltungsrat der SIM Europe ist für die Verabschiedung der Vergütungsrichtlinie, die Prüfung ihrer allgemeinen Grundsätze mindestens einmal jährlich, und für die Beaufsichtigung ihrer Umsetzung und für die Sicherstellung der Einhaltung der massgeblichen lokalen Rechtsvorschriften verantwortlich. Die Vergütungspolitik wurde im Jahr 2021 überprüft, um sicherzustellen, dass sie mit den OGAW/AIFMD-Vergütungsanforderungen konform ist, und es wurden keine erheblichen Änderungen vorgenommen.

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

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

Die nachstehenden Vergütungsdaten spiegeln die im Jahr 2021 gezahlten leistungsabhängigen Vergütungen wider.

- Der Gesamtbetrag der von der SIM Europe an ihre 316 Mitarbeitenden gezahlten Vergütung belief sich auf 63,45 Mio. EUR, wovon 34,49 Mio. EUR auf Festvergütungen (z. B. Gehälter, Sachleistungen) und 28,96 Mio. EUR auf variable Vergütungen (z. B. Jahresbonuszahlungen oder aufgeschobene Bonuszahlungen) entfielen. Mitarbeiter anderer Unternehmen der Schroders-Gruppe, die im Verwaltungsrat der SIM Europe sitzen, erhalten für ihre Rolle als Verwaltungsratsmitglieder der SIM Europe keine zusätzliche Vergütung.
- Die nachstehenden Angaben beziehen sich auf OGAW-MRTs der SIM Europe. Die meisten dieser OGAW-MRTs waren bei anderen Unternehmen der Schroders-Gruppe beschäftigt. Dazu gehören auch Anlageverwaltungsdienste oder andere Aufgaben, die von der SIM Europe an andere Unternehmen der Schroders-Gruppe oder Dritte übertragen wurden. Viele dieser OGAW-MRTs erbringen Leistungen für andere Unternehmen der Schroders-Gruppe und andere Kunden. Im Interesse der Transparenz spiegeln die nachstehenden Gesamtvergütungszahlen die vollständige Vergütung für jeden OGAW-MRT der SIM Europe wider. Die an die 222 OGAW-MRTs der SIM Europe in Bezug auf das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2021 gezahlte und der SIM Europe oder den von ihr verwalteten OGAW-Fonds zugerechnete Gesamtvergütung beträgt 229,21 Mio. EUR, wovon 63,68 Mio. EUR an Mitglieder der oberen Führungsebene, 157,34 Mio. EUR an MRTs, die Risiken für die SIM Europe oder die von ihr verwalteten OGAW-Fonds übernehmen, und 8,19 Mio. EUR an andere OGAW-MRTs, einschliesslich MRTs mit Kontrollfunktionen, gezahlt wurden. Diese Gesamtvergütungswerte umfassen Beträge, die ggf. von Beauftragten gezahlt wurden.

Zusätzliche qualitative Informationen zu den Vergütungsrichtlinien und -praktiken finden Sie auf www.schroders.com/rem-disclosures.

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)

Die Teilfonds gehen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte ein (Securities Financing Transactions, SFT) (gemäss Definition in Artikel 3 der EU-Verordnung 2015/2365; hiernach umfassen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte unter anderem Pensionsgeschäfte, das Ver- oder Entleihen von Wertpapieren oder Rohstoffen, Buy-Sell-Back-Geschäfte oder Sell-Buy-Back-Geschäfte sowie Lombardgeschäfte). Gemäss Artikel 13 der Verordnung ist die Beteiligung der Teilfonds in Verbindung mit ihrem Engagement in Total-Return-Swaps für das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 nachfolgend detailliert aufgeführt:

Schroder GAIA Egerton Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte - Long-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
15 746 932	2,67%
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
40 772 883	6,93%
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt EUR	% des verwalteten Vermögens
56 519 815	9,60%

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 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	20 750 502
Morgan Stanley	16 354 048
J.P. Morgan	14 262 694
Merrill Lynch	5 152 571
	56 519 815

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert EUR
Barmittel	11 589 882
	11 589 882

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert EUR
weniger als 1 Tag	11 589 882
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	11 589 882

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert EUR
EUR	11 589 882
	11 589 882

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen EUR	Short-Positionen EUR	Summe EUR
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	2 809 381	6 126 358	8 935 739
3 bis 12 Monate	4 259 028	22 833 940	27 092 968
mehr als 1 Jahr	8 678 523	11 812 585	20 491 108
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	15 746 932	40 772 883	56 519 815

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert EUR
Morgan Stanley	11 589 882
	11 589 882

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert EUR
Getrennt	23 901 473
Gepoolt	-
Andere	-
	23 901 473

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu Sicherheitszwecken miteinander verrechnet. Daher beziehen sich die vorstehenden Angaben zu den Sicherheiten auf alle Geschäfte mit OTC-Derivaten und nicht nur auf Total Return Swaps.

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Rendite und Kosten

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

	% der Gesamrendite	Rendite EUR*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettogewinn	94,82%	73 150 460
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	5,18%	3 992 207
	100,00%	77 142 667

* Absolut ausgedrückt.

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

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Helix

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte - Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
–	–
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
35 677 533	7,28%
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
35 677 533	7,28%

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 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	18 218 230
Goldman Sachs	11 768 121
Morgan Stanley	5 090 054
Barclays Bank	601 128
	35 677 533

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	4 890 000
	4 890 000

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	4 890 000
1 bis 7 Tage	–
1 bis 4 Wochen	–
1 bis 3 Monate	–
3 bis 12 Monate	–
mehr als 1 Jahr	–
Unbegrenzte Laufzeit	–
	4 890 000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	4 890 000
	4 890 000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	–	–	–
1 bis 7 Tage	–	–	–
1 bis 4 Wochen	–	–	–
1 bis 3 Monate	–	–	–
3 bis 12 Monate	–	35 677 533	35 677 533
mehr als 1 Jahr	–	–	–
Unbegrenzte Laufzeit	–	–	–
	–	35 677 533	35 677 533

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
J.P. Morgan	4 890 000
	4 890 000

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	5 700 000
Gepoolt	-
Andere	-
	5 700 000

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu Sicherheitszwecken miteinander verrechnet. Daher beziehen sich die vorstehenden Angaben zu den Sicherheiten auf alle Geschäfte mit OTC-Derivaten und nicht nur auf Total Return Swaps.

Rendite und Kosten

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

	% der Gesamrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps**	0,11 %	248 979
Realisierter Nettogewinn	96,74 %	230 036 864
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	3,15 %	7 492 066
	100,00 %	237 777 909

* Absolut ausgedrückt.

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

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

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Sirios US Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte - Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
4 931 519	2,61 %
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
12 658 803	6,72 %
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
17 590 322	9,33 %

Konzentrationsdaten

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

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

Die zehn grössten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Goldman Sachs	6 988 739
Merrill Lynch	6 735 575

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	3 759 674
Barclays Bank	106 334
	17 590 322

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	1 340 000
	1 340 000

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	1 340 000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	1 340 000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	1 340 000
	1 340 000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	106 334	106 334
1 bis 3 Monate	-	940 604	940 604
3 bis 12 Monate	4 799 838	10 575 163	15 375 001
mehr als 1 Jahr	131 681	1 036 702	1 168 383
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	4 931 519	12 658 803	17 590 322

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	1 340 000
	1 340 000

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	1 510 000
Gepoolt	-
Andere	-
	1 510 000

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu Sicherheitszwecken miteinander verrechnet. Daher beziehen sich die vorstehenden Angaben zu den Sicherheiten auf alle Geschäfte mit OTC-Derivaten und nicht nur auf Total Return Swaps.

Rendite und Kosten

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

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	-	-
Realisierter Nettogewinn	95,44%	21 906 494
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	4,56%	1 046 632
	100,00%	22 953 126

* Absolut ausgedrückt.

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

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte - Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
18 017 797	2,59%
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
-	-
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
18 017 797	2,59%

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 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	18 017 797
	18 017 797

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	4 600 000
	4 600 000

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	4 600 000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	4 600 000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	4 600 000
	4 600 000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	18 017 797	-	18 017 797
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	-	-	-
mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	18 017 797	-	18 017 797

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Morgan Stanley	USA

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	4 600 000
	4 600 000

Gestellte Sicherheiten

Zum 30. September 2022 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

Von dem Teilfonds im Rahmen eines ISDA Master Agreement abgeschlossene Geschäfte mit OTC-Derivaten werden zu 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 das Geschäftsjahr zum 30. September 2022 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettogewinn	69,41%	63 109 633
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	30,59%	27 808 191
	100,00%	90 917 824

* Absolut ausgedrückt.

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

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte - Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
7 606 031	1,24%
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
19 340 957	3,14%
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
26 946 988	4,38%

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 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	12 312 140
Goldman Sachs	8 474 723
J.P. Morgan	6 160 125
	26 946 988

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	9 653 665
	9 653 665

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	9 653 665
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	9 653 665

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	9 653 665
	9 653 665

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	61 340	77 511	138 851
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	7 544 691	19 246 772	26 791 463
mehr als 1 Jahr	-	16 674	16 674
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	7 606 031	19 340 957	26 946 988

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	4 298 000
J.P. Morgan	3 306 000
Goldman Sachs	2 049 665
	9 653 665

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	1 240 143
Gepoolt	–
Andere	–
	1 240 143

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

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettogewinn	26,40%	4 666 562
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	73,60%	13 011 461
	100,00%	17 678 023

* Absolut ausgedrückt.

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

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft)

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

Name des Produkts: **Schroder GAIA Cat Bond**

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

Ökologische und/ oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

<input checked="" type="checkbox"/> <input type="checkbox"/> Ja	<input type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<input type="checkbox"/> Es hat nachhaltige Investitionen mit einem ökologischen Ziel getätigt: ___% <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltige einzustufen sind <input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltige einzustufen sind	<input type="checkbox"/> Es wurden ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl es keine nachhaltigen Investitionen angestrebt hat, enthielt es einen Anteil von ___% an nachhaltigen Investitionen <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind <input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel
<input type="checkbox"/> Es hat nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Es hat ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

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

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



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/ oder sozialen Merkmale erfüllt?

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

– mindestens 80% seines Vermögens in Anlagen, die mit Naturkatastrophen und/oder Lebensrisiken verbunden sind, mit dem Ziel, die negativen Folgen solcher Ereignisse zu reduzieren, zum Wiederaufbau von Volkswirtschaften und Gesellschaften nach dem Ereignis beizutragen und damit ihre künftige Widerstandsfähigkeit zu erhöhen;

– mindestens 50% seines Vermögens in Anlagen, die mit meteorologischen Risiken verbunden sind, mit dem Ziel, die negativen Folgen solcher Ereignisse zu reduzieren, zum Wiederaufbau von Volkswirtschaften und Gesellschaften nach dem Ereignis beizutragen und damit ihre Widerstandsfähigkeit in Zukunft zu erhöhen und potenziell die negativen Folgen des Klimawandels abzumildern;

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

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

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

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

Der Nachhaltigkeitswert wird von einem von Schroders entwickelten Tool gemessen. Es liefert eine Schätzung der tatsächlichen „Auswirkungen“, die ein Sponsor einer Transaktion in Bezug auf soziale und ökologische „Kosten“ oder „Vorteile“ verursachen könnte. Dazu werden bestimmte Indikatoren in Bezug auf diesen Sponsor verwendet und diese positiv und negativ quantifiziert, um eine aggregierte fiktive Kennzahl für die Auswirkungen zu erstellen, die der jeweils zugrunde liegende Sponsor auf die Gesellschaft und die Umwelt haben kann. Dabei werden sowohl Daten Dritter als auch eigene Schätzungen und Annahmen von Schroders verwendet, und das Ergebnis kann von anderen Nachhaltigkeits-Tools und -Massstäben abweichen. Beispiele für solche Indikatoren sind Treibhausgasemissionen, Wasserverbrauch und Gehälter im Vergleich zum Existenzminimum.

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

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

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

Der Nachhaltigkeitswert wird wie vorstehend beschrieben als fiktiver Prozentsatz berechnet.

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

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

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

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

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

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

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

● ... und im Vergleich zu früheren Zeiträumen?

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

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

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

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

Diese Frage trifft auf diesen Fonds nicht zu.

— Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Diese Frage trifft auf diesen Fonds nicht zu.

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

Diese Frage trifft auf diesen Fonds nicht zu.

Die wichtigsten

nachteiligen Auswirkungen

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

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

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomie-konforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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



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

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

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

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

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Während des Referenzzeitraums waren die 15 wichtigsten Investitionen:

Grösste Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
VOUSSOIR_RE_JULY_2021	Finanzwerte	1,92	Bermuda
LION III RE DAC 21-A FRN 144A 3.83% 15 JUL 2025	Finanzwerte	0,72	Irland
VOUSSOIRRE_JULY_2022_SIDE CAR	Finanzwerte	0,70	Bermuda
LAFI 2018-1A A 5.956% 25 JUL 2048	Finanzwerte	0,67	Vereinigte Staaten
MYSTIC RE IV LIMITED FRN 08/01/2024 A	Finanzwerte	0,65	Bermuda
NAKAMA RE 2018-1 CLASS 1 FRN 2% 13 APR 2023	Finanzwerte	0,65	Bermuda
EDEN RE II LTD B 144A 0% 20 MAR 2026	Finanzwerte	0,62	Bermuda
KILIMANJARO III RE LTD A FRN 144A 5.25% 25 JUN 2025	Finanzwerte	0,59	Bermuda
FLOODSMART RE LTD 11.25% 25 FEB 2025	Finanzwerte	0,55	Bermuda
URSA RE LTD 5.7562% 10 DEC 2022	Finanzwerte	0,55	Bermuda
CAPELOOKOUT RE_2021-1_CLASS A FRN 22/03/2024	Finanzwerte	0,53	Bermuda
LONGPOINT RE LTD III (144A) 3.2576% 01 JUN 2022	Finanzwerte	0,52	Kaimaninseln
URSA RE II LIMITED FRN 144A 6.9949% 07 DEC 2023	Finanzwerte	0,52	Bermuda
MERNA REINSURANCE II LIMITED FRN 05/04/2024 A 144A	Finanzwerte	0,50	Bermuda
PHOENICIAN RE LIMITED FRN 14/12/2023 A 144A	Finanzwerte	0,50	Bermuda

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

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

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

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

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



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

- *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

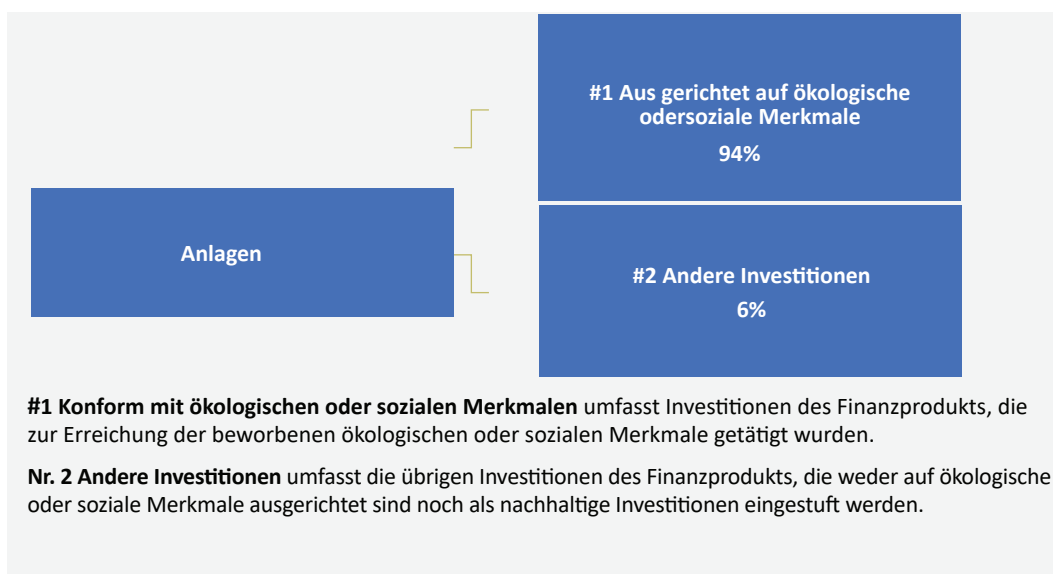
Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

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

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

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

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



Taxonomie-konforme Aktivitäten sind ausgedrückt als Anteil an:

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

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Im Referenzzeitraum wurden in den folgenden Wirtschaftszweigen Investitionen getätigt:

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

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

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

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

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

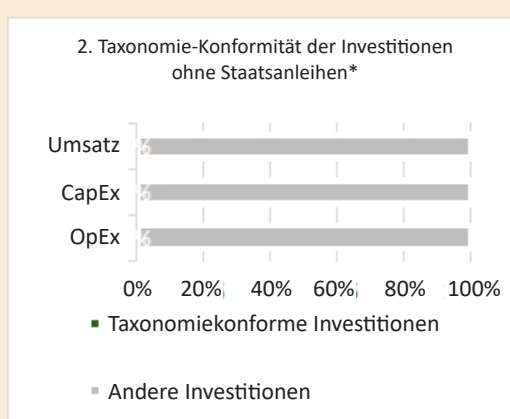
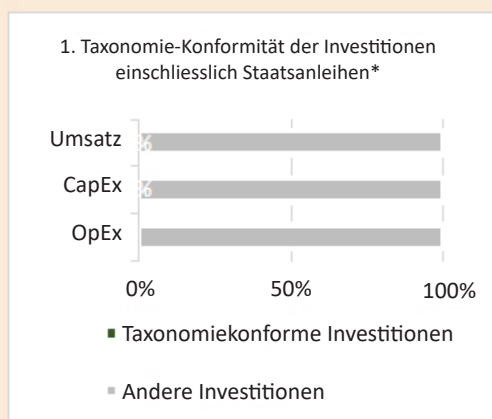


Wirtschaftszweigen konform sind, die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht aufgeführt sind, werden aus dem vom Administrator geführten Book of Record (ABoR) abgeleitet. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen und der unterschiedlichen Berechnungsmethoden dieser alternativen Datenquellen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

Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

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



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

● **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

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

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

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



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

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

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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

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



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

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

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

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

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



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

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

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

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

- **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

- **Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

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

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

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

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

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

Name des Produkts: **Schroder GAIA Helix**

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

Ökologische und/ oder soziale Merkmale

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

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

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

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

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

Nein

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

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

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

mit einem sozialen Ziel

Es hat ökologische/soziale Merkmale beworben, aber **keine nachhaltigen Investitionen getätigt**

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

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

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

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



Inwieweit wurden die mit dem Finanzprodukt beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale erfüllt?

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden erfüllt. Der Fonds weist basierend auf dem Ratingsystem des Anlageverwalters einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert auf. Dies bedeutet, dass der gewichtete Durchschnittswert des Fonds auf Basis der zum Monatsende verfügbaren Daten über einen gleitenden Sechsmonatszeitraum bis zum Ende des Referenzzeitraums höher als Null war.

Der Nachhaltigkeitswert wird von einem von Schroders entwickelten Tool gemessen. Es liefert eine Schätzung der tatsächlichen „Auswirkungen“, die ein Emittent in Bezug auf soziale und ökologische „Kosten“ oder „Vorteile“ verursachen könnte. Dazu werden bestimmte Indikatoren in Bezug auf diesen Emittenten verwendet und positiv und negativ quantifiziert, um eine aggregierte fiktive Kennzahl für die Auswirkungen zu erstellen, die der jeweils zugrunde liegende Emittent auf die Gesellschaft und die Umwelt haben kann. Dabei werden sowohl Daten Dritter als auch eigene Schätzungen und Annahmen von Schroders verwendet, und das Ergebnis kann von anderen Nachhaltigkeits-Tools und -Massstäben abweichen. Beispiele für solche Indikatoren sind Treibhausgasemissionen, Wasserverbrauch und Gehälter im Vergleich zum Existenzminimum.

Das Ergebnis wird als Gesamtbewertung der Nachhaltigkeitsindikatoren für jeden Emittenten ausgedrückt, insbesondere als fiktiver Prozentsatz (positiv oder negativ) des Umsatzes oder des BIP des betreffenden Emittenten. Ein Wert von +2% würde beispielsweise bedeuten, dass ein Emittent pro 100 USD Umsatz oder BIP eine relative fiktive positive Auswirkung (d. h. einen Nutzen für die Gesellschaft) von 2 USD hätte. Der Nachhaltigkeitswert des Fonds ergibt sich aus den Werten aller Emittenten im Portfolio des Fonds (ggf. auch auf der Basis von Indizes und Wertpapierkörben), die mit Schroders eigenem Tool gemessen werden. Die Long- und Short-Positionen des Fonds tragen unterschiedlich zum Gesamtergebnis bei. Long-Positionen mit positiven Bewertungen und Short-Positionen mit negativen Bewertungen tragen beide positiv zur Gesamtbewertung bei, während Long-Positionen mit negativen Bewertungen und Short-Positionen mit positiven Bewertungen beide die Gesamtbewertung beeinträchtigen.

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

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

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

● **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

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

Der Nachhaltigkeitswert wird wie vorstehend beschrieben als fiktiver Prozentsatz berechnet.

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

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

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

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

– CO₂-Emissionen Scope 1: die geschätzten Umweltkosten von Scope-1-Treibhausgasemissionen (THG) in Bezug auf den Klimawandel. Scope-1-Emissionen stellen die direkten Emissionen innerhalb des Verantwortungsbereichs eines Unternehmens dar;

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

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

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

Tabak, Scope 1-CO₂-Emissionen bzw. Scope 3-CO₂-Emissionen sind gesellschaftliche bzw. ökologische Kosten (und wurden daher negativ bewertet), trugen jedoch positiv zum Nachhaltigkeitswert des Fonds bei, da sie Short-Positionen darstellen, und Short-Positionen mit negativen Bewertungen tragen positiv zum Gesamt-Nachhaltigkeitswert des Fonds bei.

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

Der Ansatz des Anlageverwalters, kein ökologisch oder sozial nachhaltiges Anlageziel erheblich zu schädigen, umfasste:

- unternehmensweite Ausschlüsse für Schroders-Fonds. Diese betreffen internationale Übereinkommen über Streumunition, Antipersonenminen sowie chemische und biologische Waffen. Eine detaillierte Liste aller ausgeschlossenen Unternehmen finden Sie unter <https://www.schroders.com/en/sustainability/active-ownership/group-exclusions/>
- Schroders hat am 6. Januar 2020 die Grundsätze der Global Compact-Initiative der Vereinten Nationen (UNGC) unterzeichnet. Der Fonds hat Unternehmen, die gegen die Grundsätze der Global Compact-Initiative der Vereinten Nationen (UNGC-Grundsätze) verstossen, aus dem Anteil des Portfolios an nachhaltigen Investitionen ausgeschlossen, da Schroders der Ansicht ist, dass Verstösse ein oder mehrere ökologisch oder sozial nachhaltige Investitionsziele erheblich beeinträchtigen. Zu den Bereichen, die bestimmen, ob ein Emittent gegen die UNGC-Grundsätze verstösst, gehören Themen, die von den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte abgedeckt werden, wie Menschenrechte, Bestechung und Korruption, Arbeitnehmerrechte, Kinderarbeit, Diskriminierung,

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

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

Gesundheitsschutz und Sicherheit sowie Tarifverhandlungen. Die Liste der Verletzer der UNGC-Grundsätze wird von einem Dritten bereitgestellt und die Einhaltung der Liste wurde durch unsere automatisierten Compliance-Kontrollen überwacht.

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

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

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

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

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

Klimawandel:

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

Biodiversität und natürliche Ressourcen:

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

Menschenrechte:

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

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

Umgang mit Humankapital:

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

Diversität und Inklusion:

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

Unternehmensführung (Corporate Governance):

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

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

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

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

In der EU-Taxonomie ist der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ festgelegt, nach dem taxonomie-konforme Investitionen die Ziele der EU-Taxonomie nicht erheblich beeinträchtigen dürfen, und es sind spezifische EU-Kriterien beigefügt.

Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die Unionskriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

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



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

Der Ansatz des Anlageverwalters zur Berücksichtigung der wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren umfasste die Klassifizierung der Indikatoren in drei Kategorien:

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

Engagement-Thema	# Emittenten
Klimawandel	545
Diversität und Inklusion	152
Governance und Aufsicht	3130
Umgang mit Humankapital	61
Menschenrechte	105
Natürliche Ressourcen und Biodiversität	81

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

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

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



Welche sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

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

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

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

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

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

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

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



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

● *Wie sah die Vermögensallokation aus?*

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

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

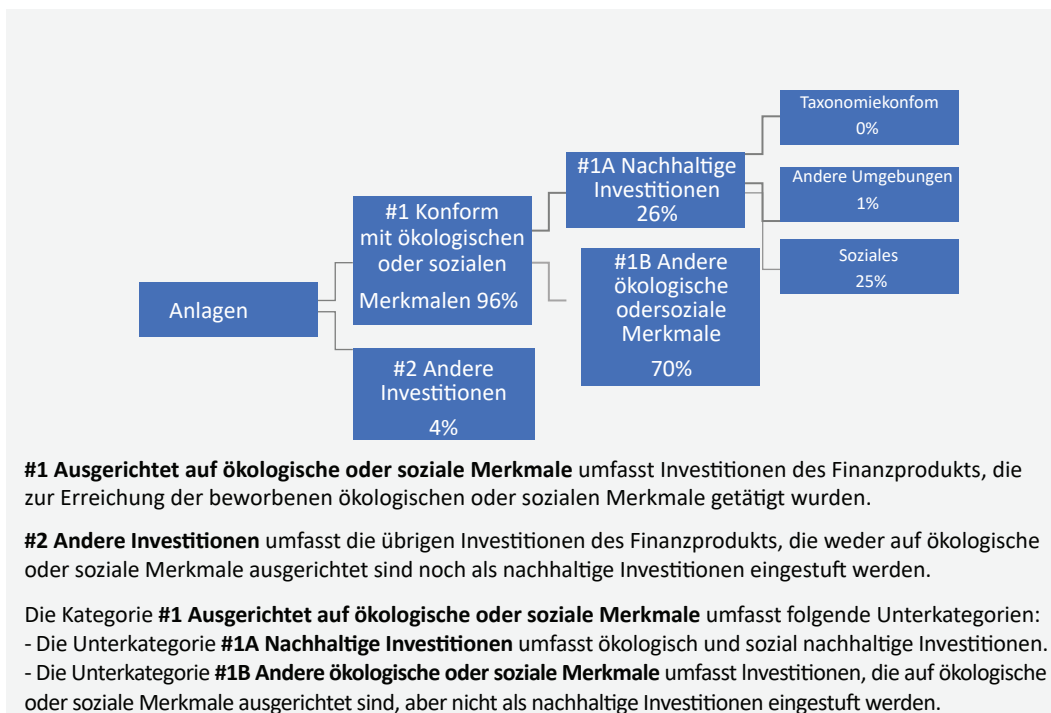
Der Nachhaltigkeitswert wird von einem von Schroders entwickelten Tool gemessen. Es liefert eine Schätzung der tatsächlichen „Auswirkungen“, die ein Emittent in Bezug auf soziale und ökologische „Kosten“ oder „Vorteile“ verursachen könnte. Dazu werden bestimmte Indikatoren in Bezug auf diesen Emittenten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

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

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

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

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



Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

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

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

● In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Im Referenzzeitraum wurden in den folgenden Wirtschaftszweigen Investitionen getätigt, basierend auf dem Nettoengagement (in % des NIW):

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

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

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

Ermöglichende

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

Übergangstätigkeiten

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

Die obige Liste basiert auf dem Durchschnitt des Brutto- und Nettoengagement des Fonds in % des Nettoinventarwerts an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums.

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

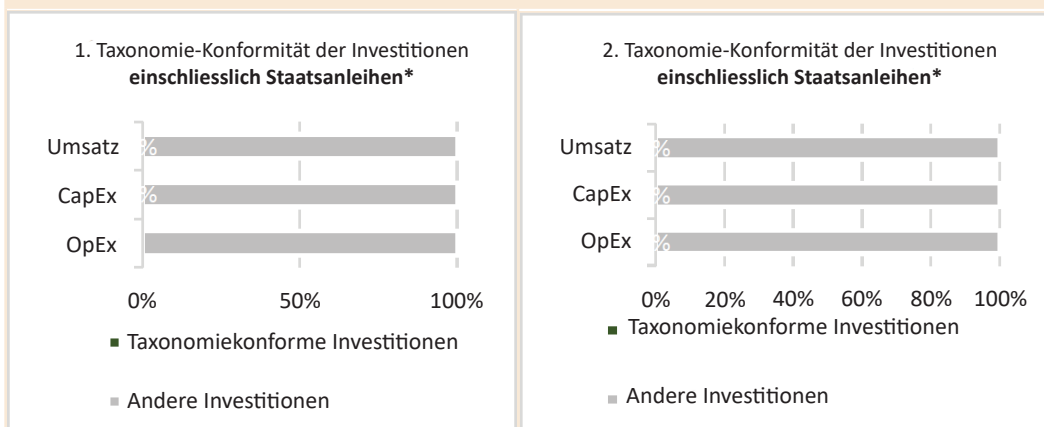
Der Prozentsatz des NIW, der mit den oben erwähnten Wirtschaftszweigen konform ist, wird aus der Datenquelle des Schroders Investment Book of Record (IBoR) abgeleitet. Der Prozentsatz des Nettoinventarwerts, der mit den Wirtschaftszweigen konform ist, die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht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



Inwiefern waren die nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel mit der EU-Taxonomie konform?

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

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



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

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

- **Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichende Tätigkeiten geflossen sind?**

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

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

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



Wie hoch war der Anteil der nicht mit der EU-Taxonomie konformen nachhaltigen Investitionen mit einem Umweltziel?

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



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

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



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

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

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

Darüber hinaus wurden neue Kontrahenten durch Schroders eigenes Kreditrisikoteam überprüft, und die Genehmigung eines neuen Kontrahenten basierte auf einer ganzheitlichen Überprüfung der verschiedenen verfügbaren Informationsquellen, einschliesslich unter anderem der Qualität des Managements, der Eigentümerstruktur,



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

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

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

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



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

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

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

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

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

● **Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?**

Diese Frage trifft auf diesen Fonds nicht zu.

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

- *Wie hat dieses Finanzprodukt in Bezug auf die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten, mit denen die Ausrichtung des Referenzwerts auf die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale bestimmt wird?*

Diese Frage trifft auf diesen Fonds nicht zu.

- *Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?*

Diese Frage trifft auf diesen Fonds nicht zu.

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

Diese Frage trifft auf diesen Fonds nicht zu.

Anhang IV – Fondsperformance (ungeprüft)

Für das Kalenderjahr 2021*

	Schroder GAIA BlueTrend	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Helix	Schroder GAIA Sirios US Equity	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse A Thes.	2,67%	2,81%	(7,35%)	7,77%	0,20%	8,48%	-	-	5,20%
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	1,64%	-	(9,30%)	-	(0,65%)	7,94%	-	-	4,64%
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	1,94%	-	(8,13%)	-	(0,52%)	8,04%	-	-	4,55%
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	8,26%	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	(8,26%)	-	1,04%	-	-	-	5,19%
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	8,40%	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	1,47%	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	(7,39%)	7,35%	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	7,97%	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	3,06%	3,22%	(6,60%)	8,40%	1,94%	8,82%	5,35%	4,33%	5,83%
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	1,85%
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	2,39%	2,08%	(8,24%)	-	1,06%	8,29%	4,08%	3,50%	4,93%
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	2,54%	2,41%	(7,37%)	-	0,80%	8,38%	4,32%	3,68%	5,12%
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	2,86%	3,02%	(6,73%)	8,83%	1,45%	8,71%	4,99%	-	5,60%
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	(6,99%)	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	1,92%	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	9,15%	-	-	-	4,32%	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	8,48%	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	2,04%	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	2,88%	-	-	-	-	8,71%	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	2,03%	-	-	-	-
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	4,93%
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	5,25%
Klasse E Thes.	2,99%	-	(5,85%)	8,42%	2,49%	9,41%	-	-	6,65%
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	(6,84%)	-	1,03%	-	-	-	5,76%
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	2,59%	-	(6,67%)	-	1,44%	8,82%	-	-	5,87%
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	(6,29%)	-	2,20%	-	-	-	6,41%
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	(6,52%)	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	2,57%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	2,87%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	1,76%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	1,97%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	2,87%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	2,80%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	-	4,51%	-	-	4,25%	-	-	7,50%	-
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	3,38%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	3,61%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	4,11%	-	-	3,81%	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	3,28%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	2,17%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	2,42%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	-	2,81%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	2,31%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-	4,83%	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-	-	3,52%	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-	3,80%	2,84%	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	3,88%	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	2,59%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-	-	4,29%	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	3,69%	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	4,35%	-
Klasse X Thes.	-	-	-	8,46%	-	8,80%	-	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	1,82%	8,10%	-	-	-

* Bitte beachten Sie, dass der Schroder GAIA Oaktree Credit in der obigen Tabelle nicht aufgeführt wurde, da der Teilfonds zum 31. Dezember 2021 in diesem Zeitraum nicht aktiv war.

Die vergangene Wertentwicklung ist kein Hinweis auf die gegenwärtige oder künftige Wertentwicklung. In diesen Performancedaten wurden keine Provisionen und Kosten berücksichtigt, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen angefallen sind.

Anhang IV – Fondsperformance (ungeprüft)

Drei Kalenderjahre bis 31. Dezember 2021*

	Schroder GAIA BlueTrend	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Helix	Schroder GAIA Sirius US Equity	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse A Thes.	27,36%	-	32,34%	36,44%	14,61%	19,68%	-	-	16,11%
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	20,23%	-	24,59%	-	8,48%	13,12%	-	-	9,99%
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	21,27%	-	27,20%	-	9,27%	13,74%	-	-	10,61%
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	38,68%	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	29,08%	-	13,88%	-	-	-	14,79%
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	43,13%	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	27,53%	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	30,89%	34,69%	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	41,34%	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	29,68%	-	35,12%	39,01%	17,81%	21,79%	3,09%	13,38%	18,07%
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	22,40%	-	28,68%	-	12,24%	15,13%	(2,62%)	9,72%	11,92%
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	23,83%	-	29,68%	-	12,64%	15,75%	(1,65%)	11,17%	12,52%
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	26,88%	-	31,98%	41,45%	15,30%	17,96%	0,82%	-	14,91%
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	31,30%	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	16,80%	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	46,39%	-	-	-	16,19%	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	38,78%	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	29,94%	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	26,97%	-	-	-	-	17,93%	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	19,25%	-	-	-	-
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	11,84%
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	12,62%
Klasse E Thes.	29,77%	-	35,81%	38,69%	20,16%	23,27%	-	-	20,16%
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	29,05%	-	13,75%	-	-	-	13,59%
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	24,23%	-	30,10%	-	14,85%	17,00%	-	-	14,28%
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	32,50%	-	17,40%	-	-	-	16,83%
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	31,26%	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	27,01%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	11,76%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	5,09%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	6,00%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	11,76%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	10,49%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	-	17,18%	-	-	27,77%	-	-	21,01%	-
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	10,19%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	11,21%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	13,11%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	6,35%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	7,32%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-	1,68%	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-	-	(3,96%)	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-	(3,02%)	8,56%	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	13,91%	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	27,04%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-	-	13,30%	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	11,20%	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	16,22%	-

* Bitte beachten Sie, dass der Schroder GAIA Oaktree Credit in der obigen Tabelle nicht aufgeführt wurde, da der Teilfonds zum 31. Dezember 2021 in diesem Zeitraum nicht aktiv war.

Die vergangene Wertentwicklung ist kein Hinweis auf die gegenwärtige oder künftige Wertentwicklung. In diesen Performancedaten wurden keine Provisionen und Kosten berücksichtigt, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen angefallen sind.



EST. 1804

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof,
L-1736 Senningerberg
Grossherzogtum Luxemburg
Tel.: (+352) 341 342 212
Fax: (+352) 341 342 342

GAIA 30. September 2022 CHDE