



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Informe semestral

31 de marzo de 2024

No se admitirán suscripciones sobre la base de informes periódicos. Las suscripciones son válidas solo si se realizan sobre la base del folleto informativo vigente y los últimos Documentos de datos fundamentales para el inversor, acompañados por el último informe anual auditado disponible o el informe semestral no auditado, en caso de publicarse posteriormente. Este informe se basa en el folleto informativo vigente.

El informe anual auditado, el informe semestral no auditado, el folleto informativo vigente y los Estatutos de la Sociedad están disponibles, de forma gratuita, en el domicilio social de la Sociedad, en 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg, Gran Ducado de Luxemburgo.

El presente material no debe divulgarse en ninguna jurisdicción en la que se prohíba por ley ni debe utilizarse en modo alguno que infrinja ninguna ley ni reglamento locales.

Índice

Consejo de Administración	5
Administración	6
Informe de los Consejeros	7
Informe de la Gestora de inversiones	9
Información estadística	10
Balance	18
Cuenta de pérdidas y ganancias	20
Estado de variación patrimonial	22
Distribución sectorial de inversiones	24
Cartera de inversiones	28
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	28
Schroder GAIA BlueTrend	29
Schroder GAIA Cat Bond	30
Schroder GAIA Contour Tech Equity	36
Schroder GAIA Egerton Equity	36
Schroder GAIA Helix	37
Schroder GAIA Oaktree Credit	42
Schroder GAIA SEG US Equity	50
Schroder GAIA Sirios US Equity	51
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	52
Schroder GAIA Wellington Pagosa	53
Notas a los Estados financieros	59
Ratio de gastos totales («TER»)	140
Anexo I – Operaciones de financiación de valores	143

Consejo de Administración

Presidente

- **Eric Bertrand**

Non-Executive Director

Vaults 13-16
Valletta Waterfront
FRN 1914
Malta

Otros Consejeros

- **Carla Bergareche Garcia-Minaur**

Global Head of Wealth, Client Group

Schroder Investment Management (Europe) S.A., Spanish Branch
Pinar 7, 4ª planta, 28006 Madrid
España

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

Independent Director

12, rue de la Sapinière
L-8150 Bridel
Gran Ducado de Luxemburgo

- **Bernard Herman**

Independent Director

BH Consulting S.à.r.l.
26, rue Glesener
L-1630 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

- **Hugh Mullan**

Independent Director

5, rue Höhenhof
L-1736 Senningerberg
Gran Ducado de Luxemburgo

- **Ross Leach**

Specialist Solutions

Schroder Investment Management Limited
One London Wall Place
Londres EC2Y 5AU
Reino Unido

- **Tim Boole**

Head of Product Management Private Equity

Schroders Capital Management (Switzerland) AG
Affolternstrasse 56
8050 Zúrich
Suiza

- **Yves Francis¹**

Independent Director

67 rue du Pannebourg
6700 Arlon
Bélgica

¹ Yves Francis fue nombrado miembro del Consejo de Administración el 28 de marzo de 2024.

Administración

Domicilio social

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg
Gran Ducado de Luxemburgo

Sociedad Gestora, Agente de registro y Agente domiciliario

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg
Gran Ducado de Luxemburgo

Agente de pagos principal, Agente de registro y transferencias

HSBC Continental Europe, Luxembourg

18, Boulevard de Kockelscheuer, L-1821 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Depositario y Agente administrativo

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

80, route d'Esch, L-1470 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Asesor jurídico principal

Arendt & Medernach S.A.

41A, Avenue J.F. Kennedy, L-2082 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Auditor independiente

KPMG Audit S.à r.l.

39, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxemburgo
Gran Ducado de Luxemburgo

Gestoras de inversiones

Contour Asset Management, LLC

99 Park Avenue, Suite 1540, Nueva York, NY 10016
Estados Unidos
Schroder GAIA Contour Tech Equity

Egerton Capital (UK) LLP

Stratton House, 5 Stratton Street, Londres W1J 8LA
Reino Unido
Schroder GAIA Egerton Equity

Egerton Capital (UK) LLP ha designado a la siguiente Subgestora de inversiones para Schroder GAIA Egerton Equity:

- Egerton Capital (US) LP.

Oaktree Capital Management, LP

333 S Grand Ave, 28th Floor, Los Ángeles CA 90071
Estados Unidos
Schroder GAIA Oaktree Credit

Oaktree Capital Management, LP ha designado a la siguiente Subgestora de inversiones para Schroder GAIA Oaktree Credit:

- Oaktree Capital Management (UK) LLP

Schroder Investment Management Limited

One London Wall Place, Londres, EC2Y 5AU
Reino Unido
Schroder GAIA Helix

Schroder Investment Management Limited ha designado a las siguientes Subgestoras de inversiones para Schroder GAIA Helix:

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

Schroder Investment Management (Singapore) Ltd

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

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

Central 2, CH-8001 Zúrich, Suiza
Schroder GAIA Cat Bond

Select Equity Group LP

380 Lafayette Street, Nueva York, NY 10003, Estados Unidos
Schroder GAIA SEG US Equity

Sirios Capital Management LP

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

Systematica Investments Limited

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

Systematica Investments Limited ha designado a las siguientes Subgestoras de inversiones para Schroder GAIA BlueTrend:

- Systematica Investments UK LLP;
- Systematica Investments GP Limited, sucursal en Ginebra;
- Systematica Investments Singapore PTE.

Two Sigma Advisers LP

100 Avenue of the Americas, 16th Floor, Nueva York, NY 10013
Estados Unidos
Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Wellington Management International Limited

Cardinal Place, 80 Victoria Street, Londres SW1E 5JL
Reino Unido
Schroder GAIA Wellington Pagosa

Wellington Management International Limited ha designado a la siguiente Subgestora de inversiones para Schroder GAIA Wellington Pagosa:

- Wellington Management Company LLP.

Informe de los Consejeros

La Sociedad

Schroder GAIA (la «Sociedad») es una sociedad de inversión abierta con responsabilidad limitada y estructura de fondo paraguas. Está organizada como «société anonyme» y cumple los requisitos para ser considerada una «Société d'Investissement à Capital Variable» (SICAV) de conformidad con la Parte I de la Ley de 17 de diciembre de 2010 en su versión vigente. La Sociedad se constituyó el 21 de octubre de 2009 y sus Estatutos se publicaron en el Memorial el 12 de noviembre de 2009 en su versión vigente.

Schroders es una organización que cumple con la ley estadounidense de cumplimiento tributario de cuentas extranjeras (FATCA, por sus siglas en inglés). La clasificación FATCA de esta entidad y su número de identificación de intermediario global (GIIN, por sus siglas en inglés) son los siguientes: clasificación de entidades FATCA: entidad financiera extranjera (FFI, por sus siglas en inglés); entidad patrocinadora: Schroder Investment Management (Europe) S.A. (la «Sociedad Gestora»); GIIN de la entidad patrocinadora: 4RIMT7.00000.SP.442.

Estados financieros

El Consejo de Administración (los «Consejeros») de la Sociedad presenta su informe y los estados financieros del periodo cerrado a 31 de marzo de 2024.

En la fecha del presente informe, había disponibles en la Sociedad once subfondos para la inversión (los «subfondos»). Para obtener información completa sobre los objetivos de inversión de los subfondos, así como sobre los límites de inversión, remítase al folleto informativo vigente. El informe de la Gestora de inversiones para cada uno de los subfondos puede encontrarse en los informes trimestrales de inversión, los cuales pueden obtenerse en el domicilio social de la Sociedad y en el sitio web de la Sociedad Gestora (<http://www.schroders.lu>).

El presente informe abarca el periodo comprendido entre el 1 de octubre de 2023 y el 31 de marzo de 2024. La última fecha de cálculo de los precios fue el 28 de marzo de 2024, último día hábil del periodo analizado. Los estados financieros se preparan de conformidad con los reglamentos luxemburgueses relativos a los organismos de inversión colectiva (OIC).

A 31 de marzo de 2024, el patrimonio neto total de la Sociedad era de 5.357.560.536 EUR frente a los 4.928.621.911 EUR del 30 de septiembre de 2023, lo que representa un aumento del 8,70%.

Responsabilidades de los Consejeros

La responsabilidad del Consejo se rige por la legislación de Luxemburgo. Con respecto a los estados financieros de la Sociedad, el Consejo de Administración debe elaborar estados financieros para cada ejercicio que reflejen fielmente los activos, los pasivos y la situación financiera, así como las ganancias o pérdidas de la Sociedad y de cada uno de sus subfondos durante el ejercicio.

Los Consejeros deben:

- seleccionar políticas contables pertinentes y aplicarlas de manera coherente;
- emitir juicios y realizar estimaciones razonables y prudentes;
- indicar si se han elaborado de conformidad con las normas de contabilidad aplicables, identificar esas normas y dejar constancia del efecto y las razones de cualquier desviación significativa de esas normas; y
- elaborar los estados financieros de conformidad con el principio de empresa en funcionamiento, a menos que no resulte oportuno asumir que los Fondos continuarán en funcionamiento.

Los Consejeros son responsables de garantizar el mantenimiento de registros contables adecuados. A este respecto, han confiado la custodia de los activos de los Fondos a Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. (el «Depositario»). Los Consejeros tienen la responsabilidad de adoptar las medidas que se encuentren a su disposición de forma razonable para prevenir y detectar el fraude, así como otras irregularidades.

Reuniones del Consejo

Durante el periodo comprendido entre el 1 de octubre de 2023 y el 31 de marzo de 2024, el Consejo celebró cuatro reuniones.

Gobierno corporativo

La Sociedad está sujeta a un gobierno corporativo basado en:

1. Sus obligaciones, tal y como se definen en la Directiva 2009/65/CE del 13 de julio de 2009 relativa a OICVM, según su transposición en el derecho luxemburgués, que está disponible para su consulta en el domicilio social de la Sociedad, 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg, Gran Ducado de Luxemburgo.
2. Sus estatutos, que podrán consultarse en el domicilio social de la Sociedad y en el registro mercantil de Luxemburgo, Registre de Commerce et des Sociétés (RCSL).
3. Las obligaciones relativas a la gestión de la Sociedad, respecto de las cuales la Sociedad ha designado a Schroder Investment Management (Europe) S.A., la cual está sujeta a los requisitos de la Directiva 2010/43/CE relativa a las sociedades gestoras y la Directiva 2011/61/UE relativa a los gestores de fondos de inversión alternativos, según su transposición en el derecho luxemburgués.
4. Los principios del código de conducta para fondos de inversión en Luxemburgo de la Asociación Luxemburguesa de Fondos de Inversión (ALFI, por sus siglas en inglés), que la Sociedad ha adoptado voluntariamente.

Sistemas de control interno y de gestión del riesgo

El Consejo de Administración es responsable de establecer y mantener sistemas de control interno y de gestión del riesgo adecuados dentro de la Sociedad en relación con el proceso de información financiera. Dichos sistemas fueron diseñados para gestionar el riesgo de error o fraude en la consecución de los objetivos de información financiera de la Sociedad, más que para eliminarlo, y solamente pueden ofrecer una garantía relativa y no absoluta frente a declaraciones erróneas o pérdidas significativas.

El Consejo de Administración ha acordado con la Sociedad Gestora la puesta en práctica de procedimientos destinados a garantizar que todos los registros contables importantes se lleven de forma adecuada y estén disponibles en cualquier momento, incluida la elaboración de informes anuales. Los informes anuales de la Sociedad requieren la aprobación del Consejo de Administración de la Sociedad, y deberán presentarse ante la Commission de Surveillance du Secteur Financier («CSSF») y ante el Registre de Commerce et des Sociétés («RCSL»). Los estados financieros anuales obligatorios deben estar auditados por auditores independientes, quienes informarán al Consejo de Administración sobre sus hallazgos.

El Consejo se reunirá al menos cuatro veces al año y garantizará que la Sociedad mantenga altos estándares de integridad y control en el marco de sus operaciones y disponga de un gobierno corporativo adecuado, así como de los medios de control que requieran las disposiciones legales y normativas.

Informe de los Consejeros (continuación)

Actividades durante el periodo

1. Nuevas clases de participaciones

Las siguientes clases de participaciones se crearon durante el periodo analizado:

Subfondo y clase de participaciones	Divisa de la clase de participaciones	Divisa base del subfondo	Fecha de lanzamiento
Schroder GAIA Asian Equity Long Short			
Clase E Acum. EUR Cubierta	EUR	USD	6 de diciembre de 2023
Clase E Acum.	USD	USD	6 de diciembre de 2023
Clase IZ Acum. EUR Cubierta	EUR	USD	6 de diciembre de 2023
Clase X1 Acum. EUR Cubierta	EUR	USD	6 de diciembre de 2023
Clase X1 Acum. GBP Cubierta	GBP	USD	6 de diciembre de 2023
Clase X1 Acum. GBP Cubierta	GBP	USD	6 de diciembre de 2023
Clase X1 Acum.	USD	USD	6 de diciembre de 2023
Schroder GAIA Cat Bond			
Clase A Dist.	USD	USD	8 de diciembre de 2023
Clase Y3 Acum.	USD	USD	22 de diciembre de 2023
Clase Y3 Acum. CHF Cubierta	CHF	USD	22 de diciembre de 2023
Clase Y3 Acum. EUR Cubierta	EUR	USD	22 de diciembre de 2023

Acontecimientos significativos durante el periodo

El conflicto entre Rusia y Ucrania aún afecta a la valoración de los valores rusos mantenidos en la Sociedad. El Consejo ha seguido aplicando los principios de valoración adecuados de acuerdo con nuestros procesos de fijación de precios. Al cierre del periodo, los subfondos de Schroder GAIA no mantenían participaciones de activos rusos.

El Consejo de Administración

Schroder GAIA
31 de marzo de 2024

Informe de la Gestora de inversiones

Los subfondos de la gama Schroder GAIA pueden aprovechar las condiciones favorables o desfavorables del mercado mediante exposiciones largas o cortas. En algunas ocasiones, este enfoque puede dar como resultado una rentabilidad muy diversa a corto plazo en relación con los mercados en los que invierten los subfondos.

Análisis económico

El semestre analizado estuvo dominado por la evolución de la inflación y de las expectativas sobre el momento en que los principales bancos centrales podrían empezar a recortar los tipos de interés.

A finales de 2023, los datos sobre la inflación estadounidense, más benignos de lo esperado, reforzaron la opinión del mercado de que la Reserva Federal (Fed) había terminado su ciclo de subidas de tipos y empezaría a dictar recortes en 2024. El presidente de la Fed, Jerome Powell, indicó que el banco central era consciente del riesgo de mantener los tipos en niveles restrictivos durante demasiado tiempo.

Sin embargo, conforme avanzaba 2024, la inflación resultó ser más estable de lo previsto, por lo que los mercados se vieron obligados a retrasar tanto el inicio como la magnitud de los recortes de tipos estadounidenses. Si bien los mercados habían contemplado seis o siete recortes de tipos a finales de año, el «diagrama de puntos» de marzo, en el que se detallan las expectativas de los responsables de las políticas sobre los recortes de tipos, apenas sugirió tres recortes este año.

Esta situación fue parecida tanto en la zona euro como en Reino Unido, con una inflación superior a lo previsto que rebajó las expectativas de una flexibilización de las políticas. No obstante, la nota discordante proviene de Japón. En marzo de 2024, el Banco de Japón revisó sus medidas de política monetaria y no solo puso fin a los tipos negativos, sino que fijó un tipo a corto plazo entre el 0,0% y el 0,1%. Asimismo, abandonó su política de control de la curva de rendimiento. Esta medida se adoptó en respuesta al aumento de la inflación en Japón y a los indicios de que se acordarían salarios más elevados.

En los mercados emergentes, los variados datos económicos de China aún sugerían una recuperación económica exigua de la desaceleración provocada por la COVID-19 en años anteriores, y las medidas de estímulo siguieron siendo limitadas. La actual crisis inmobiliaria continuó afectando a la confianza.

Los riesgos geopolíticos también ocuparon un lugar predominante durante el periodo. Octubre trajo la reanudación de un conflicto en Oriente Medio. Además, los inversores comenzaron a centrarse en las numerosas elecciones que se celebrarían en 2024, en particular, las elecciones presidenciales de Estados Unidos. Donald Trump es el presunto candidato del Partido Republicano, puesto que su principal rival Nikki Haley abandonó la carrera por postularse como candidata en marzo.

Análisis del mercado de renta variable

Los mercados de renta variable mundiales registraron importantes ganancias durante el semestre analizado, a pesar de que la inflación se mantuvo por encima del objetivo y las perspectivas de recortes de tipos fueron alejándose. En su lugar, los inversores se centraron en los datos económicos resilientes, que indicaban que Estados Unidos evitaría una recesión, y la expectativa de que los tipos bajarían en algún momento. El entusiasmo por el potencial de la inteligencia artificial (IA) también favoreció la renta variable.

El índice MSCI World obtuvo una rentabilidad del 21,3% (en dólares estadounidenses) durante el periodo. Las participaciones de EE. UU. lideraron las ganancias, respaldadas por el gran avance de algunas empresas relacionadas con la IA.

En Japón, la renta variable también registró un comportamiento muy positivo: los índices locales por fin pudieron superar el anterior máximo histórico, alcanzado a finales de la década de 1980. El optimismo en torno a la mejora en el rendimiento económico de Japón favoreció la renta variable, al igual que las señales de que las empresas están actuando conforme a la petición de la Bolsa de Tokio de mejorar el valor corporativo.

Los mercados emergentes se quedaron a la zaga de los desarrollados. El índice MSCI EM obtuvo una rentabilidad del 10,4% (en dólares estadounidenses). China fue uno de los menos rentables, mientras que los mercados con mejores resultados fueron Perú, Colombia y Polonia.

Análisis del mercado de renta fija

Los rendimientos de los principales mercados de bonos gubernamentales cayeron bruscamente a finales del año (lo que significa que los precios subieron), ya que la relajación de las presiones inflacionarias convenció a los participantes del mercado de que los tipos de interés habían alcanzado su punto álgido. Sin embargo, desde principios de año, los inversores redujeron sus expectativas en torno a que se produjeran recortes de tipos, lo que se tradujo en un aumento de los rendimientos y una caída de los precios.

El rendimiento del Tesoro estadounidense a 10 años cayó del 4,57% al 4,20% durante el periodo, aunque los sólidos indicadores económicos estadounidenses han acabado con las esperanzas de un recorte inminente de los tipos de interés. Los rendimientos de bonos japoneses a 10 años se contrajeron ligeramente del 0,77% al 0,72%. Aunque el Banco de Japón subió los tipos de interés por primera vez en 17 años, los responsables insistieron en que se mantendría una postura acomodaticia. El rendimiento de los gilts a 10 años cayó del 4,44% al 3,93%, con la entrada en recesión de la economía del Reino Unido durante el segundo semestre de 2023. El rendimiento de los bonos alemanes a 10 años cayó del 2,84% al 2,30% debido a la continua debilidad de los indicadores económicos de la zona euro, mientras que la caída de los precios de la energía apuntó a una menor inflación.

En los mercados de crédito, los diferenciales se estrecharon significativamente tanto en los bonos corporativos estadounidenses como en los europeos, especialmente en los valores de alto rendimiento.

A pesar de recuperarse de un importante descenso hacia finales de 2023, el dólar estadounidense cerró el periodo a la baja.

Perspectivas

Durante el último año, la inflación ha caído bruscamente y prácticamente ha regresado al nivel objetivo de los principales bancos centrales. Paralelamente, los resultados económicos han superado las previsiones, todo ello en un contexto de subidas de tipos de interés mayores de lo que se esperaba hace un año.

Conforme la inflación caía, los bancos centrales comenzaron a cambiar el tono de sus declaraciones. Aumentan las expectativas de que los tipos de interés se reduzcan a lo largo de este año, pero todavía hay dudas sobre cuánta flexibilización seguirá a estas bajadas de tipos. En EE. UU., en concreto, el mercado ha tenido que revisar sus expectativas de recortes inminentes, dada la resiliencia de la economía y la persistencia de la inflación.

Los economistas de Schroders prevén que la Reserva Federal de Estados Unidos no bajará los tipos de interés hasta septiembre. El equilibrio de riesgos se inclina a pocos recortes y más tardíos.

Las Gestoras de inversiones

Schroder GAIA

La información incluida en este informe es histórica y no es necesariamente indicativa de resultados futuros.

Información estadística

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Valor Liquidativo						
a 31 de marzo de 2024	21 812 615	348 672 006	3 114 288 558	187 069 749	459 932 155	282 166 682
Participaciones en circulación*						
a 31 de marzo de 2024						
Clase A Acum.	15	79 092	4994	98 805	224 804	4664
Clase A Acum. CHF Cubierta	-	1488	-	2920	-	100
Clase A Acum. EUR Cubierta	-	281 609	55 180	22 601	-	114 959
Clase A Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	7805	-
Clase A Acum. SEK Cubierta	-	-	100	-	-	77
Clase A Acum. SGD Cubierta	-	-	-	4291	-	140
Clase A Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	305 877	-
Clase A Dist.	-	-	611	-	-	-
Clase A Dist. GBP	-	-	-	-	2378	-
Clase A1 Acum.	-	-	-	3953	7024	-
Clase A1 Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	86 612	-
Clase A2 Acum.	-	-	-	-	-	-
Clase A2 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase A2 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase A2 Dist.	-	-	-	-	-	-
Clase A2 Dist. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase A2 Dist. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase A2 Dist. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase C Acum.	2523	333 632	11 605	549 526	592 387	23 505
Clase C Acum. BRL Cubierta	-	194 396	-	-	-	-
Clase C Acum. CHF Cubierta	-	13 077	1722	18 479	-	7571
Clase C Acum. EUR Cubierta	-	255 054	24 230	290 437	-	30 425
Clase C Acum. GBP Cubierta	-	817 035	76 429	212 130	75 631	82 964
Clase C Acum. SEK Cubierta	-	-	-	63 156	-	11
Clase C Acum. SGD Cubierta	-	-	-	-	-	140
Clase C Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	418 986	-
Clase C Dist.	-	-	-	-	4924	-
Clase C Dist. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase C Dist. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase C Dist. GBP	-	-	-	-	2751	-
Clase C Dist. GBP Cubierta	-	18 984	-	-	-	-
Clase C1 Acum.	-	-	-	-	-	1
Clase C1 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase C1 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase E Acum.	23 697	26 916	-	3743	6	302 086
Clase E Acum. CHF Cubierta	-	-	-	1236	-	603
Clase E Acum. EUR	15	-	-	-	-	-
Clase E Acum. EUR Cubierta	-	5000	-	19 338	-	974 267
Clase E Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	149 482
Clase E Acum. SEK Cubierta	-	-	-	193	-	-
Clase E Dist.	-	-	-	-	-	-
Clase E Dist. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase E Dist. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase E Dist. GBP Cubierta	-	119 659	-	-	-	-
Clase F Acum.	-	-	10 184	-	-	-
Clase F Acum. Cubierta en CHF	-	-	1157	-	-	-
Clase F Acum. Cubierta en EUR	-	-	5502	-	-	-
Clase F Dist.	-	-	286	-	-	-
Clase F Dist. Cubierta en SGD	-	-	440	-	-	-
Clase I Acum.	100 015	-	226 714	-	-	112 850
Clase I Acum. CHF Cubierta	-	-	28 230	-	-	-
Clase I Acum. EUR Cubierta	-	-	12 670	-	-	-
Clase I Acum. JPY Cubierta	-	-	120	-	-	103
Clase IF Acum.	-	-	149 139	-	-	-
Clase IF Acum. CHF Cubierta	-	-	90 722	-	-	-
Clase IF Acum. EUR Cubierta	-	-	455 871	-	-	-
Clase IF Acum. SEK Cubierta	-	-	7 835 656	-	-	-
Clase IF Dist.	-	-	14 248	-	-	-
Clase IZ Acum.	15	-	-	-	-	-

* Consulte las normas de denominación de las clases de participaciones en el epígrafe "Clases de Participaciones" de las Notas a los Estados financieros.

Información estadística (continuación)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Participaciones en circulación* (continuación)						
a 31 de marzo de 2024						
Clase IZ Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase IZ Acum. EUR	15	-	-	-	-	-
Clase IZ Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase IZ Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	92
Clase K Acum.	-	-	-	-	-	-
Clase K Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase K Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase K Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase N Acum. EUR Cubierta	-	244 400	-	-	-	-
Clase N Acum. GBP Cubierta	-	32 061	-	-	-	-
Clase N Acum. SEK Cubierta	-	45 065	-	-	-	-
Clase PI Acum. CHF Cubierta	-	-	27 390	-	-	-
Clase PI Acum. EUR Cubierta	-	-	50 755	-	-	-
Clase PI Dist.	-	-	63 808	-	-	-
Clase PI Dist. GBP Cubierta	-	-	277 397	-	-	-
Clase R1 Acum.	-	-	-	-	-	-
Clase R1 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R2 Acum.	-	-	-	-	-	-
Clase R2 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R2 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R2 Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R3 Acum.	-	-	-	-	-	-
Clase R3 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R3 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R3 Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R4 Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R5 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase S Dist.	-	-	-	-	-	15
Clase S Dist. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	104
Clase S Dist. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	1615
Clase X Acum.	-	-	-	-	7	-
Clase X Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	577 655
Clase X1 Acum.	11 855	-	-	-	-	-
Clase X1 Acum. EUR	163	-	-	-	-	-
Clase X1 Acum. GBP	2005	-	-	-	-	-
Clase X1 Acum. GBP Cubierta	46 423	-	-	-	-	-
Clase Y Acum.	-	-	13 103	-	-	-
Clase Y Acum. CHF Cubierta	-	-	552	-	-	-
Clase Y Acum. EUR Cubierta	-	-	387	-	-	-
Clase Y1 Acum.	-	-	113	-	-	-
Clase Y1 Acum. CHF Cubierta	-	-	29	-	-	-
Clase Y1 Acum. EUR Cubierta	-	-	10	-	-	-
Clase Y2 Acum.	-	-	22 665	-	-	-
Clase Y2 Acum. CHF Cubierta	-	-	71 065	-	-	-
Clase Y2 Acum. EUR Cubierta	-	-	40 828	-	-	-
Clase Y2 Acum. GBP Cubierta	-	-	250	-	-	-
Clase Y3 Acum.	-	-	72 452	-	-	-
Clase Y3 Acum. CHF Cubierta	-	-	4140	-	-	-
Clase Y3 Acum. EUR Cubierta	-	-	7402	-	-	-

* Consulte las normas de denominación de las clases de participaciones en el epígrafe "Clases de Participaciones" de las Notas a los Estados financieros.

Información estadística (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Valor Liquidativo					
a 31 de marzo de 2024	75 757 984	362 323 747	188 839 621	384 635 318	318 239 997
Participaciones en circulación*					
a 31 de marzo de 2024					
Clase A Acum.	-	-	528 402	-	94 816
Clase A Acum. CHF Cubierta	-	-	2296	-	6812
Clase A Acum. EUR Cubierta	-	-	60 255	-	139 824
Clase A Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase A Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase A Acum. SGD Cubierta	-	-	-	-	16 695
Clase A Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase A Dist.	-	-	-	-	-
Clase A Dist. GBP	-	-	-	-	-
Clase A1 Acum.	-	-	-	-	-
Clase A1 Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase A2 Acum.	8482	-	-	-	-
Clase A2 Acum. CHF Cubierta	100	-	-	-	-
Clase A2 Acum. EUR Cubierta	100	-	-	-	-
Clase A2 Dist.	16	-	-	-	-
Clase A2 Dist. CHF Cubierta	108	-	-	-	-
Clase A2 Dist. EUR Cubierta	108	-	-	-	-
Clase A2 Dist. GBP Cubierta	109	-	-	-	-
Clase C Acum.	478	16 937	302 099	1 228 855	1 132 656
Clase C Acum. BRL Cubierta	-	-	-	-	81 467
Clase C Acum. CHF Cubierta	821	625	9488	20 874	81 606
Clase C Acum. EUR Cubierta	1144	15 822	78 149	506 547	383 869
Clase C Acum. GBP Cubierta	100	43 401	22 614	390 788	513 141
Clase C Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase C Acum. SGD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase C Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase C Dist.	16	-	-	-	-
Clase C Dist. CHF Cubierta	109	-	-	-	-
Clase C Dist. EUR Cubierta	109	-	-	-	-
Clase C Dist. GBP	-	-	-	-	-
Clase C Dist. GBP Cubierta	109	-	398	-	-
Clase C1 Acum.	-	-	-	-	-
Clase C1 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	45
Clase C1 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	108
Clase E Acum.	317 793	-	170	-	32 818
Clase E Acum. CHF Cubierta	100	-	-	-	7879
Clase E Acum. EUR	-	-	-	-	-
Clase E Acum. EUR Cubierta	131 740	-	5229	-	95 281
Clase E Acum. GBP Cubierta	659	-	-	-	46 499
Clase E Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase E Dist.	17	-	-	-	-
Clase E Dist. CHF Cubierta	110	-	-	-	-
Clase E Dist. EUR Cubierta	109	-	-	-	-
Clase E Dist. GBP Cubierta	17 336	-	-	-	-
Clase F Acum.	-	-	-	-	-
Clase F Acum. Cubierta en CHF	-	-	-	-	-
Clase F Acum. Cubierta en EUR	-	-	-	-	-
Clase F Dist.	-	-	-	-	-
Clase F Dist. Cubierta en SGD	-	-	-	-	-
Clase I Acum.	200 015	-	-	-	-
Clase I Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase I Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase I Acum. JPY Cubierta	-	-	-	-	-
Clase IF Acum.	-	-	-	-	-
Clase IF Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase IF Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase IF Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase IF Dist.	-	-	-	-	-
Clase IZ Acum.	-	15 188	-	-	-

* Consulte las normas de denominación de las clases de participaciones en el epígrafe "Clases de Participaciones" de las Notas a los Estados financieros.

Información estadística (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Participaciones en circulación* (continuación)					
a 31 de marzo de 2024					
Clase IZ Acum. CHF Cubierta	-	901	-	-	-
Clase IZ Acum. EUR	-	-	-	-	-
Clase IZ Acum. EUR Cubierta	-	21 243	-	-	-
Clase IZ Acum. GBP Cubierta	-	100	-	-	-
Clase K Acum.	-	15	-	362 323	-
Clase K Acum. CHF Cubierta	-	100	-	590	-
Clase K Acum. EUR Cubierta	-	100	-	41 263	-
Clase K Acum. GBP Cubierta	-	100	-	-	-
Clase N Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase N Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase N Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase PI Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase PI Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase PI Dist.	-	-	-	-	-
Clase PI Dist. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase R1 Acum.	-	44 027	-	-	-
Clase R1 Acum. EUR Cubierta	-	40 583	-	-	-
Clase R2 Acum.	-	297 576	-	-	-
Clase R2 Acum. CHF Cubierta	-	15 870	-	-	-
Clase R2 Acum. EUR Cubierta	-	556 319	-	-	-
Clase R2 Acum. GBP Cubierta	-	10 057	-	-	-
Clase R3 Acum.	-	308 212	-	-	-
Clase R3 Acum. CHF Cubierta	-	200	-	-	-
Clase R3 Acum. EUR Cubierta	-	236 690	-	-	-
Clase R3 Acum. GBP Cubierta	-	37 761	-	-	-
Clase R4 Acum. GBP Cubierta	-	2631	-	-	-
Clase R5 Acum. EUR Cubierta	-	3198	-	-	-
Clase S Dist.	-	-	-	-	-
Clase S Dist. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase S Dist. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase X Acum.	-	-	15	-	-
Clase X Acum. EUR Cubierta	-	-	68	-	-
Clase X1 Acum.	-	-	-	-	-
Clase X1 Acum. EUR	-	-	-	-	-
Clase X1 Acum. GBP	-	-	-	-	-
Clase X1 Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y Acum.	-	-	-	-	-
Clase Y Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y1 Acum.	-	-	-	-	-
Clase Y1 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y1 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y2 Acum.	-	-	-	-	-
Clase Y2 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y2 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y2 Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y3 Acum.	-	-	-	-	-
Clase Y3 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y3 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-

* Consulte las normas de denominación de las clases de participaciones en el epígrafe "Clases de Participaciones" de las Notas a los Estados financieros.

Información estadística (continuación)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Valor liquidativo por participación*						
a 31 de marzo de 2024						
Clase A Acum.	109,95	126,74	1 703,12	142,93	254,01	108,48
Clase A Acum. CHF Cubierta	-	104,81	-	123,59	-	95,13
Clase A Acum. EUR Cubierta	-	110,79	1 108,89	128,95	-	98,52
Clase A Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	245,16	-
Clase A Acum. SEK Cubierta	-	-	1 022,73	-	-	819,78
Clase A Acum. SGD Cubierta	-	-	-	192,40	-	105,50
Clase A Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	264,80	-
Clase A Dist.	-	-	1 011,83	-	-	-
Clase A Dist. GBP	-	-	-	-	241,98	-
Clase A1 Acum.	-	-	-	141,31	235,82	-
Clase A1 Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	252,49	-
Clase A2 Acum.	-	-	-	-	-	-
Clase A2 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase A2 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase A2 Dist.	-	-	-	-	-	-
Clase A2 Dist. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase A2 Dist. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase A2 Dist. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase C Acum.	110,85	131,93	1 730,70	149,95	277,90	114,28
Clase C Acum. BRL Cubierta	-	166,08	-	-	-	-
Clase C Acum. CHF Cubierta	-	109,51	1 257,16	131,41	-	100,65
Clase C Acum. EUR Cubierta	-	114,73	1 367,14	134,90	-	103,96
Clase C Acum. GBP Cubierta	-	125,98	121,98	114,28	265,95	110,20
Clase C Acum. SEK Cubierta	-	-	-	1 126,43	-	852,49
Clase C Acum. SGD Cubierta	-	-	-	-	-	110,88
Clase C Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	289,79	-
Clase C Dist.	-	-	-	-	276,39	-
Clase C Dist. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase C Dist. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase C Dist. GBP	-	-	-	-	264,10	-
Clase C Dist. GBP Cubierta	-	123,90	-	-	-	-
Clase C1 Acum.	-	-	-	-	-	5 671,50
Clase C1 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase C1 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase E Acum.	103,19	135,50	-	152,15	275,66	117,53
Clase E Acum. CHF Cubierta	-	-	-	132,42	-	103,14
Clase E Acum. EUR	103,01	-	-	-	-	-
Clase E Acum. EUR Cubierta	-	117,50	-	136,77	-	107,14
Clase E Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	113,37
Clase E Acum. SEK Cubierta	-	-	-	1 131,82	-	-
Clase E Dist.	-	-	-	-	-	-
Clase E Dist. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase E Dist. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase E Dist. GBP Cubierta	-	127,24	-	-	-	-
Clase F Acum.	-	-	1 704,23	-	-	-
Clase F Acum. Cubierta en CHF	-	-	1 242,03	-	-	-
Clase F Acum. Cubierta en EUR	-	-	1 346,52	-	-	-
Clase F Dist.	-	-	1 165,56	-	-	-
Clase F Dist. Cubierta en SGD	-	-	1 526,64	-	-	-
Clase I Acum.	115,26	-	2 009,89	-	-	125,26
Clase I Acum. CHF Cubierta	-	-	1 573,43	-	-	-
Clase I Acum. EUR Cubierta	-	-	1 714,00	-	-	-
Clase I Acum. JPY Cubierta	-	-	11 707,54	-	-	11 715,26
Clase IF Acum.	-	-	1 777,13	-	-	-
Clase IF Acum. CHF Cubierta	-	-	1 390,93	-	-	-
Clase IF Acum. EUR Cubierta	-	-	1 514,21	-	-	-
Clase IF Acum. SEK Cubierta	-	-	1 045,10	-	-	-
Clase IF Dist.	-	-	1 388,76	-	-	-
Clase IZ Acum.	111,17	-	-	-	-	-

* El Valor liquidativo por Participación de cada clase de participaciones se expresa en la divisa de la misma.

Información estadística (continuación)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Valor liquidativo por participación* (continuación)						
a 31 de marzo de 2024						
Clase IZ Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase IZ Acum. EUR	103,01	-	-	-	-	-
Clase IZ Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase IZ Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	111,01
Clase K Acum.	-	-	-	-	-	-
Clase K Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase K Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase K Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase N Acum. EUR Cubierta	-	113,86	-	-	-	-
Clase N Acum. GBP Cubierta	-	129,27	-	-	-	-
Clase N Acum. SEK Cubierta	-	885,71	-	-	-	-
Clase PI Acum. CHF Cubierta	-	-	1 098,15	-	-	-
Clase PI Acum. EUR Cubierta	-	-	1 130,43	-	-	-
Clase PI Dist.	-	-	1 066,84	-	-	-
Clase PI Dist. GBP Cubierta	-	-	105,93	-	-	-
Clase R1 Acum.	-	-	-	-	-	-
Clase R1 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R2 Acum.	-	-	-	-	-	-
Clase R2 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R2 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R2 Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R3 Acum.	-	-	-	-	-	-
Clase R3 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R3 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R3 Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R4 Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase R5 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	-
Clase S Dist.	-	-	-	-	-	106,41
Clase S Dist. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	96,17
Clase S Dist. GBP Cubierta	-	-	-	-	-	101,72
Clase X Acum.	-	-	-	-	276,63	-
Clase X Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-	107,06
Clase X1 Acum.	103,36	-	-	-	-	-
Clase X1 Acum. EUR	103,17	-	-	-	-	-
Clase X1 Acum. GBP	102,82	-	-	-	-	-
Clase X1 Acum. GBP Cubierta	103,25	-	-	-	-	-
Clase Y Acum.	-	-	1 179,56	-	-	-
Clase Y Acum. CHF Cubierta	-	-	1 100,43	-	-	-
Clase Y Acum. EUR Cubierta	-	-	1 135,87	-	-	-
Clase Y1 Acum.	-	-	1 171,82	-	-	-
Clase Y1 Acum. CHF Cubierta	-	-	1 092,21	-	-	-
Clase Y1 Acum. EUR Cubierta	-	-	1 127,33	-	-	-
Clase Y2 Acum.	-	-	1 238,56	-	-	-
Clase Y2 Acum. CHF Cubierta	-	-	1 171,01	-	-	-
Clase Y2 Acum. EUR Cubierta	-	-	1 203,69	-	-	-
Clase Y2 Acum. GBP Cubierta	-	-	122,81	-	-	-
Clase Y3 Acum.	-	-	1 034,96	-	-	-
Clase Y3 Acum. CHF Cubierta	-	-	1 023,74	-	-	-
Clase Y3 Acum. EUR Cubierta	-	-	1 030,95	-	-	-

* El Valor liquidativo por Participación de cada clase de participaciones se expresa en la divisa de la misma.

Información estadística (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Valor liquidativo por participación*					
a 31 de marzo de 2024					
Clase A Acum.	-	-	183,44	-	117,31
Clase A Acum. CHF Cubierta	-	-	202,95	-	100,42
Clase A Acum. EUR Cubierta	-	-	156,78	-	104,40
Clase A Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase A Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase A Acum. SGD Cubierta	-	-	-	-	158,23
Clase A Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase A Dist.	-	-	-	-	-
Clase A Dist. GBP	-	-	-	-	-
Clase A1 Acum.	-	-	-	-	-
Clase A1 Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase A2 Acum.	108,41	-	-	-	-
Clase A2 Acum. CHF Cubierta	99,04	-	-	-	-
Clase A2 Acum. EUR Cubierta	102,15	-	-	-	-
Clase A2 Dist.	104,29	-	-	-	-
Clase A2 Dist. CHF Cubierta	97,18	-	-	-	-
Clase A2 Dist. EUR Cubierta	106,23	-	-	-	-
Clase A2 Dist. GBP Cubierta	102,84	-	-	-	-
Clase C Acum.	109,35	119,79	194,34	148,41	121,84
Clase C Acum. BRL Cubierta	-	-	-	-	161,54
Clase C Acum. CHF Cubierta	100,44	115,81	212,63	126,43	104,60
Clase C Acum. EUR Cubierta	103,63	117,99	166,11	132,00	108,47
Clase C Acum. GBP Cubierta	107,58	118,95	178,39	140,61	92,62
Clase C Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase C Acum. SGD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase C Acum. USD Cubierta	-	-	-	-	-
Clase C Dist.	104,40	-	-	-	-
Clase C Dist. CHF Cubierta	97,34	-	-	-	-
Clase C Dist. EUR Cubierta	106,41	-	-	-	-
Clase C Dist. GBP	-	-	-	-	-
Clase C Dist. GBP Cubierta	102,99	-	178,37	-	-
Clase C1 Acum.	-	-	-	-	-
Clase C1 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	5 218,12
Clase C1 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	5 441,64
Clase E Acum.	109,67	-	211,06	-	126,12
Clase E Acum. CHF Cubierta	100,88	-	-	-	107,94
Clase E Acum. EUR	-	-	-	-	-
Clase E Acum. EUR Cubierta	104,12	-	180,46	-	112,15
Clase E Acum. GBP Cubierta	108,02	-	-	-	95,75
Clase E Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase E Dist.	104,46	-	-	-	-
Clase E Dist. CHF Cubierta	97,38	-	-	-	-
Clase E Dist. EUR Cubierta	106,45	-	-	-	-
Clase E Dist. GBP Cubierta	103,06	-	-	-	-
Clase F Acum.	-	-	-	-	-
Clase F Acum. Cubierta en CHF	-	-	-	-	-
Clase F Acum. Cubierta en EUR	-	-	-	-	-
Clase F Dist.	-	-	-	-	-
Clase F Dist. Cubierta en SGD	-	-	-	-	-
Clase I Acum.	112,10	-	-	-	-
Clase I Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase I Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase I Acum. JPY Cubierta	-	-	-	-	-
Clase IF Acum.	-	-	-	-	-
Clase IF Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase IF Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase IF Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase IF Dist.	-	-	-	-	-
Clase IZ Acum.	-	118,77	-	-	-

* El Valor liquidativo por Participación de cada clase de participaciones se expresa en la divisa de la misma.

Información estadística (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Valor liquidativo por participación* (continuación)					
a 31 de marzo de 2024					
Clase IZ Acum. CHF Cubierta	-	115,64	-	-	-
Clase IZ Acum. EUR	-	-	-	-	-
Clase IZ Acum. EUR Cubierta	-	118,14	-	-	-
Clase IZ Acum. GBP Cubierta	-	118,18	-	-	-
Clase K Acum.	-	118,19	-	143,73	-
Clase K Acum. CHF Cubierta	-	115,13	-	122,50	-
Clase K Acum. EUR Cubierta	-	116,68	-	127,70	-
Clase K Acum. GBP Cubierta	-	117,64	-	-	-
Clase N Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase N Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase N Acum. SEK Cubierta	-	-	-	-	-
Clase PI Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase PI Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase PI Dist.	-	-	-	-	-
Clase PI Dist. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase R1 Acum.	-	180,51	-	-	-
Clase R1 Acum. EUR Cubierta	-	154,10	-	-	-
Clase R2 Acum.	-	176,99	-	-	-
Clase R2 Acum. CHF Cubierta	-	138,55	-	-	-
Clase R2 Acum. EUR Cubierta	-	182,66	-	-	-
Clase R2 Acum. GBP Cubierta	-	146,63	-	-	-
Clase R3 Acum.	-	282,13	-	-	-
Clase R3 Acum. CHF Cubierta	-	105,08	-	-	-
Clase R3 Acum. EUR Cubierta	-	246,95	-	-	-
Clase R3 Acum. GBP Cubierta	-	187,70	-	-	-
Clase R4 Acum. GBP Cubierta	-	129,62	-	-	-
Clase R5 Acum. EUR Cubierta	-	1 824,23	-	-	-
Clase S Dist.	-	-	-	-	-
Clase S Dist. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase S Dist. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase X Acum.	-	-	128,94	-	-
Clase X Acum. EUR Cubierta	-	-	176,16	-	-
Clase X1 Acum.	-	-	-	-	-
Clase X1 Acum. EUR	-	-	-	-	-
Clase X1 Acum. GBP	-	-	-	-	-
Clase X1 Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y Acum.	-	-	-	-	-
Clase Y Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y1 Acum.	-	-	-	-	-
Clase Y1 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y1 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y2 Acum.	-	-	-	-	-
Clase Y2 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y2 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y2 Acum. GBP Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y3 Acum.	-	-	-	-	-
Clase Y3 Acum. CHF Cubierta	-	-	-	-	-
Clase Y3 Acum. EUR Cubierta	-	-	-	-	-

* El Valor liquidativo por Participación de cada clase de participaciones se expresa en la divisa de la misma.

Balance a 31 de marzo de 2024

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
ACTIVOS						
Inversiones						
Valores al coste	18 425 675	253 586 230	2 892 002 476	141 096 161	304 576 093	219 816 078
Plusvalía/(minusvalía) latente	1 972 725	(7 948 006)	(31 318 900)	30 675 976	92 256 391	26 920 448
Valores al valor de mercado	20 398 400	245 638 224	2 860 683 576	171 772 137	396 832 484	246 736 526
Plusvalía/(minusvalía) latente neta						
sobre contratos de divisas a plazo	(196 956)	1 452 002	(37 936 315)	(1 162 015)	(235 662)	(5 183 874)
sobre operaciones al contado	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de futuros	-	3 557 178	-	-	-	(745 133)
sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio	-	16 125 871	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de divisas cruzadas	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de tasas de inflación	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de tipos de interés	-	(2 153 945)	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de rentabilidad total	-	-	-	-	14 316 604	(6 214 363)
sobre contratos por diferencias	(463 498)	1 605 706	-	(3 234 015)	-	8 614 601
	(660 454)	20 586 812	(37 936 315)	(4 396 030)	14 080 942	(3 528 769)
Cuentas por cobrar en valores vendidos	1 658 527	219 722	76 357 454	4 494 524	5 291 471	11 573 511
Tesorería en bancos	1 771 571	33 403 460	224 482 051	13 262 930	44 820 995	31 467 187
Depósitos a plazo	-	-	-	-	-	-
Cuenta de margen del agente por cobrar	-	16 740 479	-	-	-	3 333 971
Garantía por cobrar por garantía pagada	4279	32 466 871	22 860 000	6 987 159	19 281 859	5 952 849
Cuentas por cobrar en suscripciones	-	602 378	-	24 806	7 348 660	454 399
Opciones y swaptions a valor de mercado	-	-	-	56 238	-	366 905
Dividendos e intereses por cobrar	147 888	1 094 893	39 262 852	287 300	1 254 691	4 912 154
Reembolso de fondos por cobrar	-	358 944	34 219	-	-	14 027
Garantías por cobrar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas netas	10 000	270 000	8 209 610	160 000	-	279 661
Garantías por cobrar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas	-	30 000	390	-	270 000	339
Otras cuentas por cobrar*	43 936	1 273 927	-	280 326	-	1 088 572
TOTAL ACTIVOS	23 374 147	352 685 710	3 193 953 837	192 929 390	489 181 102	302 651 332
PASIVOS						
Cuentas por pagar en valores comprados	1 486 705	211 492	55 516 026	478 588	6 534 957	16 917 268
Cuentas por pagar en reembolsos	266	2 925 519	-	1 529 337	10 825 938	2 792 602
Comisiones de gestión por pagar	6525	282 338	1 849 721	190 677	518 929	163 417
Comisiones de rentabilidad por pagar	28 014	32 578	801 484	3 230 004	9 737 787	-
Dividendos e intereses por pagar	21 372	56 081	-	157 408	60 029	215 148
Cuenta de margen del agente por pagar	-	-	-	-	-	-
Garantía por pagar por garantía recibida	-	-	-	-	-	-
Garantías por pagar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas netas	-	-	-	-	270 000	-
Garantías por pagar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas	10 000	300 000	8 210 000	160 000	-	280 000
Otras cuentas por pagar y devengos**	8650	205 696	13 288 048	113 627	1 301 307	116 215
TOTAL PASIVOS	1 561 532	4 013 704	79 665 279	5 859 641	29 248 947	20 484 650
TOTAL PATRIMONIO NETO	21 812 615	348 672 006	3 114 288 558	187 069 749	459 932 155	282 166 682

* Otras cuentas por cobrar incluye cuentas por cobrar de operaciones de divisas al contado y cuentas por cobrar varias.

** Otras cuentas por pagar y devengos incluye las cuentas por pagar de operaciones de divisas al contado y las cuentas por pagar de administración, custodia y otras comisiones.

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Balance

a 31 de marzo de 2024 (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Total* EUR
ACTIVOS						
Inversiones						
Valores al coste	72 915 147	269 493 094	142 960 612	5 164 828	256 791 593	4 264 581 633
Plusvalía/(minusvalía) latente	632 939	44 555 150	30 394 669	(49 887)	13 052 758	193 185 970
Valores al valor de mercado	73 548 086	314 048 244	173 355 281	5 114 941	269 844 351	4 457 767 603
Plusvalía/(minusvalía) latente neta						
sobre contratos de divisas a plazo	218 447	(2 436 701)	(130 000)	(1 839 052)	(1 812 359)	(45 679 258)
sobre operaciones al contado	-	-	-	(6 722)	-	(6 231)
sobre contratos de futuros	(8 252)	-	-	298 496	(88 326)	2 793 681
sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio	-	-	-	-	(20 506)	(19 007)
sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio	-	-	-	19 872	(76 256)	14 895 015
sobre contratos de swaps de divisas cruzadas	-	-	-	-	17 580	16 295
sobre contratos de swaps de tasas de inflación	-	-	-	-	(222 717)	(206 439)
sobre contratos de swaps de tipos de interés	-	-	-	-	(358 791)	(2 329 087)
sobre contratos de swaps de rentabilidad total	-	-	(571 448)	4 972 679	(1 335 140)	11 398 430
sobre contratos por diferencias	-	10 708 847	-	-	-	15 972 231
	210 195	8 272 146	(701 448)	3 445 273	(3 896 515)	(3 164 370)
Cuentas por cobrar en valores vendidos	332 683	4 873 321	2 342 656	241 970 034	16 684 955	339 450 430
Tesorería en bancos	1 324 579	38 247 574	21 944 335	129 400 181	53 064 627	553 110 846
Depósitos a plazo	-	-	-	240 837 000	-	223 234 930
Cuenta de margen del agente por cobrar	-	-	-	17 090 025	7 609 156	41 501 258
Garantía por cobrar por garantía pagada	390 512	1 284 174	-	5 558 715	12 933 680	101 256 407
Cuentas por cobrar en suscripciones	36 681	156 614	702 964	2 248 534	637 706	11 857 241
Opciones y swaptions a valor de mercado	-	6 738 956	-	-	1 504 070	8 032 784
Dividendos e intereses por cobrar	1 137 633	781 363	134 286	90 560	1 653 545	47 139 174
Reembolso de fondos por cobrar	-	32 995	-	-	-	408 013
Garantías por cobrar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas netas	30 000	280 000	60 000	190 000	260 000	9 036 725
Garantías por cobrar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas	-	-	-	-	10 000	307 752
Otras cuentas por cobrar**	77 780	940 484	69 324	765 005	666 165	4 825 062
TOTAL ACTIVOS	77 088 149	375 655 871	197 907 398	646 710 268	360 971 740	5 794 763 855
PASIVOS						
Cuentas por pagar en valores comprados	1 233 675	7 646 041	1 106 350	240 837 000	15 912 241	322 932 410
Cuentas por pagar en reembolsos	11 864	677 040	2 083 612	8 363 527	24 531 138	50 604 318
Comisiones de gestión por pagar	24 918	356 643	239 328	437 334	336 160	4 121 896
Comisiones de rentabilidad por pagar	-	3 741 533	4 047 509	9 569 066	-	29 620 244
Dividendos e intereses por pagar	-	481 946	129 516	2 165 537	1 498 644	4 440 297
Cuenta de margen del agente por pagar	9	-	-	-	-	8
Garantía por pagar por garantía recibida	-	-	1 290 000	-	-	1 195 718
Garantías por pagar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas netas	-	-	-	-	-	270 000
Garantías por pagar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas	30 000	280 000	60 000	190 000	270 000	9 074 478
Otras cuentas por pagar y devengos***	29 699	148 921	111 462	512 486	183 560	14 943 950
TOTAL PASIVOS	1 330 165	13 332 124	9 067 777	262 074 950	42 731 743	437 203 319
TOTAL PATRIMONIO NETO	75 757 984	362 323 747	188 839 621	384 635 318	318 239 997	5 357 560 536

* Para la totalidad del balance, que se ha presentado en euros, los activos y pasivos expresados en divisas distintas del euro se han convertido al siguiente tipo de cambio vigente a 28 de marzo de 2024: 1 euro = 1,07885 dólares estadounidenses.

** Otras cuentas por cobrar incluye las cuentas por cobrar de operaciones de divisas al contado y cuentas por cobrar varias.

*** Otras cuentas por pagar y devengos incluye las cuentas por pagar de operaciones de divisas al contado y las cuentas por pagar de administración, custodia y otras comisiones.

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cuenta de pérdidas y ganancias del periodo cerrado a 31 de marzo de 2024

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
INGRESOS						
Dividendos netos [^]	166 347	74 534	-	-	1 286 984	6 020 901
Intereses sobre bonos	-	701 656	137 792 979	-	-	348 695
Ingresos netos sobre swaps	187 861	2 568 683	-	3 241 016	465 676	2 156 441
Intereses bancarios	20 434	2 124 479	6 319 484	737 060	1 236 534	940 946
Otros ingresos	-	83	-	-	98	134
TOTAL INGRESOS	374 642	5 469 435	144 112 463	3 978 076	2 989 292	9 467 117
GASTOS						
Comisiones de rentabilidad	28 014	32 578	801 483	3 230 004	9 737 787	-
Comisiones de gestión	15 956	1 864 762	11 664 761	1 171 891	3 082 851	1 074 412
Gastos de dividendos netos [^]	-	-	-	747 560	-	-
Gastos netos sobre swaps	-	-	-	-	-	-
Comisiones del depositario	3324	124 884	373 241	24 988	60 151	49 359
Comisiones de administración	7681	558 756	2 096 645	281 056	657 543	183 361
Taxe d'abonnement	1086	86 026	209 796	45 369	106 394	51 837
Comisiones de distribución	-	-	-	2454	49 062	-
Gastos bancarios y de intereses	975	2293	4028	53	604	2909
Otros gastos	1982	158 321	463 214	46 362	662 257	85 733
TOTAL GASTOS	59 018	2 827 620	15 613 168	5 549 737	14 356 649	1 447 611
Menos: Subsidio de gastos	-	112 448	18 829	-	-	11 544
INGRESOS/(PÉRDIDAS) NETOS DE INVERSIÓN	315 624	2 754 263	128 518 124	(1 571 661)	(11 367 357)	8 031 050

[^] Incluye dividendos recibidos/pagados vinculados a derivados con renta variable subyacente.

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cuenta de pérdidas y ganancias del periodo cerrado a 31 de marzo de 2024 (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Total* EUR
INGRESOS						
Dividendos netos [^]	24 610	28 375	239 023	128 984	-	7 481 334
Intereses sobre bonos	2 578 238	-	50 112	5 808 110	608 309	137 079 392
Ingresos netos sobre swaps	-	98 147	485 088	-	187 096	8 737 755
Intereses bancarios	107 138	951 231	475 564	3 629 944	1 122 761	16 464 825
Otros ingresos	40 192	-	29	-	272	37 832
TOTAL INGRESOS	2 750 178	1 077 753	1 249 816	9 567 038	1 918 438	169 801 138
GASTOS						
Comisiones de rentabilidad	-	3 741 533	4 047 509	9 569 066	-	29 620 243
Comisiones de gestión	171 401	2 141 516	1 459 445	2 807 760	2 458 551	26 098 521
Gastos de dividendos netos [^]	-	-	-	-	54 602	743 534
Gastos netos sobre swaps	-	-	-	9 775 908	-	9 061 416
Comisiones del depositario	17 823	42 623	28 567	52 972	71 556	791 798
Comisiones de administración	57 832	243 342	280 824	589 063	617 830	5 214 608
Taxe d'abonnement	14 096	53 713	45 070	89 686	84 565	737 848
Comisiones de distribución	-	-	-	-	-	51 337
Gastos bancarios y de intereses	60 486	-	-	-	23 635	88 085
Otros gastos	14 607	76 242	38 414	93 386	278 659	1 827 312
TOTAL GASTOS	336 245	6 298 969	5 899 829	22 977 841	3 589 398	74 234 702
Menos: Subsidio de gastos	-	20 699	-	-	-	151 569
INGRESOS/(PÉRDIDAS) NETOS DE INVERSIÓN	2 413 933	(5 200 517)	(4 650 013)	(13 410 803)	(1 670 960)	95 718 005

* En toda la Cuenta de pérdidas y ganancias, que se ha presentado en euros, el activo y el pasivo expresados en divisas distintas del euro se han convertido según los siguientes tipos de cambio, a 28 de marzo de 2024: 1 euro = 1,07885 dólares estadounidenses.

[^] Incluye dividendos recibidos/pagados vinculados a derivados con renta variable subyacente.

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Estado de variación patrimonial del periodo cerrado a 31 de marzo de 2024

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
INGRESOS/(PÉRDIDAS) NETOS DE INVERSIÓN*	315 624	2 754 263	128 518 124	(1 571 661)	(11 367 357)	8 031 050
Ganancias/(pérdidas) netas materializadas						
sobre valores vendidos	155 637	(5 134 475)	4 110 299	21 187 309	26 277 177	6 143 411
sobre contratos de divisas a plazo	13 297	73 181	51 993 782	2 699 177	(1 611 423)	5 268 032
sobre operaciones al contado	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de futuros	-	12 609 163	-	-	-	(12 398 982)
sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio	-	(6 073 349)	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de divisas cruzadas	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de tasas de inflación	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de tipos de interés	-	5 845 387	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de rentabilidad total	-	-	-	-	(119 426)	(43 515 242)
sobre contratos por diferencias	(501 754)	-	-	(15 215 768)	-	15 177 064
sobre contratos de opciones y swaptions	-	1 546 589	-	1 092 507	-	(1 092 849)
sobre divisas	(36 570)	(321 964)	(727 023)	22 759	113 751	(1 854 141)
GANANCIAS/(PÉRDIDAS) NETAS MATERIALIZADAS	(369 390)	8 544 532	55 377 058	9 785 984	24 660 079	(32 272 707)
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente						
sobre inversiones	1 870 622	16 134 679	42 914 670	20 285 674	50 156 303	34 033 050
sobre contratos de divisas a plazo	(70 945)	2 918 808	(44 356 662)	(855 574)	2 463 995	(2 194 551)
sobre operaciones al contado	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de futuros	-	(3 978 318)	-	-	-	(3 099 739)
sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio	-	10 365 186	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de divisas cruzadas	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de tasas de inflación	-	-	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de tipos de interés	-	(11 374 410)	-	-	-	-
sobre contratos de swaps de rentabilidad total	-	-	-	-	5 316 260	(15 302 099)
sobre contratos por diferencias	(639 057)	1 455 525	-	(5 436 609)	-	15 783 178
sobre contratos de opciones y swaptions	-	(11 430)	-	(388 898)	-	(405 960)
sobre divisas	(1 724)	532 963	(38 694)	4058	6131	1 491 475
VARIACIÓN NETA DE LA PLUSVALÍA/(MINUSVALÍA) LATENTE	1 158 896	16 043 003	(1 480 686)	13 608 651	57 942 689	30 305 354
VARIACIÓN NETA DEL PATRIMONIO NETO TOTAL COMO RESULTADO DE LAS OPERACIONES	1 105 130	27 341 798	182 414 496	21 822 974	71 235 411	6 063 697
Beneficios netos de la emisión de participaciones	10 111 100	29 601 253	690 115 538	48 193 751	70 440 818	46 958 616
Pago por participaciones reembolsadas	(7 419)	(109 248 384)	(237 322 510)	(36 873 669)	(92 313 669)	(67 518 911)
Distribución de los ingresos netos de inversión	-	-	(777 252)	-	-	-
INCREMENTO/(DESCENSO) DEL PATRIMONIO NETO DURANTE EL EJERCICIO	11 208 811	(52 305 333)	634 430 272	33 143 056	49 362 560	(14 496 598)
Patrimonio neto al inicio del periodo	10 603 804	400 977 339	2 479 858 286	153 926 693	410 569 595	296 663 280
Ajuste de divisa teórico**	-	-	-	-	-	-
PATRIMONIO NETO AL CIERRE DEL PERIODO	21 812 615	348 672 006	3 114 288 558	187 069 749	459 932 155	282 166 682

* Consulte la Cuenta de pérdidas y ganancias para conocer el cálculo de los ingresos/(pérdidas) netos de inversión.

** Este ajuste refleja la diferencia entre el balance de apertura usando el tipo de cambio a 30 de septiembre de 2023 y el mismo patrimonio neto con el tipo de cambio a 28 de marzo de 2024.

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Estado de variación patrimonial del periodo cerrado a 31 de marzo de 2024 (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Total* EUR
INGRESOS/(PÉRDIDAS) NETOS DE INVERSIÓN**	2 413 933	(5 200 517)	(4 650 013)	(13 410 803)	(1 670 960)	95 718 005
Ganancias/(pérdidas) netas materializadas						
sobre valores vendidos	211 344	9 991 445	12 422 255	(173)	21 991 095	92 160 430
sobre contratos de divisas a plazo	940 520	3 598 528	50 153	4 982 815	5 910 562	68 398 353
sobre operaciones al contado	-	-	-	(28 146)	-	(26 089)
sobre contratos de futuros	(95 939)	-	-	8 178 047	(711 882)	7 026 377
sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio	-	-	-	-	(1 324 034)	(1 227 264)
sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio	-	-	-	900 133	(511 958)	(5 269 661)
sobre contratos de swaps de divisas cruzadas	-	-	-	-	(44 096)	(40 873)
sobre contratos de swaps de tasas de inflación	-	-	-	-	4301	3986
sobre contratos de swaps de tipos de interés	-	-	-	-	(1 576 327)	3 957 047
sobre contratos de swaps de rentabilidad total	-	-	(2 183 277)	46 497 370	(8 433 797)	(7 196 356)
sobre contratos por diferencias	-	8 728 464	-	-	-	7 589 569
sobre contratos de opciones y swaptions	-	3 460 023	-	-	(889 589)	3 815 805
sobre divisas	86 345	(2 649)	6680	20 377	(2 115 257)	(4 447 998)
GANANCIAS NETAS MATERIALIZADAS	1 142 270	25 775 811	10 295 811	60 550 423	12 299 018	164 743 326
Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) latente						
sobre inversiones	3 520 865	55 365 995	18 735 023	9757	5 532 372	234 058 339
sobre contratos de divisas a plazo	(1 032 261)	(995 000)	(259 844)	(1 468 490)	(2 476 756)	(44 615 095)
sobre operaciones al contado	-	-	-	(24 209)	-	(22 439)
sobre contratos de futuros	(8 252)	-	-	(2 916 078)	(477 130)	(9 713 602)
sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio	-	-	-	-	833 813	772 873
sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio	-	-	-	127 500	176 628	9 889 527
sobre contratos de swaps de divisas cruzadas	-	-	-	-	(1 864)	(1 728)
sobre contratos de swaps de tasas de inflación	-	-	-	-	(413 476)	(383 255)
sobre contratos de swaps de tipos de interés	-	-	-	-	255 639	(10 306 132)
sobre contratos de swaps de rentabilidad total	-	-	(2 774 768)	125 912	(2 693 084)	(13 818 966)
sobre contratos por diferencias	-	8 941 326	-	-	-	18 634 994
sobre contratos de opciones y swaptions	-	1 412 554	-	-	(552 068)	50 238
sobre divisas	(10 534)	(465)	420	47 302	2 313 989	4 027 812
VARIACIÓN NETA DE LA PLUSVALÍA/(MINUSVALÍA) LATENTE	2 469 818	64 724 410	15 700 831	(4 098 306)	2 498 063	188 572 566
VARIACIÓN NETA DEL PATRIMONIO NETO TOTAL COMO RESULTADO DE LAS OPERACIONES	6 026 021	85 299 704	21 346 629	43 041 314	13 126 121	449 033 897
Beneficios netos de la emisión de participaciones	6 213 041	52 577 425	8 535 205	50 797 990	38 324 809	980 139 800
Pago por participaciones reembolsadas	(6 036 902)	(106 679 349)	(12 479 229)	(88 123 114)	(216 817 092)	(909 022 754)
Distribución de los ingresos netos de inversión	(37 218)	-	-	-	-	(754 943)
INCREMENTO/(DESCENSO) DEL PATRIMONIO NETO DURANTE EL PERIODO	6 164 942	31 197 780	17 402 605	5 716 190	(165 366 162)	519 396 000
Patrimonio neto al inicio del periodo	69 593 042	331 125 967	171 437 016	378 919 128	483 606 159	4 928 621 911
Ajuste de divisa teórico***	-	-	-	-	-	(90 457 375)
PATRIMONIO NETO AL CIERRE DEL PERIODO	75 757 984	362 323 747	188 839 621	384 635 318	318 239 997	5 357 560 536

* En todo el Estado de variación patrimonial, que se ha presentado en euros, el activo y el pasivo expresados en divisas distintas del euro se han convertido según los siguientes tipos de cambio, a 28 de marzo de 2024: 1 euro = 1,07885 dólares estadounidenses.

** Consulte la Cuenta de pérdidas y ganancias para conocer el cálculo de los ingresos/(pérdidas) netos de inversión.

*** Este ajuste refleja la diferencia entre el balance de apertura usando el tipo de cambio a 30 de septiembre de 2023 y el mismo patrimonio neto con el tipo de cambio a 28 de marzo de 2024.

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Distribución sectorial de inversiones

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short %	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Renta fija, instrumentos negociables y valores respaldados por activos e hipotecas	41,04	70,45	89,48	-	-	9,11
Otros valores						
Industria aeroespacial y defensa	-	-	-	-	2,83	-
Agricultura	-	-	-	-	-	-
Líneas aéreas	-	-	-	-	-	0,10
Ropa	1,57	-	-	-	-	1,26
Fabricantes de automóviles	-	-	-	-	-	1,14
Piezas y equipamiento de automóviles	1,91	-	-	-	-	2,28
Bancos	4,10	-	-	-	4,86	9,55
Bebidas	1,18	-	-	-	-	1,43
Bioteología	-	-	-	-	-	0,10
Materiales de construcción	-	-	-	-	2,50	0,09
Productos químicos	-	-	-	-	-	1,02
Carbón	-	-	-	-	-	-
Servicios comerciales	3,90	-	-	4,08	2,22	2,28
Informática	1,55	-	-	2,62	-	1,35
Cosméticos y cuidado personal	-	-	-	-	-	0,90
Distribución y venta mayorista	-	-	-	-	-	-
Servicios financieros diversificados	-	-	-	-	8,47	2,52
Eléctrico	-	-	-	-	-	0,09
Componentes e instrumentos eléctricos	-	-	-	-	-	1,55
Electrónica	3,79	-	-	9,36	-	3,63
Fuentes alternativas de energía	-	-	-	-	-	0,23
Ingeniería y construcción	-	-	-	-	-	0,03
Entretenimiento	-	-	-	1,62	-	-
Control medioambiental	-	-	-	-	-	0,03
Alimentos	-	-	-	-	-	1,08
Gas	-	-	-	-	-	-
Salud (productos)	-	-	-	-	5,37	0,05
Salud (servicios)	1,11	-	-	-	-	0,65
Constructores de viviendas	-	-	-	-	-	-
Mobiliario del hogar	-	-	-	-	-	0,85
Utensilios del hogar	1,17	-	-	-	-	0,79
Seguros	1,38	-	2,38	-	11,41	1,23
Internet	0,45	-	-	15,48	15,29	0,76
Sociedades de inversión	-	-	-	-	-	7,93
Tiempo libre	1,89	-	-	-	-	0,66
Alojamiento	-	-	-	-	1,89	0,40
Maquinaria (construcción y minería)	-	-	-	-	-	0,43
Maquinaria (diversificado)	2,53	-	-	-	-	0,70
Medios de comunicación	-	-	-	8,68	-	-
Metalurgia	-	-	-	-	-	-
Minería	-	-	-	-	-	0,53
Fabricación diversa	-	-	-	-	5,64	0,06
Petróleo y gas	-	-	-	-	1,93	0,72
Servicios de petróleo y gas	-	-	-	-	-	-
Productos farmacéuticos	-	-	-	-	2,01	1,55
Tuberías	-	-	-	-	-	-

Distribución sectorial de inversiones (continuación)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short %	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Otros valores (continuación)						
Sector inmobiliario	-	-	-	-	-	1,24
Ventas minoristas	0,76	-	-	1,65	-	2,50
Ahorros y préstamos	-	-	-	-	-	-
Semiconductores	25,19	-	-	18,02	-	23,68
Software	-	-	-	30,31	11,20	1,17
Telecomunicaciones	-	-	-	-	-	1,05
Transporte	-	-	-	-	10,66	0,72
Cartera de inversiones como porcentaje del patrimonio neto	93,52	70,45	91,86	91,82	86,28	87,44
Depósitos a plazo	-	-	-	-	-	-
Otros activos netos	6,48	29,55	8,14	8,18	13,72	12,56
Total Patrimonio neto	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Distribución sectorial de inversiones (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA SEG US Equity %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Renta fija, instrumentos negociables y valores respaldados por activos e hipotecas	97,08	1,36	18,41	0,03	49,93
Otros valores					
Industria aeroespacial y defensa	-	-	3,17	-	0,18
Agricultura	-	-	-	-	-
Líneas aéreas	-	-	1,42	-	-
Ropa	-	-	0,10	-	0,35
Fabricantes de automóviles	-	-	2,00	-	0,12
Piezas y equipamiento de automóviles	-	-	-	-	0,02
Bancos	-	-	1,01	-	6,94
Bebidas	-	-	1,18	-	0,12
Biotecnología	-	-	-	-	2,25
Materiales de construcción	-	5,76	-	-	0,14
Productos químicos	-	-	0,16	-	-
Carbón	-	-	-	-	0,02
Servicios comerciales	-	3,27	3,05	-	0,51
Informática	-	-	0,64	-	0,01
Cosméticos y cuidado personal	-	-	0,15	-	0,32
Distribución y venta mayorista	-	4,70	-	-	-
Servicios financieros diversificados	-	-	0,29	-	2,63
Eléctrico	-	-	-	-	0,83
Componentes e instrumentos eléctricos	-	-	-	-	0,19
Electrónica	-	4,43	-	-	0,19
Fuentes alternativas de energía	-	-	-	-	0,21
Ingeniería y construcción	-	4,52	-	-	-
Entretenimiento	-	9,50	-	-	0,46
Control medioambiental	-	2,13	2,08	-	-
Alimentos	-	-	0,18	-	-
Gas	-	-	-	-	0,29
Salud (productos)	-	2,30	14,08	-	1,02
Salud (servicios)	-	-	0,89	-	1,03
Constructores de viviendas	-	-	-	-	0,10
Mobiliario del hogar	-	6,71	-	-	0,12
Utensilios del hogar	-	-	-	-	-
Seguros	-	5,10	-	-	1,27
Internet	-	5,76	6,13	-	1,16
Sociedades de inversión	-	-	2,95	1,30	1,18
Tiempo libre	-	-	1,54	-	-
Alojamiento	-	-	0,19	-	0,06
Maquinaria (construcción y minería)	-	-	-	-	0,06
Maquinaria (diversificado)	-	11,83	1,37	-	0,01
Medios de comunicación	-	-	-	-	0,19
Metalurgia	-	-	-	-	0,11
Minería	-	-	-	-	0,39
Fabricación diversa	-	4,95	3,67	-	-
Petróleo y gas	-	-	-	-	7,26
Servicios de petróleo y gas	-	-	-	-	0,21
Productos farmacéuticos	-	-	3,62	-	1,88
Tuberías	-	-	-	-	0,78

Distribución sectorial de inversiones (continuación)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA SEG US Equity %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Otros valores (continuación)					
Sector inmobiliario	-	-	-	-	0,22
Ventas minoristas	-	4,51	0,26	-	0,42
Ahorros y préstamos	-	-	0,24	-	-
Semiconductores	-	3,18	8,03	-	0,64
Software	-	6,67	10,50	-	0,74
Telecomunicaciones	-	-	1,03	-	0,17
Transporte	-	-	3,46	-	0,06
Cartera de inversiones como porcentaje del patrimonio neto	97,08	86,68	91,80	1,33	84,79
Depósitos a plazo	-	-	-	62,61	-
Otros activos netos	2,92	13,32	8,20	36,06	15,21
Total Patrimonio neto	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024

Schroder GAIA Asian Equity Long Short

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Renta variable				
China			1.163.785	5,34
13.640	CNH	Contemporary Ampere Technology	354.565	1,63
26.400	CNH	Jiangsu Hengli Hydraulic	183.106	0,84
1100	CNH	Kweichow Moutai	257.743	1,18
137.756	CNH	Yizumi Holdings	368.371	1,69
Indonesia			687.723	3,15
950.600	IDR	Bank Mandiri Persero	434.680	1,99
680.000	IDR	Bank Negara Indonesia Persero	253.043	1,16
Filipinas			1.002.408	4,60
75.500	PHP	BDO Unibank	207.502	0,95
111.100	PHP	International Container Terminal Services	628.476	2,89
526.200	PHP	Wilcon Depot	166.430	0,76
Corea del Sur			2.108.269	9,67
701	KRW	NAVER	97.424	0,45
27.474	KRW	Samsung Electronics	1.648.950	7,56
1314	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	301.598	1,38
170	KRW	Samsung SDI	60.297	0,28
Taiwán			6.241.396	28,61
26.598	TWD	Advantech	338.256	1,55
133.000	TWD	ASE Technology Holding	644.148	2,95
59.000	TWD	Chroma ATE	465.496	2,13
20.000	TWD	Eclat Textile	341.838	1,57
24.000	TWD	MediaTek	869.905	3,99
62.000	TWD	Merida Industry	411.674	1,89
23.000	TWD	Nien Made Enterprise	255.128	1,17
27.750	TWD	Sporton International	223.276	1,02
97.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	2.330.777	10,69
7000	TWD	Voltronic Power Technology	360.898	1,65
Tailandia			242.259	1,11
312.900	THB	Bangkok Dusit Medical Services	242.259	1,11
Total Renta variable			11.445.840	52,48
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			11.445.840	52,48

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Estados Unidos			8.952.560	41,04
900.000	USD	United States Treasury Bill 04/04/24, ZCP	899.217	4,12
900.000	USD	United States Treasury Bill 11/04/24, ZCP	898.305	4,12
800.000	USD	United States Treasury Bill 18/04/24, ZCP	797.691	3,66
1.000.000	USD	United States Treasury Bill 25/04/24, ZCP	996.039	4,57
1.000.000	USD	United States Treasury Bill 02/05/24, ZCP	995.054	4,56
1.000.000	USD	United States Treasury Bill 09/05/24, ZCP	994.015	4,56
1.000.000	USD	United States Treasury Bill 16/05/24, ZCP	993.007	4,55
900.000	USD	United States Treasury Bill 23/05/24, ZCP	892.802	4,09
1.500.000	USD	United States Treasury Bill 30/05/24, ZCP	1.486.430	6,81
Total Bonos			8.952.560	41,04
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados			8.952.560	41,04
Total Inversiones			20.398.400	93,52
Otros activos netos			1.414.215	6,48
Valor liquidativo			21.812.615	100,00

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA BlueTrend

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Estados Unidos			219.413.621	62,93
31.500.000	USD	United States Treasury Note 15/04/24, 0.38%	31.440.052	9,02
22.000.000	USD	United States Treasury Note 30/04/24, 2.50%	21.949.255	6,30
44.500.000	USD	United States Treasury Note 15/05/24, 0.25%	44.228.059	12,68
9.000.000	USD	United States Treasury Note 15/05/24, 2.50%	8.968.830	2,57
16.000.000	USD	United States Treasury Note 31/05/24, 2.50%	15.926.538	4,57
28.500.000	USD	United States Treasury Note 15/06/24, 0.25%	28.201.370	8,09
16.000.000	USD	United States Treasury Note 15/07/24, 0.38%	15.773.818	4,52
14.500.000	USD	United States Treasury Note 31/07/24, 1.75%	14.329.746	4,11
6.000.000	USD	United States Treasury Note 31/07/24, 3.00%	5.953.340	1,71
10.000.000	USD	United States Treasury Note 15/08/24, 2.38%	9.890.318	2,84
5.000.000	USD	United States Treasury Note 31/08/24, 1.25%	4.917.336	1,41
16.000.000	USD	United States Treasury Note 31/08/24, 3.25%	15.865.321	4,55
2.000.000	USD	United States Treasury Note 30/09/24, 2.13%	1.969.638	0,56
Total Bonos			219.413.621	62,93
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			219.413.621	62,93

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Otros valores	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Irlanda			26.224.603	7,52
672.425.725	USD	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	26.224.603	7,52
Total Bonos			26.224.603	7,52
Total Otros valores			26.224.603	7,52
Total Inversiones			245.638.224	70,45
Otros activos netos			103.033.782	29,55
Valor liquidativo			348.672.006	100,00

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Cat Bond

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% patrimonio neto
Renta variable									
Bermudas			7667	-					
697	USD	Voussoir Re	7667	-					
Supranacional			74.240.103	2,38					
550	USD	Voussoir Re SideCar	123.200	-					
697	USD	Voussoir Re SideCar-Preference	48.790	-					
530	USD	Voussoir Re SideCar-Preference	-	-					
557	USD	Voussoir Re SideCar-Preference	63.841.669	2,05					
667	USD	Voussoir Re-Preference	10.226.444	0,33					
Total Renta variable			74.247.770	2,38					
Bonos									
Bermudas			279.663.078	8,98					
19.450.000	USD	Acorn Re 07/11/24, variable	19.378.035	0,63	11.188.861	USD	Kilimanjaro III Re 19/12/26, variable	10.909.140	0,35
10.263.000	USD	Baldwin Re 07/07/25, variable	10.215.790	0,33	593.390	USD	Manatee Re III 08/06/26, variable	118.678	-
2.667.000	USD	Blue Halo Re Series A 24/02/25, variable	2.646.797	0,08	25.602.000	USD	Merna Reinsurance II 08/07/24, variable	25.619.280	0,83
3.500.000	USD	Blue Halo Re Series B 24/02/25, variable	3.556.875	0,11	11.500.000	USD	Montoya Re 07/04/25, variable	11.612.125	0,37
500.000	USD	Bowline Re 23/05/25, variable	507.775	0,02	13.500.000	USD	Nakama Re 14/01/25, variable	13.530.038	0,43
2.500.000	USD	Citrus Re Series A 07/06/27, variable	2.500.000	0,08	9.917.000	USD	Sanders Re II Series A 07/04/25, variable	9.712.958	0,31
4.500.000	USD	Citrus Re Series B 07/06/27, variable	4.500.000	0,14	18.947.000	USD	Sanders Re II Series A1 07/04/25, variable	18.722.004	0,61
89.359	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	50.693	-	11.750.000	USD	Sanders Re III Series A 07/06/25, variable	12.219.119	0,39
24.512.000	USD	Everglades Re II 14/05/24, variable	24.684.196	0,80	8.250.000	USD	Sanders Re III Series B 07/06/25, variable	8.411.081	0,27
9.417.000	USD	Four Lakes Re 07/01/25, variable	9.135.432	0,29	8.750.000	USD	Sanders Re III 07/04/26, variable	8.075.375	0,26
2.600.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variable	2.597.270	0,08	6.256.000	USD	Tailwind Re Series A 08/01/25, variable	6.219.090	0,20
5.000.000	USD	Integrity Re 12/06/28, variable	3.312.500	0,11	14.958.000	USD	Tailwind Re Series B 08/01/25, variable	14.768.407	0,47
13.053.671	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variable	12.727.330	0,41	9.902.000	USD	Tailwind Re Series C 08/01/25, variable	9.889.870	0,32
12.087.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variable	12.006.017	0,39	250.000	USD	Tailwind Re Series D 08/01/25, variable	252.894	0,01
4.380.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B1 21/04/25, variable	4.378.248	0,14	Irlanda				
4.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C1 21/04/25, variable	4.780.638	0,15	8.750.000	EUR	King Max Re Designated Activity 06/01/27, variable	9.535.753	0,31
8.500.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B2 20/04/26, variable	8.485.550	0,27	23.000.000	USD	Queen Street 2023 Re DAC 08/12/25, variable	24.055.125	0,77
4.100.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C2 20/04/26, variable	4.139.873	0,13	Singapur				
					7.750.000	USD	Integrity Re II 12/04/28, variable	174.375	0,01
					6.250.000	USD	Kizuna Re III 07/04/26, variable	6.222.969	0,20
					54.825.000	USD	Nakama Re Series 1 13/10/26, variable	54.204.106	1,73
					1.125.000	USD	Phoenix 2 Re 04/01/38, ZCP	1.716.500	0,06
					3.000.000	USD	Phoenix 2 Re Series 24B 04/01/38, ZCP	3.399.250	0,11
					4.012.000	USD	Phoenix 3 Re 04/01/29, ZCP	4.633.377	0,15
					10.000.000	NZD	Totara Re 08/06/27, 13.39%	5.959.563	0,19
Supranacional			13.421.869	0,43					
4.750.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 15/04/24, variable							
								2.351.250	0,08

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Cat Bond (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% patrimonio neto
10.750.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 31/03/26, variable	11.070.619	0,35
Total Bonos			402.985.965	12,94
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			477.233.735	15,32

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% patrimonio neto
Bonos				
Bermudas			1.513.738.561	48,62
17.679.000	USD	2001 Cat Re 08/01/27, variable	18.641.622	0,60
36.059.000	USD	Alamo Re 07/06/24, variable	36.296.087	1,16
4.000.000	USD	Alamo Re 07/06/26, variable	4.123.800	0,13
6.076.000	USD	Aquila Re I Series 2023-1B 08/06/26, variable	6.228.204	0,20
7.971.000	USD	Aquila Re I Series 2023-1C 08/06/26, variable	8.258.952	0,27
7.200.000	USD	Aragonite Re 07/04/27, variable	7.236.000	0,23
2.450.000	USD	Artex Axccl Re Bermuda 17/01/25, variable	-	-
5.707.000	USD	Ashera Re 07/04/27, variable	5.735.535	0,18
2.761.000	USD	Baldwin Re 07/07/27, variable	2.804.693	0,09
4.600.000	USD	Bayou Re Series A 26/05/26, variable	4.801.710	0,15
2.000.000	USD	Bayou Re Series B 26/05/26, variable	2.108.050	0,07
2.250.000	USD	Blue Ridge Re 08/01/27, variable	2.258.606	0,07
3.500.000	EUR	Blue Sky Re DAC 26/01/27, variable	3.891.614	0,12
19.996.000	USD	Bonanza Re 23/12/24, variable	19.676.064	0,63
12.250.000	USD	Bonanza Re 16/03/25, variable	11.641.481	0,37
6.750.000	USD	Bonanza Re 08/01/26, variable	6.867.956	0,22
3.333.000	USD	Bowline Re 23/05/25, variable	3.390.161	0,11
10.000.000	USD	Cape Lookout Re 28/03/25, variable	9.917.250	0,32
8.405.000	USD	Cape Lookout Re 28/04/26, variable	8.641.601	0,28

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% patrimonio neto
24.419.000	USD	Cape Lookout Re 05/04/27, variable	24.541.094	0,79
6.750.000	USD	Citrus Re 07/06/25, variable	6.815.644	0,22
7.500.000	USD	Citrus Re Series A 07/06/26, variable	7.752.563	0,25
5.000.000	USD	Citrus Re Series B 07/06/26, variable	5.192.125	0,17
10.833.000	USD	Commonwealth Re 08/07/25, variable	10.978.704	0,35
20.000.000	USD	Easton Re 08/01/27, variable	20.941.000	0,67
330.599	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP	94.882	-
717.699	USD	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP	246.171	0,01
1.166.016	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	648.538	0,02
25.714	USD	Eden Re II Series A 19/03/27, ZCP	127.338	-
100.000	USD	Eden Re II Series B 19/03/27, ZCP	3.285.395	0,11
11.300.000	USD	Eden Re II 17/03/28, ZCP	11.610.750	0,37
28.750.000	USD	Everglades Re II Series A2 14/05/24, variable	28.944.780	0,92
22.750.000	USD	Everglades Re II Series B1 14/05/24, variable	22.903.562	0,74
7.750.000	USD	Everglades Re II 19/05/25, variable	7.642.469	0,25
1.250.000	USD	Finca Re 06/06/25, variable	1.302.563	0,04
7.973.000	USD	First Coast Re IV 07/04/26, variable	8.177.308	0,26
26.520.000	USD	FloodSmart Re Series A 25/02/25, variable	26.067.833	0,84
8.750.000	USD	FloodSmart Re Series B 25/02/25, variable	8.533.000	0,27
2.250.000	USD	FloodSmart Re Series C 25/02/25, variable	2.156.063	0,07
17.708.000	USD	FloodSmart Re Series A 11/03/26, variable	17.969.636	0,58
4.500.000	USD	FloodSmart Re Series B 11/03/26, variable	4.609.575	0,15
35.712.000	USD	FloodSmart Re Series A 12/03/27, variable	35.698.607	1,14
8.500.000	USD	FloodSmart Re Series B 12/03/27, variable	8.496.813	0,27
16.750.000	USD	Foundation Re IV 08/01/27, variable	16.639.450	0,53
7.917.000	USD	Four Lakes Re 07/01/26, variable	8.105.623	0,26
4.000.000	USD	Four Lakes Re 07/01/27, variable	4.074.500	0,13
3.806.744	USD	Frontline Re 06/07/26, variable	2.093.709	0,07

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Cat Bond (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% patrimonio neto
10.000.000	USD	Fuchsia 2023-1 - London Bridge 2 PCC 06/04/27, variable	10.114.500	0,32	4.257.000	USD	Matterhorn Re 07/06/24, variable	4.323.090	0,14
2.750.000	USD	Galileo Re 08/01/26, variable	2.829.406	0,09	7.750.000	USD	Matterhorn Re 24/03/25, variable	7.744.188	0,25
8.261.000	USD	Galileo Re 07/01/28, variable	8.619.734	0,28	11.500.000	USD	Matterhorn Re Series A 24/03/25, variable	11.516.388	0,37
7.680.000	USD	Gateway Re II 27/04/26, variable	7.994.304	0,26	14.750.000	USD	Matterhorn Re 08/12/25, variable	14.462.006	0,46
5.000.000	USD	Herbie Re 08/07/24, variable	5.055.250	0,16	7.500.000	USD	Matterhorn Re 08/01/27, variable	4.200.000	0,13
833.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variable	825.045	0,03	7.600.000	USD	Matterhorn Re 25/01/27, variable	7.589.360	0,24
1.866.569	USD	Herbie Re 08/01/26, variable	1.423.259	0,05	5.250.000	USD	Mayflower Re Series A 08/07/26, variable	5.340.169	0,17
6.000.000	USD	Herbie Re 08/01/27, variable	6.313.950	0,20	5.750.000	USD	Mayflower Re Series B 08/07/26, variable	5.891.594	0,19
9.000.000	USD	Herbie Re Series A 07/01/28, variable	8.988.975	0,29	20.144.000	USD	Merna Reinsurance II 05/04/24, variable	20.122.849	0,65
3.000.000	USD	Herbie Re Series B 07/01/28, variable	2.992.950	0,10	15.000.000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/25, variable	15.140.625	0,49
9.250.000	USD	Hestia Re 22/04/25, variable	9.139.000	0,29	14.000.000	USD	Merna Reinsurance II Series 2 07/07/25, variable	14.203.000	0,46
750.000	USD	Hestia Re 07/04/26, variable	761.719	0,02	21.250.000	USD	Merna Reinsurance II Series 3 07/07/25, variable	21.721.218	0,70
2.250.000	EUR	Hexagon IV Re 21/01/26, variable	2.577.305	0,08	10.091.000	USD	Merna Reinsurance II Series A 07/07/26, variable	10.594.793	0,34
2.812.000	EUR	Hexagon IV Re 21/01/28, variable	3.109.569	0,10	11.091.000	USD	Merna Reinsurance II Series B 07/07/26, variable	11.897.316	0,38
9.000.000	USD	High Point Re 06/01/27, variable	9.099.000	0,29	23.750.000	USD	Mona Lisa Re 08/07/25, variable	24.006.499	0,77
9.258.000	USD	Hypatia 08/04/26, variable	9.828.061	0,32	8.250.000	USD	Mona Lisa Re Series A 08/01/26, variable	8.949.394	0,29
6.750.000	USD	Integrity Re 06/06/25, variable	5.138.438	0,16	6.671.000	USD	Mona Lisa Re Series B 08/01/26, variable	7.244.039	0,23
10.941.000	USD	Integrity Re Series A 06/06/25, variable	11.386.846	0,37	8.462.000	USD	Montoya Re 07/04/26, variable	9.240.081	0,30
3.215.000	USD	Integrity Re Series B 06/06/26, variable	3.213.714	0,10	5.667.000	USD	Montoya Re 07/04/27, variable	5.898.922	0,19
1.500.000	USD	Integrity Re Series D 06/06/26, variable	1.499.400	0,05	10.500.000	USD	Montoya Re 05/06/26, variable	10.769.325	0,35
5.100.000	USD	Kendall Re 02/05/24, variable	5.104.080	0,16	14.250.000	USD	Mystic Re IV 08/01/26, variable	14.880.563	0,48
7.857.000	USD	Kilimanjaro III Re 21/04/25, variable	7.836.572	0,25	20.115.000	USD	Mystic Re IV 08/01/27, variable	20.556.524	0,66
23.344.000	USD	Kilimanjaro III Re 25/06/25, variable	23.868.655	0,77	13.250.000	USD	Mystic Re IV Series A 08/01/25, variable	13.110.544	0,42
10.464.000	USD	Kilimanjaro III Re 20/04/26, variable	10.331.107	0,33	6.500.000	USD	Mystic Re IV Series B 08/01/25, variable	6.434.188	0,21
5.906.000	USD	Locke Tavern Re 09/04/26, variable	6.028.992	0,19	6.602.000	USD	Nakama Re Series 1 09/05/28, variable	6.552.485	0,21
5.000.000	USD	Lower Ferry Re Series A 08/07/26, variable	5.112.750	0,16	8.111.000	USD	Nakama Re Series 2 09/05/28, variable	8.291.875	0,27
9.750.000	USD	Lower Ferry Re Series B 08/07/26, variable	9.954.994	0,32					

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Cat Bond (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% patrimonio neto
3.750.000	USD	Nature Coast Re 07/12/26, variable	3.843.844	0,12	2.708.000	USD	Titania Re 27/02/26, variable	2.946.033	0,09
11.668.000	USD	Northshore Re II 08/07/25, variable	12.185.476	0,39	9.250.000	USD	Tomoni Re Series A 07/04/26, variable	9.104.081	0,29
10.000.000	USD	Ocelot Re 07/01/27, variable	10.304.250	0,33	9.475.000	USD	Tomoni Re Series B 07/04/26, variable	9.308.714	0,30
13.000.000	USD	Phoenician Re 14/12/24, variable	12.930.125	0,42	8.250.000	USD	Tomoni Re Series A 05/04/28, variable	8.291.250	0,27
2.250.000	USD	Power Protective Re 09/10/24, variable	2.251.294	0,07	6.171.000	USD	Tomoni Re Series B 05/04/28, variable	6.201.855	0,20
3.286.000	USD	Purple Re 24/04/26, variable	3.393.945	0,11	19.000.000	USD	Torrey Pines Re Series A 07/06/24, variable	19.035.625	0,61
5.653.000	USD	Purple Re 05/06/26, variable	5.795.032	0,19	19.250.000	USD	Torrey Pines Re Series B 07/06/24, variable	19.228.344	0,62
8.250.000	USD	Ramble Re 05/03/27, variable	8.254.125	0,27	9.500.000	USD	Torrey Pines Re Series A 06/06/25, variable	9.502.375	0,31
10.000.000	EUR	Randolph Re 15/06/24, ZCP	8.630.800	0,28	5.000.000	USD	Torrey Pines Re Series B 06/06/25, variable	4.968.875	0,16
23.000.000	USD	Riverfront Re Series A 07/01/25, variable	22.589.449	0,73	8.333.000	USD	Torrey Pines Re Series A 05/06/26, variable	8.472.786	0,27
5.750.000	USD	Riverfront Re Series B 07/01/25, variable	5.556.369	0,18	4.875.000	USD	Torrey Pines Re Series B 05/06/26, variable	4.957.144	0,16
19.872.000	USD	Sakura Re Series A 07/04/25, variable	19.686.694	0,63	21.366.000	USD	Ursa Re II 06/12/24, variable	20.875.650	0,67
18.792.000	USD	Sakura Re Series B 07/04/25, variable	18.695.221	0,60	10.500.000	USD	Ursa Re II Series A 16/06/25, variable	10.539.638	0,34
11.500.000	USD	Sakura Re 05/01/26, variable	12.500.500	0,40	5.250.000	USD	Ursa Re II Series E 16/06/25, variable	5.209.444	0,17
10.875.000	USD	Sanders Re II 07/04/24, variable	10.854.338	0,35	17.500.000	USD	Ursa Re II Series AA 06/12/25, variable	18.231.500	0,59
1.468.485	USD	Sanders Re II 07/04/26, variable	13.951	-	11.250.000	USD	Ursa Re II Series C 06/12/25, variable	11.821.219	0,38
12.050.000	USD	Sanders Re III 07/04/26, variable	11.656.266	0,37	8.173.000	USD	Ursa Re Series AA 06/12/25, variable	8.325.631	0,27
17.750.000	USD	Sanders Re III 05/06/26, variable	18.272.294	0,59	2.419.000	USD	Ursa Re Series C 06/12/25, variable	2.469.618	0,08
5.156.000	USD	Sanders Re III 07/04/27, variable	5.199.310	0,17	15.000.000	USD	Ursa Re Series AA 07/12/26, variable	15.415.875	0,50
10.000.000	USD	Sanders Re III Series A 07/04/27, variable	10.171.250	0,33	14.750.000	USD	Ursa Re Series D 07/12/26, variable	15.012.550	0,48
29.300.000	USD	Sanders Re III 07/04/28, variable	29.702.874	0,94	3.750.000	USD	Ursa Re Series E 07/12/26, variable	3.797.156	0,12
6.079.000	USD	Solomon Re 08/06/26, variable	6.323.072	0,20	6.000.000	USD	Veraison Re 09/03/26, variable	6.302.400	0,20
3.375.000	USD	Stabilitas Re 05/06/26, variable	3.530.081	0,11	13.715.000	USD	Veraison Re 08/03/27, variable	13.890.552	0,45
20.975.000	USD	Sutter Re Series B 19/06/26, variable	21.409.707	0,69	18.006.000	USD	Winston Re Series A 26/02/27, variable	17.930.825	0,58
11.781.000	USD	Sutter Re Series E 19/06/26, variable	12.007.490	0,39	8.000.000	USD	Winston Re Series B 26/02/27, variable	7.961.400	0,26
14.500.000	USD	Titania Re 21/06/24, variable	14.507.613	0,47	9.625.000	USD	Wrigley Re Series A 07/08/26, variable	9.884.634	0,32
17.107.000	USD	Titania Re 27/12/24, variable	16.852.106	0,54	8.565.000	USD	Wrigley Re Series B 07/08/26, variable	8.938.220	0,29

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Cat Bond (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% patrimonio neto										
Islas Caimán					188.509.191					6,05									
1.092.500	USD	Caelus Re V Series B 05/06/24, variable	1.082.941	0,03	4.000.000	USD	Vitality Re XIII Series B 06/01/26, variable	3.970.500	0,13										
3.747.995	USD	Caelus Re V Series C 05/06/24, variable	1.293.058	0,04	14.000.000	USD	Vitality Re XIV Series A 05/01/27, variable	14.258.300	0,46										
11.550.000	USD	Caelus Re VI 07/06/24, variable	11.558.374	0,37	5.550.000	USD	Vitality Re XIV Series B 05/01/27, variable	5.727.184	0,18										
18.500.000	USD	Fish Pond Re 08/01/27, variable	18.621.175	0,59	11.022.000	USD	Vitality Re XV Series A 07/01/28, variable	11.023.929	0,35										
800.000	USD	Long Point Re IV 01/06/26, variable	806.520	0,03	4.320.000	USD	Vitality Re XV Series B 07/01/28, variable	4.361.040	0,14										
1.480.545	USD	Residential Reinsurance 2019 06/06/26, variable	1.312.910	0,04	Hong Kong					15.063.060					0,48				
6.154.000	USD	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variable	6.145.077	0,20	11.558.000	USD	Black Kite Re 09/06/25, variable	11.764.310	0,37										
7.984.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variable	7.748.871	0,25	3.250.000	USD	Great Wall Re 05/01/26, variable	3.298.750	0,11										
5.000.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variable	4.892.625	0,16	Irlanda					89.221.598					2,86				
4.250.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 11 06/06/25, variable	3.792.063	0,12	19.425.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variable	19.573.601	0,63										
8.285.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 12 06/06/25, variable	7.693.037	0,25	16.500.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity 06/06/25, variable	17.280.450	0,55										
4.642.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 13 06/06/25, variable	4.441.001	0,14	8.000.000	EUR	Azzurro Re II DAC 20/04/28, variable	8.673.954	0,28										
6.500.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 14 06/06/25, variable	6.247.475	0,20	19.500.000	EUR	Lion III Re DAC 16/07/25, variable	20.739.893	0,67										
17.416.667	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 2 06/12/25, variable	16.534.948	0,53	5.250.000	EUR	Orange Capital Re DAC 17/01/25, variable	5.685.061	0,18										
4.310.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 3 06/12/25, variable	4.081.462	0,13	2.042.000	EUR	Orange Capital Re DAC 08/01/27, variable	2.253.956	0,07										
6.300.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 13 06/06/26, variable	5.982.480	0,19	4.000.000	EUR	Taranis Reinsurance DAC 21/01/28, variable	4.466.439	0,14										
2.950.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 14 06/06/26, variable	2.799.845	0,09	9.769.000	EUR	Windmill II Re DAC 05/07/24, variable	10.548.244	0,34										
3.750.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 3 06/12/26, variable	3.899.156	0,13	Singapur					84.748.068					2,72				
8.500.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 5 06/12/26, variable	8.627.925	0,28	4.000.000	USD	Astro Re 08/07/25, variable	3.400.000	0,11										
12.044.000	USD	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variable	12.062.066	0,39	12.000.000	USD	Catahoula II Re Series A 16/06/25, variable	12.465.000	0,40										
6.000.000	USD	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variable	5.985.600	0,19	5.250.000	USD	Catahoula II Re Series B 16/06/25, variable	5.469.056	0,18										
13.648.000	USD	Vitality Re XIII Series A 06/01/26, variable	13.559.629	0,44	14.866.000	USD	First Coast Re III 07/04/25, variable	14.416.675	0,46										
					8.957.000	EUR	Hexagon III Re 15/01/26, variable	9.325.045	0,30										
					5.000.000	EUR	Hexagon III Re Series CAT 15/01/26, variable	4.989.681	0,16										
					6.786.000	USD	Kizuna Re III 09/04/29, variable	6.793.804	0,22										
					17.714.000	USD	Nakama Re Series 2 13/10/26, variable	17.704.701	0,56										
					5.000.000	USD	Umigame Re Series A1 07/04/25, variable	4.959.750	0,16										

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Cat Bond (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% patrimonio neto
2.750.000	USD	Umigame Re Series A2 07/04/25, variable	2.733.981	0,09
2.500.000	USD	Umigame Re Series B1 07/04/25, variable	2.490.375	0,08
Reino Unido			30.043.038	0,96
29.750.000	USD	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variable	30.043.038	0,96
Estados Unidos			449.280.937	14,44
6.315.000	USD	Cosaint Re 03/04/24, variable	6.310.422	0,20
12.000.000	USD	Gateway Re 23/12/24, variable	11.010.000	0,35
11.875.000	USD	Gateway Re 23/12/24, ZCP	11.043.750	0,35
13.700.000	USD	Gateway Re 12/05/25, variable	14.113.398	0,45
20.666.000	USD	Gateway Re Series A 24/02/26, variable	22.410.727	0,72
4.500.000	USD	Gateway Re Series B 24/02/26, variable	4.565.813	0,15
10.000.000	USD	Gateway Re 08/07/27, variable	10.005.500	0,32
478.904	USD	JGWPT XXV 15/02/67, 7.14%	492.332	0,02
15.000.000	USD	Lightning Re 31/03/26, variable	16.153.875	0,52
5.250.000	USD	Logistics Re 20/12/24, variable	5.197.631	0,17
1.050.000	USD	Residential Reinsurance 2023 06/12/24, variable	934.605	0,03
8.500.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 13 06/06/27, variable	8.327.238	0,27
17.300.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 14 06/06/27, variable	17.101.483	0,55
2.031.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 3 06/12/27, variable	2.025.821	0,07
2.265.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 5 06/12/27, variable	2.275.476	0,07
900.000	USD	Security First Managers 25/02/25, variable	900.000	0,03
200.000.000	USD	United States Treasury Bill 25/04/24, ZCP	199.299.749	6,40
100.000.000	USD	United States Treasury Bill 23/05/24, ZCP	99.243.399	3,19
13.903.000	USD	Vista Re 21/05/24, variable	13.956.874	0,45
3.750.000	USD	Vista Re 21/05/25, variable	3.912.844	0,13
Total Bonos			2.370.604.453	76,13
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados			2.370.604.453	76,13

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Otros valores	Valor de mercado USD	% patrimonio neto
Bonos				
Bermudas			83.481	-
4.750.000	USD	Pelican IV Re Series B 07/05/24, variable	83.481	-
Estados Unidos			12.761.907	0,41
12.665.622	USD	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5.96%	11.652.373	0,37
2400	USD	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP	-	-
1.404.474	USD	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP	1.109.534	0,04
Total Bonos			12.845.388	0,41
Total Otros valores			12.845.388	0,41
Total Inversiones			2.860.683.576	91,86
Otros activos netos			253.604.982	8,14
Valor liquidativo			3.114.288.558	100,00

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% patrimonio neto
Renta variable				
Israel			5.554.825	2,97
152.815	USD	Global-e Online	5.554.825	2,97
Taiwán			3.644.371	1,95
26.787	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing – ADR	3.644.371	1,95
Estados Unidos			162.572.941	86,90
90.332	USD	Block	7.640.281	4,08
5393	USD	Broadcom	7.147.936	3,82
35.040	USD	Carvana	3.080.366	1,65
155.193	USD	Comcast	6.727.617	3,60
18.456	USD	CyberArk Software	4.902.467	2,62
104.078	USD	HashiCorp	2.804.902	1,50
39.544	USD	Liberty Media-Liberty Formula One	2.594.086	1,39
114.752	USD	Marvell Technology	8.133.622	4,35
30.900	USD	Microsoft	13.000.248	6,95
17.328	USD	MongoDB	6.214.514	3,32
264.000	USD	News	6.911.520	3,69
5422	USD	NVIDIA	4.899.102	2,62
144.500	USD	Oracle	18.150.646	9,69
253.500	USD	Pinterest	8.788.845	4,70
58.892	USD	Qorvo	6.762.568	3,61
29.670	USD	Salesforce	8.936.011	4,78
113.486	USD	Semtech	3.119.730	1,67
26.300	USD	Spotify Technology	6.940.570	3,71
23.168	USD	Teradata	895.907	0,48
35.081	USD	TKO Group Holdings	3.031.349	1,62
272.000	USD	Trimble	17.505.920	9,36
43.000	USD	Unity Software	1.148.100	0,61
41.000	USD	Wayfair	2.783.080	1,49
214.300	USD	Zillow Group	10.453.554	5,59
Total Renta variable			171.772.137	91,82
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			171.772.137	91,82
Total Inversiones			171.772.137	91,82
Otros activos netos			15.297.612	8,18
Valor liquidativo			187.069.749	100,00

Schroder GAIA Egerton Equity

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado EUR	% Patrimonio neto
Renta variable				
Bermudas			13.769.357	2,99
63.205	USD	RenaissanceRe Holdings	13.769.357	2,99
Canadá			57.905.804	12,59
179.375	CAD	Canadian National Railway	21.894.126	4,76
332.292	CAD	Canadian Pacific Kansas City	27.156.713	5,90
477.853	CAD	Cenovus Energy	8.854.965	1,93
Dinamarca			9.229.479	2,01
78.115	DKK	Novo Nordisk	9.229.479	2,01
Francia			13.031.502	2,83
62.040	EUR	Safran	13.031.502	2,83
Alemania			51.709.880	11,24
63.553	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft in Muenchen	28.745.021	6,25
90.062	EUR	SAP	16.252.589	3,53
37.931	EUR	Siemens	6.712.270	1,46
India			5.001.756	1,09
204.322	USD	ICICI Bank	5.001.756	1,09
Reino Unido			2.801.122	0,61
386.800	HKD	HSBC Holdings	2.801.122	0,61
Estados Unidos			243.383.584	52,92
84.154	USD	Alphabet	11.876.802	2,58
162.553	USD	Amazon.com	27.178.301	5,91
142.503	USD	API Group	5.187.091	1,13
116.182	USD	Arch Capital Group	9.954.919	2,16
64.339	USD	Block	5.044.068	1,10
2755	USD	Booking Holdings	9.264.318	2,01
144.085	USD	CRH	11.520.389	2,50
9611	USD	First Citizens BancShares	14.565.496	3,17
120.405	USD	Fiserv	17.836.703	3,88
293.144	USD	GE HealthCare Technologies	24.701.971	5,37
118.024	USD	General Electric	19.202.626	4,18
43.930	USD	Hilton Worldwide Holdings	8.685.831	1,89
96.753	USD	Interactive Brokers Group	10.018.332	2,18
12.597	USD	Mastercard	5.622.966	1,22
48.928	USD	Meta Platforms	22.022.022	4,79
44.623	USD	Microsoft	17.401.667	3,78
90.072	USD	Visa	23.300.082	5,07
Total Renta variable			396.832.484	86,28
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			396.832.484	86,28
Total Inversiones			396.832.484	86,28
Otros activos netos			63.099.671	13,72
Valor liquidativo			459.932.155	100,00

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Helix

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Renta variable				
Baréin				
429.244	BHD	Aluminium Bahrain BSC	1.400.451	0,50
Brasil				
105.010	BRL	Arezzo Industria e Comercio	1.348.302	0,48
29.745	BRL	Azul	77.489	0,03
322.817	BRL	B3 - Brasil Bolsa Balcao	773.257	0,27
94.262	BRL	Banco Bradesco	268.537	0,10
9539	BRL	Centrais Eletricas Brasileiras	79.467	0,03
13.330	BRL	Hypera	87.694	0,03
843.630	BRL	Itausa	1.769.660	0,62
107.514	BRL	Localiza Rent a Car	1.174.469	0,42
11.863	BRL	Orizon Valorizacao de Residuos	89.632	0,03
180.717	BRL	PRIIO	1.759.676	0,61
255.484	BRL	Raia Drogasil	1.396.969	0,50
11.740	USD	XP	301.248	0,11
Chile				
1.328.447	CLP	Cia Sud Americana de Vapores	99.547	0,04
605.907	CLP	Colbun	78.212	0,03
3471	CLP	Sociedad Quimica y Minera de Chile	168.445	0,05
China				
274.000	CNH	37 Interactive Entertainment Network Technology Group	665.715	0,24
4509	CNH	Advanced Micro-Fabrication Equipment	92.696	0,03
2038	USD	Alibaba Group Holding	147.470	0,05
30.600	CNH	Anjoy Foods Group	349.647	0,12
60.600	CNH	Asymchem Laboratories Tianjin	745.356	0,26
51.437	USD	Atour Lifestyle Holdings	922.780	0,33
26.200	CNH	Bafang Electric Suzhou	133.302	0,05
58.867	CNH	Beijing Huafeng Test & Control Technology	847.200	0,30
21.244	CNH	Beijing Kingsoft Office Software	874.848	0,31
38.100	CNH	Changzhou Xingyu Automotive Lighting Systems	741.912	0,26
194.900	CNH	Chaozhou Three-Circle Group	667.348	0,24
67.300	CNH	China Jushi	97.051	0,03
67.000	HKD	China Mengniu Dairy	143.820	0,05
166.236	CNH	Contemporary Amperex Technology	4.322.357	1,54

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
29.044	CNH	Foshan Haitian Flavouring & Food	158.333	0,06
38.800	HKD	Fuyao Glass Industry Group	195.327	0,07
5500	USD	H World Group	212.850	0,08
41.600	CNH	Hangzhou Robam Appliances	137.227	0,05
10.700	CNH	Hithink RoyalFlush Information Network	198.691	0,07
78.316	CNH	Hongfa Technology	262.657	0,09
103.000	CNH	Hualan Biological Engineering	281.035	0,10
71.100	CNH	Jiangsu Hengli Hydraulic	493.266	0,17
14.100	CNH	Jiangsu Hengrui Pharmaceuticals	89.742	0,03
129.900	CNH	Jiangsu Yoke Technology	955.231	0,34
4500	CNH	Kweichow Moutai	1.054.677	0,37
154.000	HKD	Lenovo Group	178.469	0,06
253.274	CNH	Midea Group	2.252.829	0,80
54.913	CNH	Pylon Technologies	657.634	0,23
603.500	CNH	Sany Heavy Industry	1.201.115	0,43
78.000	CNH	Shandong Sinocera Functional Material	183.064	0,06
148.208	CNH	Shenzhen Inovance Technology	1.229.487	0,44
122.400	HKD	Shenzhou International Group Holdings	1.158.870	0,41
82.650	CNH	Sichuan Injet Electric	585.007	0,21
32.100	CNH	StarPower Semiconductor	640.904	0,23
34.233	USD	Trip.com Group	1.502.486	0,53
114.300	CNH	Venustech Group	327.925	0,12
144.600	CNH	Wanhua Chemical Group	1.602.263	0,57
3900	CNH	Wuliangye Yibin	82.239	0,03
30.000	CNH	WuXi AppTec	194.328	0,07
552.968	CNH	Yizumi Holdings	1.479.070	0,52
112.000	HKD	Zylox-Tonbridge Medical Technology	138.668	0,05
Colombia			203.186	0,07
38.688	COP	Banco Davivienda	203.186	0,07
Egipto			200.860	0,07
126.010	USD	Commercial International Bank Egypt	200.860	0,07
Georgia			2.470.397	0,88
60.827	GBP	TBC Bank Group	2.470.397	0,88
Alemania			1.113.229	0,39
11.170	EUR	Dr Ing hc F Porsche	1.113.229	0,39
Grecia			4.942.918	1,75
5428	EUR	GEK TERNA	98.955	0,04

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Helix (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
433.927	EUR	National Bank of Greece	3.400.460	1,20
344.834	EUR	Piraeus Financial Holdings	1.443.503	0,51
Hong Kong			146.374	0,05
21.800	HKD	AIA Group	146.374	0,05
Hungría			3.864.391	1,37
36.807	HUF	OTP Bank	1.694.818	0,60
85.483	HUF	Richter Gedeon	2.169.573	0,77
Indonesia			4.885.970	1,73
1.968.200	IDR	Bank Central Asia	1.250.685	0,44
4.557.600	IDR	Bank Mandiri Persero	2.084.049	0,74
3.394.100	IDR	Bank Negara Indonesia Persero	1.263.021	0,45
1.316.900	IDR	Telkom Indonesia Persero	288.215	0,10
Italia			3.116.319	1,10
880	EUR	Ferrari	383.962	0,14
117.938	EUR	FinecoBank Banca Fineco	1.768.574	0,62
209.600	EUR	Intesa Sanpaolo	761.276	0,27
7470	GBP	Wizz Air Holdings	202.507	0,07
Japón			71.856	0,03
2900	JPY	Integral	71.856	0,03
Kazajistán			3.338.354	1,18
89.872	USD	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	1.599.722	0,57
13.755	USD	Kaspi.KZ	1.738.632	0,61
México			7.860.736	2,79
124.022	USD	BBB Foods	2.949.243	1,05
224.287	MXN	Fomento Económico Mexicano	2.916.638	1,03
1.005.307	MXN	Gentera	1.718.277	0,61
4571	MXN	Gruma	85.776	0,03
2860	MXN	Grupo Aeroportuario del Sureste	90.437	0,03
16.971	MXN	Grupo Mexico	100.365	0,04
Perú			186.432	0,07
7830	USD	Intercorp Financial Services	186.432	0,07
Filipinas			6.658.794	2,36
2.634.600	PHP	Ayala Land	1.511.444	0,54
304.360	PHP	BDO Unibank	836.496	0,30
2795	PHP	Globe Telecom	87.954	0,03
507.110	PHP	International Container Terminal Services	2.868.647	1,01
1.441.400	PHP	Puregold Price Club	687.175	0,24
2.109.100	PHP	Wilcon Depot	667.078	0,24

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Polonia			7.194.171	2,55
34.474	PLN	Alior Bank	846.689	0,30
85.774	PLN	Grupa Pracuj	1.449.732	0,51
124.739	EUR	InPost	1.924.447	0,69
11.991	PLN	KRUK	1.332.083	0,47
332	PLN	LPP	1.273.801	0,45
464	PLN	mBank	86.127	0,03
11.416	PLN	ORLEN	186.309	0,07
6383	PLN	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski	94.983	0,03
Rumanía			86.259	0,03
3021	RON	Societatea De Producere A Energiei Electrice in Hidrocentrale Hidroelectrica	86.259	0,03
Eslovenia			4.401.187	1,56
187.796	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	4.401.187	1,56
Sudáfrica			3.368.085	1,19
18.467	ZAR	Aspen Pharmacare Holdings	213.944	0,08
3472	ZAR	Bid	84.674	0,03
12.797	ZAR	Capitec Bank Holdings	1.416.322	0,50
126.513	ZAR	Shoprite Holdings	1.653.145	0,58
Corea del Sur			30.022.710	10,64
1825	KRW	Hana Financial Group	79.846	0,03
456	KRW	Hyundai Motor	80.276	0,03
6521	KRW	KB Financial Group	340.521	0,12
19.552	KRW	Kia	1.626.610	0,58
2149	KRW	NAVER	298.665	0,11
707	KRW	Park Systems	79.720	0,03
12.760	KRW	Samsung Electro-Mechanics	1.420.779	0,50
291.211	KRW	Samsung Electronics	17.478.068	6,19
57.928	KRW	Samsung Electronics - Preference	2.891.559	1,02
14.434	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	3.312.985	1,17
5400	KRW	Samsung SDI	1.915.320	0,68
2319	KRW	Shinhan Financial Group	81.305	0,03
10.534	KRW	SK Telecom	417.056	0,15
Suiza			1.816.521	0,64
25.827	CHF	Galderma Group	1.816.521	0,64
Taiwán			66.282.359	23,50
152.000	TWD	Accton Technology	2.177.637	0,77
104.059	TWD	Advantech	1.323.356	0,47

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Helix (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
622.000	TWD	ASE Technology Holding	3.012.483	1,07
45.000	TWD	Asia Vital Components	762.104	0,27
3000	TWD	ASMedia Technology	216.539	0,08
162.000	TWD	Chailease Holding	868.124	0,31
216.000	TWD	Chroma ATE	1.704.189	0,60
265.000	TWD	CTBC Financial Holding	268.283	0,10
18.250	TWD	Dadi Early-Childhood Education Group	16.965	0,01
127.000	TWD	Delta Electronics	1.359.148	0,48
11.000	TWD	E Ink Holdings	78.023	0,03
67.000	TWD	Eclat Textile	1.145.156	0,41
51.000	TWD	Fortune Electric	1.067.696	0,38
598.000	TWD	Hon Hai Precision Industry	2.905.588	1,03
26.000	TWD	Jentech Precision Industrial	733.607	0,26
10.000	TWD	Materials Analysis Technology	84.366	0,03
209.000	TWD	MediaTek	7.575.421	2,68
262.000	TWD	Merida Industry	1.739.653	0,62
384.000	TWD	Nanya Technology	811.111	0,29
201.000	TWD	Nien Made Enterprise	2.229.600	0,79
70.000	TWD	Shihlin Electric & Engineering	612.433	0,22
104.187	TWD	Sporton International	838.288	0,30
1.359.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	32.654.896	11,57
17.000	TWD	Taiwan Union Technology	97.208	0,03
16.000	TWD	Unimicron Technology	94.990	0,03
120.000	TWD	Uni-President Enterprises	286.469	0,10
246.000	TWD	United Microelectronics	399.706	0,14
23.650	TWD	Voltronic Power Technology	1.219.320	0,43
Tailandia			1.310.143	0,46
162.900	THB	Bangkok Dusit Medical Services	126.123	0,04
884.200	THB	Bangkok Dusit Medical Services Class F	684.582	0,24
92.400	THB	Kasikornbank	314.014	0,11
920.500	THB	Land & Houses	185.424	0,07
Turquía			95.550	0,03
112.409	TRY	Yapi ve Kredi Bankasi	95.550	0,03
Emiratos Árabes Unidos			1.778.314	0,63
76.081	AED	ADNOC Drilling	82.251	0,03
98.569	AED	Burjeel Holdings	79.989	0,03
682.911	AED	Emaar Development	1.524.935	0,54

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
90.210	AED	Salik	91.139	0,03
Estados Unidos			4.337.570	1,54
604.815	GBP	Haleon	2.544.993	0,90
1734	USD	Mastercard	835.042	0,30
7000	TWD	Parade Technologies	201.228	0,07
2710	USD	Visa	756.307	0,27
Vietnam			1.656.767	0,59
255.700	VND	FPT	1.207.602	0,43
103.600	VND	Vietnam Dairy Products	282.868	0,10
80.400	VND	Vincom Retail	83.172	0,03
43.300	VND	Vingroup	83.125	0,03
Total Renta variable			200.487.403	71,05
Bonos				
Argentina			551.362	0,20
190.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/2030, 0.75%	99.997	0,04
1.080.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/2035, 3.63%	451.365	0,16
Brasil			914.578	0,32
2.096.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10.00%	419.899	0,15
1.610.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/31, 10.00%	317.297	0,11
910.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/33, 10.00%	177.382	0,06
Colombia			670.712	0,24
1.580.000.000	COP	Colombian TES 26/03/31, 7.00%	352.311	0,13
1.745.100.000	COP	Colombian TES 26/10/50, 7.25%	318.401	0,11
República Checa			229.827	0,08
320.000	EUR	CPI Property Group 27/01/31, 1.50%	229.827	0,08
Ecuador			396.467	0,14
140.000	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/2030, 6.00%	95.366	0,03
616.000	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/2040, 2.50%	301.101	0,11
Egipto			262.683	0,09
330.000	USD	Egypt Government International Bond 31/01/47, 8.50%	262.683	0,09

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Helix (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Gabón				
330.000	USD	Gabon Government International Bond 06/02/31, 6.63%	282.373	0,10
Costa de Marfil				
470.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5.88%	470.063	0,16
140.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 30/01/32, 4.88%	130.705	0,05
México				
5.700.000	MXN	Mexican Bonos 18/11/38, 8.50%	318.910	0,11
4.610.000	MXN	Mexican Bonos 13/11/42, 7.75%	235.662	0,08
5.870.000	MXN	Mexican Bonos 07/11/47, 8.00%	304.646	0,11
Nigeria				
480.000	USD	Nigeria Government International Bond 24/03/29, 8.38%	469.400	0,17
Pakistán				
230.000	USD	Pakistan Government International Bond 08/04/51, 8.88%	173.898	0,06
Sudáfrica				
6.500.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	286.654	0,10
6.540.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	275.777	0,10
1.730.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8.50%	67.505	0,02
3.870.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/40, 9.00%	151.050	0,05
420.000	USD	Sasol Financing USA 18/03/31, 5.50%	354.306	0,14
Supranacional				
140.000.000	NGN	Asian Development Bank 03/01/25, 20.00%	110.895	0,04
20.000.000	ARS	European Bank for Reconstruction & Development 28/05/24, 175.00%	20.310	0,01
Turquía				
			205.326	0,07

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
200.000	USD	Pegasus Hava Tasimaciligi 30/04/26, 9.25%	205.326	0,07
Total Bonos			6.883.109	2,44
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			207.370.512	73,49

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Argentina				
229.000	USD	YPF 17/01/31, 9.50%	234.100	0,08
Brasil				
456.361	USD	MC Brazil Downstream Trading 30/06/31, 7.25%	413.883	0,15
Egipto				
1.000.000	EGP	Egypt Treasury Bills 10/12/24, ZCP	17.422	0,01
24.000.000	EGP	Egypt Treasury Bills 18/03/25, ZCP	392.935	0,14
Estados Unidos				
8.150.300	USD	United States Treasury Bill 04/04/24, ZCP	8.143.230	2,88
7.129.800	USD	United States Treasury Bill 11/04/24, ZCP	7.116.483	2,52
50.900	USD	United States Treasury Bill 18/04/24, ZCP	50.754	0,02
1.014.500	USD	United States Treasury Bill 25/04/24, ZCP	1.010.555	0,36
50.700	USD	United States Treasury Bill 09/05/24, ZCP	50.398	0,02
50.700	USD	United States Treasury Bill 16/05/24, ZCP	50.349	0,02
50.500	USD	United States Treasury Bill 23/05/24, ZCP	50.095	0,02
1.009.400	USD	United States Treasury Bill 30/05/24, ZCP	1.000.292	0,35
Zambia				
300.000	USD	First Quantum Minerals 01/06/31, 8.63%	291.965	0,10
Total Bonos			18.822.461	6,67
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados			18.822.461	6,67

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Helix (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Participaciones en planes de inversión abiertos	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Luxemburgo			20.543.553	7,28
100.000	USD	Schroder GAIA Asian Equity Long Short	11.535.001	4,09
3699	USD	Schroder ISF - China A	430.570	0,15
19.312	USD	Schroder ISF Indian Equity	8.577.982	3,04
Total Participaciones en planes de inversión abiertos			20.543.553	7,28

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Otros valores	Valor de mercado USD	% patrimonio neto
Bonos				
Islas Vírgenes Británicas			-	-
100.339	USD	Noventiq Holdings	-	-
Total Bonos			-	-
Total Otros valores			-	-
Total Inversiones			246.736.526	87,44
Otros activos netos			35.430.156	12,56
Valor liquidativo			282.166.682	100,00

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Oaktree Credit

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Argentina			479.482	0,63
388.842	USD	YPF 27/06/29, 8.50%	358.577	0,47
122.000	USD	YPF Energia Electrica 25/07/26, 10.00%	120.905	0,16
Bélgica			102.558	0,14
100.000	EUR	Umicore 23/06/25, ZCP	102.558	0,14
Canadá			207.966	0,27
200.000	EUR	Primo Water Holdings 31/10/28, 3.88%	207.966	0,27
Francia			1.802.177	2,38
300.000	EUR	Accor perpetual, variable	356.701	0,47
22.616	EUR	Accor 07/12/27, 0.70%	26.735	0,04
200.000	EUR	Afflelou 19/05/26, 4.25%	214.967	0,28
200.000	EUR	Altice France 15/07/29, 4.00%	151.848	0,20
220.000	EUR	Banijay Entertainment 01/05/29, 7.00%	249.651	0,33
55.849	EUR	Edenred 14/06/28, ZCP	58.759	0,08
200.000	EUR	Electricite de France perpetual, variable	234.284	0,31
200.000	EUR	Iliad Holding 15/10/28, 5.63%	214.161	0,28
200.000	EUR	iliad 15/02/29, 5.38%	219.949	0,29
27.134	EUR	Safran 01/04/28, ZCP	36.785	0,05
6102	EUR	SOITEC 01/10/25, ZCP	6655	0,01
27.886	EUR	Veolia Environnement 01/01/25, ZCP	31.682	0,04
Alemania			1.942.727	2,56
280.000	EUR	Cheplapharm Arzneimittel 15/05/30, 7.50%	319.648	0,43
265.000	EUR	Douglas Service 08/04/26, 6.00%	290.460	0,38
215.000	EUR	IHO Verwaltungen 15/05/28, 8.75%	251.785	0,33
200.000	EUR	Nidda Healthcare Holding 21/08/26, 7.50%	222.764	0,29
180.236	EUR	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 30/07/26, 6.00%	194.510	0,26
230.000	EUR	TUI Cruises 15/05/26, 6.50%	250.620	0,33
200.000	EUR	WEPA Hygieneprodukte 15/12/27, 2.88%	202.693	0,27
100.000	EUR	Zalando 06/08/25, 0.05%	101.631	0,13
100.000	EUR	ZF Europe Finance 31/01/29, 4.75%	108.616	0,14
Italia			1.207.835	1,59
210.000	EUR	Cerved Group 15/02/29, variable	219.066	0,29

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
100.000	EUR	DiaSorin 05/05/28, ZCP	91.322	0,12
200.000	EUR	Engineering-Ingegneria Informatica 30/09/26, 5.88%	212.942	0,28
210.000	EUR	Lottomatica 01/06/28, 7.13%	239.547	0,31
200.000	EUR	Mooney Group 17/12/26, variable	216.309	0,29
200.000	EUR	Telecom Italia 15/02/28, 6.88%	228.649	0,30
Japón			64.325	0,08
10.000.000	JPY	Park24 24/02/28, ZCP	64.325	0,08
Luxemburgo			875.754	1,16
200.000	EUR	Altice Financing 15/01/28, 3.00%	177.520	0,23
230.000	EUR	Eurofins Scientific perpetual, variable	260.852	0,35
205.000	EUR	INEOS Finance 15/05/28, 6.63%	225.118	0,30
200.000	EUR	Summer BC Holdco B 31/10/26, 5.75%	212.264	0,28
Países Bajos			951.751	1,26
300.000	GBP	Boost Newco Borrower 15/01/31, 8.50%	409.406	0,54
110.000	EUR	Q-Park Holding I 01/03/26, variable	119.143	0,16
210.000	EUR	TMNL Holding 15/01/29, 3.75%	213.384	0,28
200.000	EUR	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 3.75%	209.818	0,28
España			855.518	1,13
100.000	EUR	Cellnex Telecom 05/07/28, 0.50%	112.390	0,15
170.000	EUR	Cirsa Finance International 31/07/28, 7.88%	194.639	0,26
210.000	EUR	Lorca Telecom Bondco 18/09/27, 4.00%	220.263	0,30
100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variable	101.783	0,13
100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variable	109.320	0,14
100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variable	117.123	0,15
Suecia			248.184	0,33
100.000	EUR	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden perpetual, variable	26.117	0,03
100.000	EUR	Verisure Holding 15/07/26, 3.88%	106.449	0,14
100.000	EUR	Verisure Holding 15/10/27, 9.25%	115.618	0,16

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Oaktree Credit (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Reino Unido			1.564.000	2,06
200.000	GBP	British Telecommunications 20/12/83, variable	270.207	0,36
195.000	GBP	Heathrow Finance 01/03/31, 6.63%	243.899	0,32
205.000	GBP	Pinewood Finance 30/09/25, 3.25%	254.892	0,34
100.000	GBP	Premier Foods Finance 15/10/26, 3.50%	121.110	0,16
215.000	GBP	Virgin Media Secured Finance 15/05/29, 5.25%	250.281	0,33
200.000	USD	Vodafone Group 03/10/78, variable	199.797	0,26
110.000	EUR	Vodafone Group 27/08/80, variable	107.496	0,14
100.000	EUR	Vodafone Group 30/08/84, variable	116.318	0,15
Estados Unidos			2.343.562	3,10
265.000	EUR	Allied Universal 01/06/28, 3.63%	266.076	0,35
200.000	EUR	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 2.13%	186.515	0,25
5000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/27, 5.25%	3155	-
66.000	USD	Cigna Group 15/05/29, 5.00%	66.094	0,09
340.000	EUR	Clarios Global 15/05/26, 4.38%	365.188	0,49
320.000	EUR	Coty 15/09/28, 5.75%	358.713	0,48
250.000	EUR	EMRLD Borrower 15/12/30, 6.38%	284.064	0,37
85.000	USD	MGIC Investment 15/08/28, 5.25%	82.716	0,11
190.000	USD	MPT Operating Partnership 15/10/27, 5.00%	160.507	0,21
190.000	USD	Oceaneering International 01/02/28, 6.00%	187.269	0,25
210.000	EUR	Silgan Holdings 01/06/28, 2.25%	206.867	0,27
180.000	USD	TransDigm 15/11/27, 5.50%	176.398	0,23
Total Bonos			12.645.839	16,69
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			12.645.839	16,69

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Australia			1.162.968	1,54
30.000	USD	Mineral Resources 01/05/27, 8.13%	30.371	0,04
60.000	USD	Mineral Resources 01/10/28, 9.25%	63.208	0,08
125.000	USD	Mineral Resources 01/05/30, 8.50%	128.979	0,17
218.546	AUD	Ruby Bond Trust 12/03/53, variable	142.809	0,19
226.887	AUD	Ruby Bond Trust Series 2021-1 12/03/53, variable	147.315	0,19
500.000	AUD	Ruby Bond Trust 14/01/54, variable	325.191	0,44
500.000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2022-1 14/01/54, variable	325.095	0,43
Bélgica			377.347	0,50
400.000	USD	Telenet Finance Luxembourg Notes 01/03/28, 5.50%	377.347	0,50
Bermudas			1.009.831	1,33
100.000	USD	AREIT 17/08/41, variable	99.874	0,13
400.000	USD	Home Re 25/01/34, variable	405.504	0,54
500.000	USD	RR 24 15/01/36, variable	504.453	0,66
Brasil			554.971	0,73
200.000	USD	Azul Secured Finance 28/05/30, 10.88%	169.299	0,22
200.000	USD	Braskem Netherlands Finance 23/01/81, variable	200.527	0,27
205.000	USD	Samarco Mineracao 30/06/31, 9.50%	185.145	0,24
Canadá			1.429.242	1,89
198.000	USD	Bombardier 15/06/26, 7.13%	201.084	0,27
100.000	USD	Bombardier 15/02/28, 6.00%	98.488	0,13
105.000	USD	Bombardier 15/11/30, 8.75%	112.262	0,15
405.000	USD	Cascades 15/01/28, 5.38%	389.434	0,51
23.000	USD	First Majestic Silver 15/01/27, 0.38%	17.954	0,02
300.000	USD	Intelligent Packaging 15/09/28, 6.00%	285.353	0,38
179.000	USD	Precision Drilling 15/01/26, 7.13%	179.305	0,24
145.000	USD	Strathcona Resources 01/08/26, 6.88%	145.362	0,19
Islas Caimán			5.278.023	6,97
250.000	USD	ACAM 17/11/34, variable	238.483	0,31

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Oaktree Credit (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
250.000	USD	ACAM Series 2019-FL1 17/11/34, variable	249.615	0,33	250.000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund 15/01/37, variable	312.705	0,41
1.124.599	USD	Falcon Aerospace 15/09/39, 6.66%	466.720	0,62	102.507	EUR	Frost CMBS DAC 20/11/33, variable	102.795	0,14
375.000	USD	ICG US CLO 16/01/33, variable	327.900	0,43	98.536	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variable	116.810	0,15
375.000	USD	Marble Point CLO XV 23/07/32, variable	349.109	0,46	107.404	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variable	125.270	0,17
250.000	USD	MP CLO VIII 28/04/34, variable	247.054	0,33	375.000	EUR	Goldentree Loan Management CLO 4 DAC 20/07/34, variable	401.411	0,53
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI 20/07/34, variable	244.379	0,32	800.000	EUR	ICG Euro CLO 19/04/36, variable	879.535	1,17
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI Series 2021-11A 20/07/34, variable	244.989	0,32	100.000	GBP	Last Mile Logistics CMBS UK DAC 17/08/33, variable	126.253	0,17
448.849	USD	Pioneer Aircraft Finance 15/06/44, 3.97%	415.676	0,55	174.770	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 17/08/33, variable	176.437	0,23
1.116.071	USD	Thunderbolt II Aircraft Lease 15/09/38, variable	783.124	1,03	550.821	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance Series 1A 17/08/33, variable	563.887	0,74
375.000	USD	Trinitas CLO XVI 20/07/34, variable	368.284	0,49	375.000	EUR	Palmer Square European CLO DAC 15/04/35, variable	397.621	0,52
1.000.000	USD	Trinitas CLO XVIII 20/01/35, variable	970.486	1,29	300.000	EUR	Penta CLO 10 DAC 20/11/34, variable	319.370	0,42
400.000	USD	TRTX Issuer 15/03/38, variable	372.204	0,49	375.000	EUR	Segovia European CLO 20/07/32, variable	403.163	0,53
Chile			28.892	0,04	250.000	EUR	St Paul's CLO VII DAC 18/07/34, variable	266.290	0,35
25.000	USD	Latam Airlines Group 15/10/29, 13.38%	28.892	0,04	310.000	GBP	Taurus UK DAC 17/05/31, variable	364.466	0,48
China			16.221	0,02	191.173	GBP	Taurus UK DAC 17/08/31, variable	235.392	0,31
14.000	USD	H World Group 01/05/26, 3.00%	16.221	0,02	500.000	EUR	Tikehau CLO VIII DAC 25/10/34, variable	532.982	0,70
Dinamarca			11.555	0,02	375.000	EUR	Vendome Funding CLO DAC 20/07/34, variable	385.928	0,51
10.000	USD	Ascendis Pharma 01/04/28, 2.25%	11.555	0,02	Israel			13.618	0,02
Hong Kong			210.522	0,28	13.000	USD	Nice 15/09/25, ZCP	13.618	0,02
240.000	USD	Seaspan 01/08/29, 5.50%	210.522	0,28	Jersey, Islas Anglonormandas			502.224	0,66
India			241.967	0,32	500.000	USD	ICG US CLO 18/07/36, variable	502.224	0,66
94.000	USD	Vedanta Resources Finance II 21/01/27, 13.88%	88.438	0,12	Luxemburgo			298.433	0,39
168.000	USD	Vedanta Resources Finance II 09/12/28, 13.88%	153.529	0,20	325.000	USD	ION Trading Technologies 15/05/28, 5.75%	298.433	0,39
Irlanda			8.295.687	10,94	México			155.455	0,21
375.000	EUR	Ares European CLO XII DAC 20/04/32, variable	402.210	0,53	200.000	USD	Braskem Idesa 20/02/32, 6.99%	155.455	0,21
750.000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 15/04/32, variable	797.829	1,05	Singapur			49.719	0,07
750.000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 19/10/34, variable	803.175	1,06	5000	USD	Sea 01/12/25, 2.38%	5025	0,01
550.000	EUR	BBAM European CLO I DAC 22/07/34, variable	582.158	0,77					

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Oaktree Credit (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
52.000	USD	Sea 15/09/26, 0.25%	44.694	0,06	50.000	USD	Bausch Health 01/02/27, 6.13%	31.202	0,04
Reino Unido			113.595	0,15	55.000	USD	Bausch Health 01/06/28, 4.88%	30.067	0,04
100.000	GBP	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 15/07/28, 4.88%	113.595	0,15	375.000	USD	BellRing Brands 15/03/30, 7.00%	386.690	0,51
Estados Unidos			38.287.389	50,53	280.137	USD	Blackbird Capital Aircraft 15/07/46, 2.44%	246.983	0,33
195.000	USD	Academy 15/11/27, 6.00%	192.795	0,25	15.000	USD	Blackline 15/03/26, ZCP	13.647	0,02
300.000	USD	Acuris Finance US 01/05/28, 5.00%	272.823	0,36	370.000	USD	Bloomin' Brands 15/04/29, 5.13%	344.100	0,45
12.000	USD	Advanced Energy Industries 15/09/28, 2.50%	12.263	0,02	135.000	USD	Boost Newco Borrower 15/01/31, 7.50%	141.492	0,19
14.000	USD	Akamai Technologies 01/09/27, 0.38%	14.805	0,02	6000	USD	Bridgebio Pharma 15/03/27, 2.50%	6458	0,01
29.000	USD	Alarm.com Holdings 15/01/26, ZCP	26.695	0,04	11.000	USD	Bridgebio Pharma 01/02/29, 2.25%	9013	0,01
310.000	USD	Albertsons 15/02/28, 5.88%	307.142	0,41	320.000	USD	Brinker International 15/07/30, 8.25%	337.429	0,45
60.000	USD	Albertsons 15/02/30, 4.88%	57.130	0,08	250.000	USD	BRSP 19/08/38, variable	227.323	0,30
82.000	USD	Alliant Energy 15/03/26, 3.88%	81.057	0,11	10.000	USD	Burlington Stores 15/12/27, 1.25%	12.780	0,02
135.000	USD	Allied Universal 01/06/28, 4.63%	123.457	0,16	14.000	USD	Cable One 15/03/26, ZCP	12.264	0,02
115.000	USD	Allied Universal Finance 15/07/26, 6.63%	115.055	0,15	125.000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/27, 3.88%	112.361	0,15
170.000	USD	Allied Universal Holdco 15/02/31, 7.88%	172.430	0,23	235.000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/28, 5.63%	196.517	0,26
7000	USD	Alynham Pharmaceuticals 15/09/27, 1.00%	6614	0,01	415.000	USD	Calpine 01/02/29, 4.63%	384.512	0,51
15.000	USD	Alphatec Holdings 01/08/26, 0.75%	15.656	0,02	240.000	USD	Calpine 01/02/31, 5.00%	220.376	0,29
75.000	USD	AMC Networks 15/01/29, 10.25%	75.516	0,10	165.000	USD	Carnival 01/05/29, 6.00%	162.842	0,21
275.000	USD	AMC Networks 15/02/29, 4.25%	195.018	0,26	260.000	USD	Carnival 01/06/30, 10.50%	284.583	0,38
39.000	USD	American Water Capital 15/06/26, 3.63%	38.230	0,05	265.653	USD	Castlelake Aircraft Structured Trust 15/08/41, 2.74%	245.278	0,32
255.000	USD	Amsted Industries 01/07/27, 5.63%	251.383	0,33	105.000	USD	CCO Holdings 01/03/30, 4.75%	90.436	0,12
90.000	USD	APX Group 15/02/27, 6.75%	90.397	0,12	455.000	USD	CCO Holdings 01/06/33, 4.50%	355.786	0,47
250.000	USD	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 15/05/36, variable	237.197	0,31	350.000	USD	Central Parent 15/06/29, 8.00%	363.049	0,48
290.000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 4.13%	262.907	0,35	11.000	USD	Cheesecake Factory 15/06/26, 0.38%	9844	0,01
103.000	USD	AREIT Trust 14/09/36, variable	98.577	0,13	535.000	USD	Churchill Downs 01/05/31, 6.75%	538.702	0,70
9000	USD	Array Technologies 01/12/28, 1.00%	8355	0,01	330.000	USD	CITGO Petroleum 15/06/25, 7.00%	329.908	0,44
305.000	USD	ASP Unifrax Holdings 30/09/28, 5.25%	199.459	0,26	35.000	USD	Citigroup 13/02/30, variable	34.868	0,05
240.000	USD	B&G Foods 15/09/28, 8.00%	250.210	0,33	135.000	USD	Civitas Resources 01/11/30, 8.63%	145.057	0,19
					110.000	USD	Clear Channel Outdoor Holdings 01/04/30, 7.88%	109.442	0,14

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Oaktree Credit (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
460.000	USD	Cloud Software Group 31/03/29, 6.50%	437.056	0,58	41.000	USD	ERAC USA Finance 15/02/29, 5.00%	41.121	0,05
17.000	USD	Cloudflare 15/08/26, ZCP	15.976	0,02	6000	USD	Etsy 01/10/26, 0.13%	6372	0,01
390.000	USD	Cogent Communications Group 15/06/27, 7.00%	388.528	0,51	16.000	USD	Etsy 15/06/28, 0.25%	12.640	0,02
141.000	USD	COLT Mortgage Loan Trust 25/02/69, variable	139.899	0,18	322.000	USD	Everi Holdings 15/07/29, 5.00%	319.212	0,42
45.000	USD	CommScope 01/07/28, 7.13%	17.922	0,02	13.000	USD	Evolent Health 01/12/29, 3.50%	14.960	0,02
225.000	USD	CommScope 01/09/29, 4.75%	161.438	0,21	4000	USD	Exact Sciences 01/03/30, 2.00%	4532	0,01
145.000	USD	CommScope Technologies 15/06/25, 6.00%	126.288	0,17	275.000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/29, 4.63%	252.457	0,33
40.000	USD	Community Health Systems 15/03/27, 5.63%	36.823	0,05	90.000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/30, 6.75%	80.855	0,11
30.000	USD	Community Health Systems 15/01/29, 6.00%	26.229	0,03	285.000	USD	Fiesta Purchaser 01/03/31, 7.88%	294.537	0,39
180.000	USD	Community Health Systems 15/01/32, 10.88%	185.720	0,25	560.000	USD	FirstCash 01/01/30, 5.63%	532.813	0,70
240.000	USD	Compass Group Diversified Holdings 15/01/32, 5.00%	214.752	0,28	100.749	USD	Five Point Operating 15/01/28, 10.50%	103.813	0,14
35.000	USD	Comstock Resources 15/01/30, 5.88%	31.737	0,04	17.000	USD	Five9 15/03/29, 1.00%	17.638	0,02
380.000	USD	Consolidated Communications 01/10/28, 6.50%	332.889	0,44	11.000	USD	Fluor 15/08/29, 1.13%	12.411	0,02
127.000	USD	Coty 15/04/26, 6.50%	127.290	0,17	400.000	USD	FMC GMSR Issuer Trust 25/07/26, variable	353.054	0,47
395.000	USD	CQP 15/06/31, 5.50%	373.481	0,49	29.000	USD	Ford Motor 15/03/26, ZCP	30.117	0,04
75.000	USD	CQP Holdco 15/12/33, 7.50%	77.183	0,10	260.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/08/27, 9.75%	269.444	0,36
265.000	USD	CSC Holdings 01/02/28, 5.38%	228.614	0,30	295.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/05/28, 5.50%	286.112	0,38
240.000	USD	CSC Holdings 01/12/30, 4.13%	171.729	0,23	170.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/12/30, 7.88%	178.698	0,24
240.000	USD	CSC Holdings 15/11/31, 4.50%	170.114	0,22	210.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/28, 5.00%	195.088	0,26
290.000	USD	Cushman & Wakefield US Borrower 01/09/31, 8.88%	306.796	0,40	170.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/29, 6.75%	151.745	0,20
125.000	USD	CVR Energy 15/02/28, 5.75%	117.482	0,16	195.000	USD	Graham Packaging 15/08/28, 7.13%	177.024	0,23
45.000	USD	Dayforce 15/03/26, 0.25%	41.400	0,05	10.000	USD	Green Plains 15/03/27, 2.25%	10.244	0,01
325.000	USD	Directv Financing 15/08/27, 5.88%	307.788	0,41	16.000	USD	Haemonetics 01/03/26, ZCP	14.770	0,02
405.000	USD	Edgewell Personal Care 01/04/29, 4.13%	371.883	0,49	13.000	USD	Halozyme Therapeutics 15/08/28, 1.00%	12.663	0,02
26.000	USD	Envestnet 01/12/27, 2.63%	27.599	0,04	225.000	USD	Hanesbrands 15/02/31, 9.00%	231.397	0,31
510.000	USD	EquipmentShare.com 15/05/28, 9.00%	525.861	0,69					

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Oaktree Credit (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
200.000	USD	HAT Holdings I 15/04/25, 6.00%	199.355	0,26	17.000	USD	Merit Medical Systems 01/02/29, 3.00%	18.590	0,02
375.000	USD	HAT Holdings I 15/06/26, 3.38%	353.636	0,47	295.000	USD	Minerals Technologies 01/07/28, 5.00%	283.536	0,37
80.000	USD	HAT Holdings I 15/09/30, 3.75%	67.283	0,09	9000	USD	MP Materials 01/04/26, 0.25%	7943	0,01
450.000	USD	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow 01/06/29, 5.00%	420.355	0,55	6000	USD	MP Materials 01/03/30, 3.00%	5622	0,01
285.000	USD	Howard Midstream Energy Partners 15/07/28, 8.88%	300.885	0,40	155.000	USD	MPH Acquisition Holdings 01/09/28, 5.50%	131.981	0,17
340.000	USD	HUB International 15/06/30, 7.25%	349.769	0,46	235.000	USD	Nationstar Mortgage Holdings 15/08/28, 5.50%	225.223	0,30
350.000	USD	Hunt 15/04/29, 5.25%	320.485	0,42	120.000	USD	Nationstar Mortgage Holdings 15/11/31, 5.75%	110.815	0,15
405.000	USD	Imola Merger 15/05/29, 4.75%	380.161	0,50	258.408	USD	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 15/03/35, variable	257.076	0,34
6000	USD	Insmed 01/06/28, 0.75%	6441	0,01	15.000	USD	NCL 15/02/27, 1.13%	14.222	0,02
185.000	USD	Iron Mountain 15/03/28, 5.25%	179.158	0,24	340.000	USD	NCR Atleos 01/04/29, 9.50%	364.016	0,48
180.000	USD	Iron Mountain 15/07/28, 5.00%	172.446	0,23	105.000	USD	NCR Voyix 01/10/28, 5.00%	97.917	0,13
345.000	USD	JB Poindexter 15/12/31, 8.75%	357.017	0,47	245.000	USD	NCR Voyix 15/04/29, 5.13%	227.502	0,30
4000	USD	JetBlue Airways 01/04/26, 0.50%	3512	-	210.000	USD	Necessity Retail Real Estate Investment Trust 30/09/28, 4.50%	179.798	0,24
495.000	USD	Kennedy-Wilson 01/02/30, 4.75%	395.706	0,52	500.000	USD	Neptune Bidco US 15/04/29, 9.29%	473.278	0,62
380.000	USD	Kodiak Gas Services 15/02/29, 7.25%	387.446	0,51	20.000	USD	NextEra Energy Capital Holdings 01/03/27, 3.00%	21.430	0,03
145.000	USD	LABL 01/11/28, 5.88%	133.607	0,18	12.000	USD	NRG Energy 01/06/48, 2.75%	19.884	0,03
11.000	USD	Lantheus Holdings 15/12/27, 2.63%	12.207	0,02	25.000	USD	Nutanix 01/10/27, 0.25%	30.750	0,04
375.000	USD	LCM Investments Holdings II 01/08/31, 8.25%	392.569	0,52	370.000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/28, 4.25%	336.177	0,44
375.000	USD	Level 3 Financing 01/07/28, 4.25%	181.605	0,24	135.000	USD	Olympus Water US Holding 15/11/28, 9.75%	143.970	0,19
14.000	USD	Liberty Media-Liberty Formula One 15/08/27, 2.25%	14.387	0,02	17.000	USD	ON Semiconductor 01/03/29, 0.50%	16.813	0,02
12.000	USD	LivaNova USA 15/12/25, 3.00%	13.680	0,02	290.000	USD	OneMain Finance 15/03/26, 7.13%	295.618	0,39
21.000	USD	Live Nation Entertainment 15/01/29, 3.13%	25.292	0,03	13.000	USD	PagerDuty 15/10/28, 1.50%	13.894	0,02
10.000	USD	Lyft 01/03/29, 0.63%	11.731	0,02	27.000	USD	Pebblebrook Hotel Trust 15/12/26, 1.75%	24.351	0,03
600.000	USD	Marriott Ownership Resorts 15/06/29, 4.50%	549.209	0,71	390.000	USD	Pediatrix Medical Group 15/02/30, 5.38%	354.668	0,47
20.000	USD	Marriott Vacations Worldwide 15/12/27, 3.25%	18.860	0,02	28.000	USD	Perficient 15/11/26, 0.13%	24.271	0,03
340.000	USD	Medline Borrower 01/10/29, 5.25%	321.562	0,42	205.000	USD	Performance Food Group 15/10/27, 5.50%	201.330	0,27

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Oaktree Credit (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
125.000	USD	Permian Resources Operating 15/02/26, 7.75%	126.728	0,17	170.000	USD	Standard Industries 15/07/30, 4.38%	152.893	0,20
105.000	USD	Permian Resources Operating 15/01/32, 7.00%	108.997	0,14	110.000	USD	STL Holding 15/02/29, 8.75%	112.998	0,15
21.000	USD	PG&E 01/12/27, 4.25%	21.121	0,03	425.000	USD	Talen Energy Supply 01/06/30, 8.63%	454.796	0,60
360.000	USD	Pike 31/01/31, 8.63%	383.019	0,51	80.000	USD	Tenet Healthcare 01/10/28, 6.13%	79.875	0,11
14.000	USD	Post Holdings 15/08/27, 2.50%	15.778	0,02	12.000	USD	Tetra Tech 15/08/28, 2.25%	13.208	0,02
200.000	USD	Post Holdings 15/01/28, 5.63%	196.594	0,26	95.000	USD	TMS International 15/04/29, 6.25%	86.908	0,11
480.000	USD	Prime Security Services Borrower 15/01/28, 6.25%	470.916	0,62	40.000	USD	Tronox 15/03/29, 4.63%	35.933	0,05
11.000	USD	Progress Software 15/04/26, 1.00%	11.440	0,02	105.000	USD	Uber Technologies 15/09/27, 7.50%	107.587	0,14
293.416	USD	PRPM 25/06/26, variable	286.039	0,38	110.000	USD	Uber Technologies 15/01/28, 6.25%	110.544	0,15
200.000	USD	PRPM 25/09/26, variable	189.518	0,25	12.000	USD	Uber Technologies 01/12/28, 0.88%	14.874	0,02
100.000	USD	PRPM Trust Series 2024-B1 25/12/68, variable	97.830	0,13	1.330.000	USD	United States Treasury Bill 25/04/24, ZCP	1.325.222	1,75
120.000	USD	PRPM Trust Series 2024-M1 25/12/68, variable	119.972	0,16	34.000	USD	Unity Software 15/11/26, ZCP	28.985	0,04
25.000	USD	QVC 15/02/27, 4.75%	22.282	0,03	165.000	USD	Univision Communications 30/06/30, 7.38%	163.161	0,22
10.000	USD	Rexford Industrial Realty 15/03/29, 4.13%	10.130	0,01	80.000	USD	US Foods 01/06/30, 4.63%	74.339	0,10
14.000	USD	Seagate HDD Cayman 01/06/28, 3.50%	17.871	0,02	170.000	USD	Venture Global LNG 01/02/29, 9.50%	183.242	0,24
250.000	USD	Service Properties Trust 15/11/31, 8.63%	266.910	0,35	105.000	USD	Venture Global LNG 01/06/31, 8.38%	108.353	0,14
33.000	USD	Shake Shack 01/03/28, ZCP	30.051	0,04	400.000	USD	Verus Securitization Trust 25/08/67, variable	391.757	0,52
23.000	USD	Shift4 Payments 01/08/27, 0.50%	21.448	0,03	271.000	USD	Verus Securitization Trust 25/06/68, variable	271.168	0,36
11.000	USD	Shockwave Medical 15/08/28, 1.00%	14.094	0,02	91.293	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-A3 25/08/68, variable	91.986	0,12
535.000	USD	Sirius XM Radio 01/07/29, 5.50%	509.887	0,67	1.134.000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-B1 25/08/68, variable	1.136.024	1,49
240.000	USD	Six Flags Entertainment 15/04/27, 5.50%	234.659	0,31	100.000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-M1 25/08/68, variable	100.654	0,13
410.000	USD	SK Invictus Intermediate II 30/10/29, 5.00%	366.165	0,48	189.484	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-A3 25/09/68, variable	191.221	0,25
4000	USD	SoFi Technologies 15/03/29, 1.25%	4036	0,01	174.000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-B1 25/09/68, variable	173.051	0,23
28.000	USD	SolarEdge Technologies 15/09/25, ZCP	25.656	0,03	100.000	USD	Vistra Operations 15/10/31, 7.75%	104.793	0,14
2000	USD	Spirit AeroSystems 01/11/28, 3.25%	2808	-	130.000	USD	Vital Energy 15/04/32, 7.88%	132.295	0,17
295.000	USD	Spirit AeroSystems 15/11/30, 9.75%	330.377	0,44					
17.000	USD	Spotify USA 15/03/26, ZCP	15.649	0,02					
55.000	USD	Standard Industries 15/01/28, 4.75%	52.532	0,07					

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Oaktree Credit (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
121.000	USD	VM Consolidated 15/04/29, 5.50%	116.168	0,15
189.000	USD	VMC Finance 16/06/36, variable	162.585	0,21
520.000	USD	VMC Finance Series 2021-FL4 16/06/36, variable	455.130	0,60
185.000	USD	Wand NewCo 3 30/01/32, 7.63%	191.547	0,25
370.000	USD	Wash Multifamily Acquisition 15/04/26, 5.75%	361.942	0,48
375.000	USD	Watco 15/06/27, 6.50%	371.028	0,49
364.221	USD	WAVE Trust 15/11/42, 3.84%	321.835	0,42
13.000	USD	Wayfair 15/08/26, 1.00%	12.049	0,02
3000	USD	Western Digital 15/11/28, 3.00%	4404	0,01
180.000	USD	Windsor Holdings III 15/06/30, 8.50%	188.914	0,25
Total Bonos			58.037.659	76,61
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados			58.037.659	76,61

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Otros valores	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Islas Caimán			587.845	0,78
668.020	USD	Horizon Aircraft Finance I 15/12/38, 4.46%	587.845	0,78
China			29.714	0,04
200.000	USD	Shimao Group Holdings 15/07/26, 5.60%*	6430	0,01
200.000	USD	Shimao Group Holdings 13/07/30, 4.60%*	8000	0,01
200.000	USD	Sino-Ocean Land Treasure IV 05/05/26, 3.25%*	15.284	0,02
Irlanda			2.247.029	2,96
750.000	EUR	Aurium CLO 18/01/38, variable	819.210	1,08
500.000	EUR	Dryden 27 R Euro CLO DAC 15/04/33, variable	513.458	0,68
250.000	EUR	ICG Euro CLO DAC 15/05/35, variable	270.439	0,36
500.000	EUR	ICG Euro CLO DAC Series 2022-1A 15/05/35, variable	538.033	0,70
100.000	EUR	Rockford Tower Europe CLO DAC 20/04/34, variable	105.889	0,14
Total Bonos			2.864.588	3,78
Total Otros valores			2.864.588	3,78
Total Inversiones			73.548.086	97,08
Otros activos netos			2.209.898	2,92
Valor liquidativo			75.757.984	100,00

* Valor sometido a impago.

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA SEG US Equity

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Renta variable				
Canadá			3.656.160	1,01
47.378	USD	Shopify	3.656.160	1,01
Estados Unidos			305.479.167	84,31
28.856	USD	Amphenol	3.328.540	0,92
211.281	USD	Brown & Brown	18.495.539	5,10
67.316	USD	CDW	17.218.086	4,75
38.405	USD	Clean Harbors	7.731.311	2,13
297.491	USD	Core & Main	17.031.360	4,70
307.599	USD	Dayforce	20.366.130	5,62
46.780	USD	EMCOR Group	16.382.356	4,52
82.080	USD	Entegris	11.535.523	3,18
74.785	USD	ITT	10.173.004	2,81
245.743	USD	Live Nation Entertainment	25.992.236	7,18
33.974	USD	Martin Marietta Materials	20.857.998	5,76
105.864	USD	Middleby	17.021.873	4,70
14.283	USD	Paychex	1.753.952	0,48
10.866	USD	PTC	2.053.022	0,57
79.251	USD	Revvity	8.321.355	2,30
106.866	USD	Rollins	4.944.690	1,36
93.065	USD	Service International	6.906.354	1,91
163.234	USD	Signet Jewelers	16.334.826	4,51
18.039	USD	Teledyne Technologies	7.744.503	2,14
427.561	USD	Tempur Sealy International	24.294.015	6,71
109.576	USD	Toro	10.040.449	2,77
197.673	USD	Trimble	12.722.234	3,51
37.777	USD	Vail Resorts	8.417.849	2,32
108.539	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	15.811.962	4,36
Total Renta variable			309.135.327	85,32
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			309.135.327	85,32

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Estados Unidos			4.912.917	1,36
5.000.000	USD	United States Treasury Bill 08/08/24, ZCP	4.912.917	1,36
Total Bonos			4.912.917	1,36
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados			4.912.917	1,36
Total Inversiones			314.048.244	86,68
Otros activos netos			48.275.503	13,32
Valor liquidativo			362.323.747	100,00

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Sirios US Equity

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Renta variable				
Suiza				
98.900	USD	Alcon	8.237.381	4,36
Taiwán				
39.685	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	5.399.144	2,86
Estados Unidos				
31.216	USD	Abbott Laboratories	3.548.011	1,88
3485	USD	Adobe	1.758.531	0,93
18.276	USD	Advanced Micro Devices	3.298.635	1,75
2468	USD	Alphabet	372.495	0,20
24.647	USD	Amazon.com	4.445.826	2,35
2411	USD	American Express	548.961	0,29
476	USD	Analog Devices	94.148	0,05
19.350	USD	Banc of California	445.437	0,24
11.781	USD	Becton Dickinson	2.915.208	1,54
66.680	USD	Boston Scientific	4.566.913	2,42
118.565	USD	Carlyle Group	5.561.884	2,95
10.061	USD	Clean Harbors	2.025.380	1,07
114.486	USD	Clear Secure	2.435.117	1,29
13.121	USD	CONMED	1.050.730	0,56
8190	USD	Constellation Brands	2.225.714	1,18
1853	USD	CyberArk Software	492.212	0,26
55.929	USD	Delta Air Lines	2.677.321	1,42
4881	USD	DocuSign	290.664	0,15
5040	USD	Eli Lilly	3.920.918	2,08
39.555	USD	General Electric	6.943.090	3,67
33.322	USD	Global Payments	4.453.819	2,36
100.824	USD	Globus Medical	5.408.199	2,86
3354	USD	HCA Healthcare	1.118.660	0,59
38.837	USD	HEICO	5.978.568	3,17
6786	USD	Inari Medical	325.592	0,17
27.256	USD	Ingersoll Rand	2.587.957	1,37
51.417	USD	Intel	2.271.089	1,20
1154	USD	Intuit	750.100	0,40
423	USD	KLA	295.495	0,16
10.066	USD	Lantheus Holdings	626.508	0,33
1400	USD	Marriott International	353.234	0,19
27.463	USD	Medtronic	2.393.400	1,27
9500	USD	Meta Platforms	4.613.010	2,44
11.156	USD	Microsoft	4.693.552	2,49
4693	USD	Natera	429.222	0,23
4203	USD	NVIDIA	3.797.663	2,01

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
12.336	USD	Old Dominion Freight Line	2.705.408	1,43
30.414	USD	PACCAR	3.767.990	2,00
1158	USD	Palo Alto Networks	329.023	0,17
1745	USD	Procter & Gamble	283.126	0,15
738	USD	PVH	103.770	0,05
90.296	USD	Riskified	488.501	0,26
10.841	USD	Roper Technologies	6.080.067	3,21
1756	USD	Ross Stores	257.711	0,14
20.952	USD	Royal Caribbean Cruises	2.912.538	1,54
3059	USD	S&P Global	1.301.452	0,69
871	USD	Sherwin-Williams	302.524	0,16
1026	USD	Simply Good Foods	34.915	0,02
1583	USD	Skechers USA	96.975	0,05
67.090	USD	Smartsheet	2.582.965	1,37
14.389	USD	Tenable Holdings	711.248	0,38
5409	USD	Tenet Healthcare	568.540	0,30
11.931	USD	T-Mobile US	1.947.378	1,03
23.851	USD	Uber Technologies	1.836.288	0,97
15.576	USD	Union Pacific	3.830.606	2,03
5596	USD	US Foods Holding	302.016	0,16
3751	USD	Walmart	225.698	0,12
11.140	USD	Waste Connections	1.916.191	1,01
32.999	USD	Wells Fargo	1.912.622	1,01
2752	USD	Workday	750.608	0,40
Total Renta variable			138.597.948	73,39
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			138.597.948	73,39

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Estados Unidos				
35.000.000	USD	United States Treasury Bill 16/05/24, ZCP	34.757.333	18,41
Total Bonos			34.757.333	18,41
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados			34.757.333	18,41
Total Inversiones			173.355.281	91,80
Otros activos netos			15.484.340	8,20
Valor liquidativo			188.839.621	100,00

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Alemania			69.387	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4.25%	13.228	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4.75%	14.063	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3.25%	12.001	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2.50%	10.816	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2.50%	10.840	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1.25%	8439	-
Estados Unidos			22.565	0,01
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2.50%	7328	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3.00%	7989	0,01
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2.50%	7248	-
Total Bonos			91.952	0,02
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			91.952	0,02

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Estados Unidos			22.989	0,01
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2.88%	7800	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3.00%	7959	0,01
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2.50%	7230	-
Total Bonos			22.989	0,01
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados			22.989	0,01

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Participaciones en planes de inversión abiertos	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Luxemburgo				
5.000.000	USD	JPMorgan Liquidity Funds-US Dollar Treasury Liquidity Fund	5.000.000	1,30
Total Participaciones en planes de inversión abiertos			5.000.000	1,30
Total Inversiones			5.114.941	1,33

Depósitos a plazo				
Finanzas			240.837.000	62,61
56.000.000	USD	Banque NA 01/04/24, 5.30%	56.000.000	14,55
55.000.000	USD	Credit Agricole 01/04/24, 5.30%	55.000.000	14,30
55.837.000	USD	JPMorgan Chase Bank 01/04/24, 5.30%	55.837.000	14,52
18.000.000	USD	Mizuho Bank 01/04/24, 5.32%	18.000.000	4,68
56.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank 01/04/24, 5.30%	56.000.000	14,56
Total Depósitos a plazo			240.837.000	62,61
Otros activos netos			138.683.377	36,06
Valor liquidativo			384.635.318	100,00

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Renta variable				
Australia			1.064.605	0,33
193.771	GBP	Glencore	1.064.605	0,33
Austria			2.030.196	0,64
16.494	EUR	Addiko Bank	319.412	0,10
22.819	EUR	BAWAG Group	1.445.094	0,46
5963	EUR	Erste Group Bank	265.690	0,08
Bélgica			492.454	0,15
3025	USD	Galapagos	97.405	0,03
4464	EUR	KBC Group	334.326	0,10
492	EUR	UCB	60.723	0,02
Brasil			202.743	0,06
117.488	BRL	Hapvida Participacoes e Investimentos	86.674	0,03
23.000	BRL	Rede D'Or Sao Luiz	116.069	0,03
Canadá			8.961.224	2,82
124.298	CAD	Advantage Energy	906.622	0,28
114.624	CAD	ARC Resources	2.043.608	0,65
6318	USD	Canadian Natural Resources	482.190	0,15
34.615	USD	Cenovus Energy	691.954	0,22
3200	USD	Clementia Pharmaceuticals	-	-
13.529	CAD	Crew Energy	46.443	0,01
76.952	CAD	Enerplus	1.511.714	0,48
12.497	CAD	Headwater Exploration	70.763	0,02
71.681	CAD	Kelt Exploration	320.158	0,10
22.518	CAD	MEG Energy	517.006	0,16
74.604	CAD	NuVista Energy	654.310	0,21
90.877	CAD	Peyto Exploration & Development	1.001.656	0,31
6042	CAD	Rogers Communications	247.559	0,08
2823	USD	Shopify	217.851	0,07
1467	USD	Teck Resources	67.159	0,02
4233	USD	Xenon Pharmaceuticals	182.231	0,06
Chile			49.329	0,02
4821	CAD	Lundin Mining	49.329	0,02
China			1.214.630	0,38
17.777	HKD	Alibaba Group Holding	159.557	0,05
2600	CNH	Contemporary Amperex Technology	67.586	0,02
337.000	HKD	CSC Financial	255.325	0,08
5488	HKD	ENN Energy Holdings	42.281	0,01
8785	USD	KE Holdings	120.618	0,04
7000	HKD	Keymed Biosciences	30.319	0,01

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
69.000	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer	43.021	0,01
7400	HKD	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical	146.546	0,05
6264	HKD	Tencent Holdings	243.136	0,08
4900	CNH	WuXi AppTec	31.732	0,01
4651	USD	Zai Lab	74.509	0,02
Dinamarca			1.166.627	0,37
181.520	DKK	Alm Brand	345.510	0,11
2707	USD	Ascendis Pharma	409.217	0,13
522	DKK	Genmab	157.343	0,05
5966	DKK	Topdanmark	254.557	0,08
Francia			3.921.906	1,23
10.087	EUR	ALD	71.279	0,02
967	EUR	Dassault Aviation	212.823	0,07
2387	EUR	Engie	39.942	0,01
5791	EUR	Legrand	613.641	0,19
824	EUR	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton	741.136	0,23
7699	EUR	Renault	388.682	0,12
58.529	EUR	Societe Generale	1.566.603	0,50
2483	EUR	TotalEnergies	170.022	0,05
5597	EUR	Ubisoft Entertainment	117.778	0,04
Alemania			4.088.698	1,28
889	EUR	Allianz	266.437	0,08
41.604	EUR	Commerzbank	571.379	0,18
43.762	EUR	Deutsche Bank	688.455	0,22
21.654	USD	Immatics	227.584	0,07
752	EUR	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft in Muenchen	366.949	0,12
648	EUR	Rheinmetall	364.228	0,11
1641	EUR	RWE	55.697	0,02
3480	EUR	SAP	677.519	0,21
97.954	GBP	Sirius Real Estate	121.098	0,04
9463	EUR	Talanx	749.352	0,23
Grecia			539.032	0,17
128.905	EUR	Piraeus Financial Holdings	539.032	0,17
Irlanda			672.910	0,21
110.285	EUR	AIB Group	559.686	0,17
4571	USD	Prothena	113.224	0,04
Italia			3.333.841	1,05
38.644	EUR	Banca Mediolanum	424.415	0,13
155.996	EUR	Banca Monte dei Paschi di Siena	706.844	0,22

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto		
74.867	EUR	Banco BPM	498.191	0,16	España					2.127.848	0,67
4020	EUR	BFF Bank	53.779	0,02	327.330	EUR	Banco de Sabadell	513.819	0,16		
1664	EUR	DiaSorin	160.671	0,05	60.964	EUR	Iberdrola	756.037	0,24		
27.916	EUR	FinecoBank Banca Fineco	418.177	0,13	411.509	EUR	Linea Directa Aseguradora Cia de Seguros y Reaseguros	410.660	0,13		
2170	USD	Stevanato Group	69.657	0,02	8419	EUR	Merlin Properties Socimi	90.601	0,03		
26.407	EUR	UniCredit	1.002.107	0,32	288.281	EUR	Unicaja Banco	356.731	0,11		
Japón			5.138.514	1,61	Suecia					231.002	0,07
4633	JPY	Bank of Nagoya	198.015	0,06	13.775	SEK	Fabegge	128.819	0,04		
50.876	JPY	Chiba Bank	422.622	0,13	5152	SEK	Swedbank	102.183	0,03		
8735	JPY	Chugai Pharmaceutical	332.712	0,10	Suiza					1.794.359	0,56
61.758	JPY	Concordia Financial Group	309.728	0,10	4240	CHF	Alcon	351.386	0,11		
2684	JPY	Daiichi Sankyo	85.070	0,03	3284	CHF	Galderma Group	230.683	0,07		
3700	JPY	Hachijuni Bank	24.894	0,01	4234	CHF	Novartis	410.184	0,13		
4000	JPY	Hokuhoku Financial Group	50.469	0,02	10.977	USD	On Holding	388.366	0,12		
39.712	JPY	Japan Post Insurance	758.012	0,23	13.451	CHF	UBS Group	413.740	0,13		
3316	JPY	M&A Capital Partners	48.914	0,02	Reino Unido					5.449.775	1,71
67.303	JPY	Mebuki Financial Group	220.475	0,07	7644	GBP	AstraZeneca	1.030.199	0,33		
7000	JPY	Otsuka Holdings	289.979	0,09	19.520	USD	Autolus Therapeutics	124.538	0,04		
24.443	JPY	Rakuten Bank	486.826	0,15	53.135	GBP	Aviva	333.042	0,10		
26.993	JPY	Shiga Bank	743.565	0,23	423.997	GBP	Barclays	980.390	0,31		
4565	JPY	Sony Group	389.916	0,12	40.202	GBP	Beazley	337.681	0,11		
9700	JPY	Sumitomo Mitsui Financial Group	565.929	0,18	31.588	GBP	BP	197.630	0,06		
5800	JPY	Sumitomo Mitsui Trust Holdings	124.828	0,04	102.315	GBP	Deliveroo	152.769	0,05		
35.900	JPY	Tochigi Bank	86.560	0,03	20.825	GBP	Entain	209.591	0,07		
Jersey			1.563.887	0,49	334	GBP	Genus	7441	-		
29.177	USD	WisdomTree Brent Crude Oil	1.563.887	0,49	1422	USD	Immunocore Holdings	92.430	0,03		
Macao			178.868	0,06	18.102	GBP	Intermediate Capital Group	469.286	0,15		
107.032	HKD	MGM China Holdings	178.868	0,06	328.176	GBP	Lloyds Banking Group	214.394	0,07		
Países Bajos			2.036.298	0,64	108.902	GBP	NewRiver Real Estate Investment Trust	111.198	0,03		
1155	USD	Argenx	454.747	0,14	12.524	GBP	Segro	142.865	0,04		
228	USD	ASML Holding	221.267	0,07	68.902	GBP	Standard Chartered	583.880	0,18		
43.920	EUR	ING Groep	722.403	0,23	8506	USD	Verona Pharma	136.862	0,04		
5881	USD	Merus	264.821	0,08	27.779	GBP	Wise	325.579	0,10		
11.260	GBP	Shell	373.060	0,12	Estados Unidos					63.811.843	20,06
Noruega			495.303	0,16	3273	USD	Abbott Laboratories	372.009	0,12		
4686	USD	Seadrill	235.706	0,08	697	USD	Abercrombie & Fitch	87.355	0,03		
14.823	NOK	Storebrand	136.536	0,04	3412	USD	Acadia Healthcare	270.299	0,08		
11.303	NOK	TGS	123.061	0,04	1140	USD	Addus HomeCare	117.808	0,04		
Singapur			193.546	0,06	35.112	USD	agilon health	214.183	0,07		
61.639	USD	Grab Holdings	193.546	0,06	11.982	USD	Akero Therapeutics	302.665	0,10		
Corea del Sur			187.362	0,06	580	USD	Align Technology	190.194	0,06		
126	USD	Samsung Electronics	187.362	0,06	21.142	USD	Alignment Healthcare	104.864	0,03		
					11.391	USD	Alkermes	308.354	0,10		
					1743	USD	Alliant Energy	87.847	0,03		
					4023	USD	Alnylam Pharmaceuticals	601.237	0,19		

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto	Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
4627	USD	Alphabet	698.353	0,22	660	USD	Elastic	66.158	0,02
6592	USD	Amazon.com	1.189.065	0,37	5254	USD	elf Beauty	1.029.942	0,32
3387	USD	American Electric Power	291.621	0,09	990	USD	Eli Lilly	770.180	0,24
12.029	USD	American Express	2.738.883	0,87	617	USD	Enphase Energy	74.645	0,02
47.716	USD	Antero Resources	1.383.764	0,43	1237	USD	EOG Resources	158.138	0,05
7125	USD	Apellis Pharmaceuticals	418.808	0,13	27.818	USD	EQT	1.031.213	0,32
951	USD	Apogee Therapeutics	63.194	0,02	13.946	USD	Equitrans Midstream	174.186	0,05
18.361	USD	Ares Management	2.441.646	0,78	657	USD	Evercore	126.532	0,04
4544	USD	Atmos Energy	540.145	0,17	6652	USD	Exact Sciences	459.387	0,14
4863	USD	AtriCure	147.932	0,05	6125	USD	Exelon	230.116	0,07
5050	USD	AZEK	253.611	0,08	327	USD	Expedia Group	45.044	0,01
14.078	USD	Bank of America	533.838	0,17	7263	USD	Exxon Mobil	844.251	0,27
996	USD	Biogen	214.767	0,07	2125	USD	First Solar	358.700	0,11
2166	USD	BJ's Wholesale Club Holdings	163.858	0,05	19.116	USD	Flex	546.909	0,17
833	USD	Block	70.455	0,02	2557	USD	Freeport-McMoRan	120.230	0,04
2018	USD	Blueprint Medicines	191.427	0,06	149	USD	Freshpet	17.263	0,01
888	USD	Builders FirstSource	185.192	0,06	665	USD	GE Vernova	90.939	0,03
588	USD	Burlington Stores	136.528	0,04	7185	USD	Golden Entertainment	264.624	0,08
922	USD	Cactus	46.183	0,01	1858	USD	Goldman Sachs Group	776.068	0,24
824	USD	Capital One Financial	122.685	0,04	4059	GBP	GSK	87.533	0,03
7605	USD	Cargo Therapeutics	169.744	0,05	13.179	USD	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital	374.284	0,12
940	USD	Celldex Therapeutics	39.452	0,01	1783	USD	HCA Healthcare	594.684	0,19
4700	USD	Celsius Holdings	389.724	0,12	4637	USD	Health Catalyst	34.917	0,01
4641	USD	Centene	364.226	0,11	715	USD	Humana	247.905	0,08
2450	USD	CG oncology	107.555	0,03	269	USD	ICON	90.371	0,03
13.116	USD	Chesapeake Energy	1.165.094	0,37	517	USD	Insulet	88.614	0,03
12	USD	Chipotle Mexican Grill	34.881	0,01	945	USD	Intuitive Surgical	377.140	0,12
4196	USD	Chord Energy	747.895	0,24	5757	USD	Ionis Pharmaceuticals	249.566	0,08
193	USD	Citigroup	12.205	-	3854	USD	JPMorgan Chase	771.956	0,24
16.948	USD	Comstock Resources	157.277	0,05	28.903	USD	KKR	2.907.064	0,92
8062	USD	ConocoPhillips	1.026.131	0,32	2560	USD	Kodiak Gas Services	69.990	0,02
15.459	USD	Coterra Energy	430.997	0,14	2674	USD	Kymera Therapeutics	107.495	0,03
5777	USD	Crinetics Pharmaceuticals	270.421	0,08	2145	USD	Kyverna Therapeutics	53.282	0,02
7447	USD	Cytokinetics	522.109	0,16	95	USD	Laboratory of America Holdings	20.754	0,01
750	USD	Danaher	187.290	0,06	2075	USD	Legend Biotech	116.387	0,04
7175	USD	Denali Therapeutics	147.231	0,05	5939	USD	Liberty Media-Liberty Formula One	389.598	0,12
1616	USD	Dexcom	224.139	0,07	5745	USD	Live Nation Entertainment	607.649	0,19
4829	USD	Diamond Offshore Drilling	65.868	0,02	8640	USD	Longboard Pharmaceuticals	186.624	0,06
10.812	USD	Diamondback Energy	2.142.614	0,68	187	USD	Lululemon Athletica	73.052	0,02
930	USD	Disc Medicine	57.902	0,02	370	USD	Maplebear	13.797	-
8763	USD	Dominion Energy	431.052	0,14	3594	USD	Marathon Oil	101.854	0,03
1746	USD	DoubleVerify Holdings	61.389	0,02	812	USD	Marathon Petroleum	163.618	0,05
5757	USD	DraftKings	261.425	0,08	16.867	USD	Matador Resources	1.126.210	0,35
4039	USD	Edison International	285.678	0,09					
2123	USD	Elanco Animal Health	34.562	0,01					

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Sudáfrica				
43.745.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8.50%	1.706.609	0,54
Supranacional			1.322.156	0,42
127.500.000	ZAR	Asian Development Bank 30/04/40, ZCP	1.100.680	0,35
13.000.000	TRY	European Bank for Reconstruction & Development 15/10/26, ZCP	173.286	0,05
3.800.000	TRY	International Finance 09/05/27, ZCP	48.190	0,02
Estados Unidos			204.539	0,06
287.000	USD	Williams 15/10/51, 3.50%	204.539	0,06
Total Bonos			6.211.493	1,95
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización en una bolsa de valores oficial			117.158.293	36,81

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Bonos				
Japón				
1.418.950.000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 01/07/24, ZCP	9.373.782	2,95
Reino Unido			540.601	0,17
517.000	USD	Immunocore Holdings 01/02/30, 2.50%	540.601	0,17
Estados Unidos			142.771.675	44,86
1.308.000	USD	Ardagh Holdings USA 30/04/25, 5.25%	1.266.261	0,41
1.330.000	USD	Citigroup perpetual, variable	1.278.542	0,41
255.000	USD	Diamond Foreign Asset 01/10/30, 8.50%	269.274	0,08
1.115.000	USD	Energy Transfer 15/05/54, variable	1.170.596	0,38
626.000	USD	Five9 15/03/29, 1.00%	649.475	0,20
1.280.000	USD	Frontier Communications Holdings 15/05/30, 8.75%	1.310.588	0,42
755.000	USD	Liberty Mutual Group 15/12/51, variable	683.313	0,21
510.000	USD	NextEra Energy Capital Holdings 01/03/27, 3.00%	546.465	0,17
952.000	USD	Rexford Industrial Realty 15/03/27, 4.38%	964.485	0,30
952.000	USD	Rexford Industrial Realty 15/03/29, 4.13%	964.353	0,30

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
56.000	USD	Sunnova Energy 01/09/26, 5.88%	43.803	0,01
141.000	USD	Sunnova Energy International 15/02/28, 2.63%	57.450	0,02
88.000	USD	Sunrun 01/02/26, ZCP	75.328	0,02
72.000	USD	Sunrun 01/03/30, 4.00%	71.981	0,02
400.000	USD	Tidewater 03/07/28, 10.38%	428.000	0,13
13.215.000	USD	United States Treasury Bill 02/04/24, ZCP	13.207.265	4,15
10.450.000	USD	United States Treasury Bill 04/04/24, ZCP	10.440.804	3,28
19.735.000	USD	United States Treasury Bill 09/04/24, ZCP	19.703.217	6,19
14.740.000	USD	United States Treasury Bill 16/04/24, ZCP	14.701.110	4,62
3.235.000	USD	United States Treasury Bill 18/04/24, ZCP	3.225.606	1,01
6.190.000	USD	United States Treasury Bill 23/04/24, ZCP	6.167.091	1,94
3.685.000	USD	United States Treasury Bill 25/04/24, ZCP	3.670.576	1,15
9.770.000	USD	United States Treasury Bill 30/04/24, ZCP	9.724.141	3,06
2.330.000	USD	United States Treasury Bill 02/05/24, ZCP	2.318.439	0,73
9.795.000	USD	United States Treasury Bill 07/05/24, ZCP	9.739.049	3,06
5.130.000	USD	United States Treasury Bill 09/05/24, ZCP	5.099.233	1,60
5.370.000	USD	United States Treasury Bill 14/05/24, ZCP	5.333.840	1,68
2.445.000	USD	United States Treasury Bill 16/05/24, ZCP	2.427.950	0,76
15.345.000	USD	United States Treasury Bill 21/05/24, ZCP	15.226.015	4,78
5.405.000	USD	United States Treasury Bill 28/05/24, ZCP	5.357.870	1,68
1.655.000	USD	United States Treasury Bill 30/05/24, ZCP	1.640.740	0,52
2.455.000	USD	United States Treasury Bill 06/06/24, ZCP	2.430.344	0,76
2.610.000	USD	United States Treasury Bill 20/06/24, ZCP	2.578.471	0,81
Total Bonos			152.686.058	47,98

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Cartera de inversiones a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados	Valor de mercado USD	% Patrimonio neto
Total Valores mobiliarios e instrumentos del mercado monetario negociados en otros mercados regulados			152.686.058	47,98

Número de participaciones o importe principal	Divisa	Otros valores	Valor de mercado USD	% patrimonio neto
Bonos				
Suiza				
1.867.000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7.25%	-	-
200.000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7.50%	-	-
325.000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7.50%	-	-
Total Bonos			-	-
Total Otros valores			-	-
Total Inversiones			269.844.351	84,79
Otros activos netos			48.395.646	15,21
Valor liquidativo			318.239.997	100,00

Las notas de las páginas 59 a 139 forman parte integrante de los presentes estados financieros.

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024

La Sociedad

La Sociedad es una sociedad de inversión de capital variable constituida como «société anonyme» conforme a la legislación del Gran Ducado de Luxemburgo y cumple los requisitos para ser una Société d'Investissement à Capital Variable («SICAV»). El objetivo exclusivo de la Sociedad consiste en colocar los subfondos que tiene a su disposición en todo tipo de valores mobiliarios y otros activos aptos, incluidos instrumentos financieros derivados, con el fin de diversificar los riesgos de inversión y gestionar las carteras en provecho de los Partícipes.

La estrategia de inversión de cada subfondo se basa en una estrategia de inversión alternativa diseñada por cada una de las Gestoras de inversiones y gestionada actualmente por estas.

Clases de Participaciones

Generalmente, las Participaciones se emitirán en la modalidad de Participaciones de acumulación. Solo se emitirán Participaciones de distribución de cualquier subfondo si así lo deciden los Consejeros. Los inversores pueden consultar a la Sociedad Gestora o a su Distribuidor acerca de la disponibilidad de Participaciones de distribución dentro de cada Clase de Participaciones y subfondo.

Los Consejeros podrán tomar la decisión de crear, dentro de cada subfondo, distintas Clases de Participaciones, cuyos activos se invertirán conjuntamente de acuerdo con la política de inversión específica del subfondo correspondiente, si bien cada una de dichas Clases de Participaciones podrá tener su propia estructura de comisiones, su propia divisa de denominación u otras características específicas. El Valor liquidativo por Participación se calculará por separado para cada Clase de Participaciones y podrá ser distinto para cada una de ellas como consecuencia de estos factores variables. Para obtener más información sobre las clases de participaciones disponibles en cada subfondo, consulte el folleto informativo vigente.

La Clase de Participaciones E no está disponible a través de la red mundial de distribuidores de Schroders. Si tiene cualquier duda al respecto, puede ponerse en contacto con la Sociedad Gestora.

Comisión de entrada

La Sociedad Gestora y los distribuidores tienen derecho a percibir una comisión de entrada. No obstante, los Consejeros podrán acordar la renuncia parcial o total a la misma.

Clases de Participaciones	Comisión de entrada
Participaciones A ¹ , A2 y K	Hasta el 3% del Valor liquidativo por Participación
Participaciones A1	Hasta el 2% del Valor liquidativo por Participación
Participaciones C, C1, E ² y F	Hasta el 1% del Valor liquidativo por Participación
Participaciones I, IF, IZ, N, PI, R1, R2, R3, R4, R5, S, X, Y, Y1, Y2 e Y3	Sin comisión de entrada

¹ La comisión de entrada en la Clase de participaciones A de Schroder GAIA Cat Bond asciende al 1% del Valor liquidativo por Participación.

² No existe ninguna comisión de entrada para la Clase de participaciones E de Schroder GAIA Asian Equity Long Short.

Comisión de distribución

A la fecha del presente informe, hay una comisión de distribución del 0,50% en todas las Clases de Participaciones de Schroder GAIA A1. No existe ninguna otra comisión de distribución atribuible a otras clases de participaciones disponibles para la inversión dentro de la Sociedad.

Ajuste por dilución

Un subfondo puede sufrir una dilución del Valor liquidativo por Participación debido a que inversores compren o vendan Participaciones en un subfondo a un precio que no refleje los costes de negociación y otros costes que se producen cuando la Gestora de inversiones realiza transacciones con valores para adaptar entradas y salidas de efectivo. Para contrarrestar este efecto, puede adoptarse un mecanismo de ajuste por dilución con el fin de proteger los intereses de los Partícipes del subfondo. Si en un día de valoración, el total de las transacciones netas en Participaciones de un subfondo supera un umbral predeterminado, según las determinaciones y las revisiones periódicas de la Sociedad Gestora para cada subfondo, el Valor liquidativo por Participación puede ajustarse al alza o a la baja para reflejar las entradas y las salidas netas, respectivamente.

El flujo neto será determinado por la Sociedad Gestora basándose en la última información disponible en el momento del cálculo del Valor liquidativo por Participación. El alcance del ajuste del precio será fijado por la Sociedad Gestora para reflejar los costes de negociación y otros costes. Dicho ajuste puede variar de subfondo a subfondo y no será superior al 2% del Valor liquidativo por Participación inicial.

El mecanismo se ha implementado para los subfondos Schroder GAIA desde su lanzamiento.

A 28 de marzo de 2024, último Día de cálculo del periodo analizado, no se aplicó ningún ajuste por dilución a ningún subfondo.

Importe mínimo de suscripción, importe mínimo de suscripción adicional e importe mínimo de participación

Subfondos	Clases de Participaciones	Suscripción inicial mínima	Suscripción adicional mínima	Participación mínima
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	Participaciones A, C y E*	USD 10.000	USD 5000	USD 10.000
	Participaciones I	USD 5.000.000	USD 2.500.000	USD 5.000.000
	Participaciones IZ y X1*	USD 100.000.000	USD 20.000.000	USD 100.000.000
Schroder GAIA BlueTrend	Participaciones A, C, E y N	USD 10.000	USD 5000	USD 10.000
Schroder GAIA Cat Bond	Participaciones A, C, F y PI	USD 100.000	USD 50.000	USD 100.000
	Participaciones I	USD 5.000.000	USD 2.500.000	USD 5.000.000
	Participaciones IF	USD 1.000.000	USD 500.000	USD 1.000.000
	Participaciones Y, Y1, Y2 e Y3*	USD 100.000.000	USD 2.500.000	USD 100.000.000

* Para obtener más información sobre todos los lanzamientos de clases de participaciones llevados a cabo durante el periodo analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Importe mínimo de suscripción, importe mínimo de suscripción adicional e importe mínimo de participación (continuación)

Subfondos	Clases de Participaciones	Suscripción inicial mínima	Suscripción adicional mínima	Participación mínima
S Schroder GAIA Contour Tech Equity	Participaciones A, A1, C y E	USD 10.000	USD 5000	USD 10.000
	Participaciones X	EUR 100.000.000	EUR 2.500.000	EUR 100.000.000
S Schroder GAIA Egerton Equity	Participaciones A, A1, C y E	EUR 10.000	EUR 5000	EUR 10.000
	Participaciones X	EUR 100.000.000	EUR 2.500.000	EUR 100.000.000
S Schroder GAIA Helix	Participaciones A, C, C1, E y S	USD 10.000	USD 5000	USD 10.000
	Participaciones I	USD 5.000.000	USD 2.500.000	USD 5.000.000
	Participaciones IZ	USD 100.000.000	USD 20.000.000	USD 100.000.000
	Participaciones X	USD 100.000.000	USD 2.500.000	USD 100.000.000
S Schroder GAIA Oaktree Credit	Participaciones A2, C y E	USD 10.000	USD 5000	USD 10.000
	Participaciones I	USD 5.000.000	USD 2.500.000	USD 5.000.000
S Schroder GAIA SEG US Equity	Participaciones C, K y R4	USD 10.000	USD 5000	USD 10.000
	Participaciones IZ	USD 100.000.000	USD 20.000.000	USD 100.000.000
	Participaciones R1	USD 10.000	USD 5000	Cero
	Participaciones R2 y R5	USD 10.000.000	Cero	USD 10.000.000
	Participaciones R3	USD 500.000	Cero	Cero
S Schroder GAIA Sirios US Equity	Participaciones A, C y E	USD 10.000	USD 5000	USD 10.000
	Participaciones X	USD 100.000.000	USD 2.500.000	USD 100.000.000
S Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Participaciones C y K	USD 10.000	USD 5000	USD 10.000
S Schroder GAIA Wellington Pagosa	Participaciones A, C, C1 y E	USD 10.000	USD 5000	USD 10.000

Resumen de las políticas contables más importantes

Los estados financieros se preparan y presentan de conformidad con los principios contables generalmente aceptados en Luxemburgo para los fondos de inversión en funcionamiento.

Valor liquidativo

Cálculo del Valor liquidativo por Participación

El Valor liquidativo por Participación de cada Clase de Participaciones se calcula el Día de cálculo en la divisa de la Clase de Participaciones pertinente. El cálculo se efectuará dividiendo el Valor liquidativo atribuible a cada Clase de Participaciones, siendo este el valor proporcional de su activo menos su pasivo, entre el número de Participaciones de dicha Clase que estén en circulación en ese momento. El importe resultante se redondeará hasta el cuarto decimal. En el folleto informativo vigente podrá encontrar más detalles sobre las normas que se aplican a la hora de valorar el patrimonio total.

Los estados financieros se elaboran sobre la base del último Valor liquidativo calculado durante el periodo (28 de marzo de 2024 para todos los subfondos) y se presentan de conformidad con los principios contables generalmente aceptados en Luxemburgo para los fondos de inversión.

Valoración de los activos de la Sociedad

El valor del efectivo en caja o en depósito, de letras o pagarés a la vista y de las cuentas por cobrar, los gastos abonados por adelantado, los dividendos en efectivo e intereses declarados o devengados como se ha mencionado anteriormente, pero que todavía no se hayan recibido, se considerará que es el importe total de los mismos, a no ser que en cualquiera de estos casos sea poco probable el pago o recepción de la totalidad del mismo, en cuyo caso su valor se determinará tras realizar el descuento que la Sociedad considere adecuado para reflejar su valor real.

El valor de los valores, de los instrumentos financieros derivados y de los activos se determina tomando como base los precios de cierre del Día hábil en la bolsa o cualquier otro Mercado regulado en el que se negocien o coticen dichos valores o activos. Si un valor no se negocia ni está admitido a cotización oficial en bolsa ni en ningún Mercado regulado, o, en el caso de los valores cotizados o negociados, si el último precio disponible de los valores no refleja su valor real, el Consejo de Administración deberá actuar en función del precio de venta esperado, que se determinará con prudencia y de buena fe.

Los instrumentos financieros derivados que no coticen en ninguna bolsa oficial ni se negocien en ningún otro mercado organizado están sujetos a una valoración fiable y verificable con una periodicidad diaria y pueden ser vendidos, liquidados o cerrados mediante una operación de compensación en cualquier momento a su valor razonable, a iniciativa de la Sociedad.

Si alguno de los principios de valoración antes mencionados no refleja el método de valoración que se utiliza comúnmente en mercados específicos, o si tales principios de valoración no parecen correctos para determinar el valor de los activos de la Sociedad, los Consejeros podrán fijar principios de valoración diferentes de buena fe y conforme a los principios y los procedimientos de valoración generalmente aceptados.

Las participaciones o acciones en OIC de tipo abierto se valorarán tomando como base el último valor liquidativo disponible publicado por dicho OIC.

Los estados financieros totales se expresan en EUR, que es la divisa de la Sociedad, y los estados financieros de los subfondos se expresan en la divisa

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

base correspondiente. Los tipos de cambio aplicables vigentes al final del periodo se utilizan para convertir divisas distintas del EUR a EUR en el Balance, la Cuenta de pérdidas y ganancias y el Estado de variación patrimonial.

Ajuste de precios al valor razonable

Los Consejeros se reservan el derecho a aplicar el ajuste de precios al valor razonable cuando lo considere oportuno.

A 31 de marzo de 2024, se aplicó el ajuste de la valoración razonable a los siguientes valores:

Subfondo	Nombre del valor
Schroder GAIA Cat Bond	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP
	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP
Schroder GAIA Helix	CFD en TRINITY LIMITED
Schroder GAIA Wellington Pagosa	TRS en OMNIAB INC CEDE EARN OUT
	TRS en OMNIAB INC CEDE EARN OUT 15
	Clementia Pharmaceuticals
	Credit Suisse Group perpetual, 7.25%
	Credit Suisse Group perpetual, 7.50%
	Credit Suisse Group perpetual*, 7.50%

Fiscalidad

La Sociedad no está sujeta a ningún impuesto sobre la renta ni sobre las plusvalías en Luxemburgo.

El único impuesto al que la Sociedad está sujeta es la denominada «taxe d'abonnement», cuyo tipo es del 0,05% anual sobre el Valor liquidativo de cada subfondo al final del trimestre correspondiente y que se calcula y abona trimestralmente.

En el caso de cualquier Clase de Participaciones o subfondo que cuente exclusivamente con Inversores institucionales (conforme al significado de dicho término recogido en el artículo 174 de la Ley de 17 de diciembre de 2010 en su versión modificada), el impuesto se gravará a un tipo del 0,01% anual.

Los ingresos por intereses y dividendos recibidos por la Sociedad pueden estar sujetos a una retención no recuperable en los países de origen. La Sociedad podrá estar sujeta a impuestos sobre revalorización materializada o latente del capital de sus activos en los países de origen y las disposiciones a este respecto pueden ser reconocidas en ciertas jurisdicciones.

Comisiones de gestión

Las Gestoras de inversiones tienen derecho a recibir por sus servicios unas comisiones de gestión que se calcularán y acumularán diariamente sobre la base del Valor liquidativo de los Subfondos, y que se abonarán mensualmente. Las comisiones actuales pagaderas para el periodo analizado se reflejan en la siguiente tabla:

Subfondos	Clase de Participaciones	Comisión de gestión
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	Participaciones A	2,00%
	Participaciones C e IZ	1,00%
	Participaciones E* (tipo efectivo)	hasta el 1,00% (0,75%)
	Participaciones X1* (tipo efectivo)	hasta el 1,00% (0,85%)
	Participaciones I	No aplicable
Schroder GAIA BlueTrend	Participaciones A	1,60%
	Participaciones C, E y N	1,00%
Schroder GAIA Cat Bond	Participaciones A y F	1,50%
	Participaciones C e IF	1,10%
	Participaciones PI (tipo efectivo)	hasta el 1,10% (0,46%)
	Participaciones Y (tipo efectivo)	hasta el 1,10% (0,88%)
	Participaciones Y1 (tipo efectivo)	hasta el 1,50% (1,28%)
	Participaciones Y2 (tipo efectivo)	hasta el 1,10% (0,24%)
	Participaciones Y3* (tipo efectivo)	hasta el 1,50% (0,75%)
	Participaciones I	No aplicable
Schroder GAIA Contour Tech Equity	Participaciones A y A1	2,00%
	Participaciones C	1,25%
	Participaciones E	1,00%
Schroder GAIA Egerton Equity	Participaciones A y A1	2,00%
	Participaciones C y E	1,25%
	Participaciones X (tipo efectivo)	hasta el 1,25% (1,25%)
Schroder GAIA Helix	Participaciones A	2,00%
	Participaciones C, C1 e IZ	1,00%
	Participaciones E	0,75%
	Participaciones S (tipo efectivo)	hasta el 1,00% (0,35%)

* Para obtener más información sobre todos los lanzamientos de clases de participaciones llevados a cabo durante el periodo analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Comisiones de gestión (continuación)

Subfondos	Clase de Participaciones	Comisión de gestión
	Participaciones X (tipo efectivo)	hasta el 1,00% (0,60%)
	Participaciones I	No aplicable
Schroder GAIA Oaktree Credit		
	Participaciones A2	1,25%
	Participaciones C	0,75%
	Participaciones E	0,60%
	Participaciones I	No aplicable
Schroder GAIA SEG US Equity		
	Participaciones C y R3	1,40%
	Participaciones IZ, R2 y R5	1,15%
	Participaciones K	1,90%
	Participaciones R1	1,75%
	Participaciones R4	2,30%
Schroder GAIA Sirios US Equity		
	Participaciones A	2,00%
	Participaciones C	1,25%
	Participaciones E	1,00%
	Participaciones X (tipo efectivo)	hasta el 1,25% (1,25%)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
	Participaciones C	1,40%
	Participaciones K	1,90%
Schroder GAIA Wellington Pagosa		
	Participaciones A	2,00%
	Participaciones C y C1	1,25%
	Participaciones E	0,75%

La Sociedad Gestora podrá, a su discreción, renunciar parcialmente a estas comisiones.

Honorarios de los Consejeros

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini recibió una remuneración de 12.750 euros por el periodo analizado. Bernard Herman recibió una remuneración de 12.250 euros por el periodo analizado. Eric Bertrand recibió una remuneración de 13.250 euros por el periodo analizado. Hugh Mullan recibió una remuneración de 11.000 euros por el periodo analizado. Los demás consejeros han renunciado a su remuneración.

Comisiones de rentabilidad

Se cobrará una comisión de rentabilidad en caso de que el incremento del Valor liquidativo por Participación durante el periodo de rentabilidad correspondiente supere la cota máxima, es decir, el valor más alto del Valor liquidativo por Participación al final de cualquier periodo de rentabilidad previo (la Cota máxima).

La comisión de rentabilidad de una Clase de Participaciones se devenga en cada Día hábil y se incluye en los Valores liquidativos de los subfondos en el siguiente Día de cálculo, y se calcula a partir de la diferencia entre el Valor liquidativo por Participación determinado en el mismo Día de cálculo (antes de deducir toda provisión para comisiones de rentabilidad) y el umbral mínimo de rentabilidad, o bien, en el caso de utilizar una referencia, a partir de la diferencia entre dicho Valor liquidativo por Participación y la cifra que resulte mayor entre el Valor liquidativo objetivo por Participación (es decir, un Valor liquidativo por Participación hipotético que toma como base la rentabilidad del valor de referencia hasta el Día hábil) y la Cota máxima, diferencia que se multiplica, en ambos casos, por la media de Participaciones en circulación durante el periodo. No se calculan comisiones de rentabilidad para las Participaciones I.

En la siguiente tabla se muestran detalles de los procedimientos de cálculo de las comisiones de rentabilidad del periodo analizado. En el folleto informativo vigente podrá encontrar más detalles sobre el cálculo de las comisiones de rentabilidad y en la sección «Comisiones de rentabilidad por pagar» del Balance se muestran las comisiones por pagar del periodo. Las comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones durante el ejercicio se muestran en las páginas 138-139.

Subfondos	Gestora de inversiones	Valor de referencia
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	Schroder Investment Management (Singapore) Ltd.	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short GBP Hedged*	Schroder Investment Management (Singapore) Ltd.	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA BlueTrend	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend BRL Hedged	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend CHF Hedged	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend EUR Hedged	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend GBP Hedged	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend SEK Hedged	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA Cat Bond	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond CHF Hedged	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond EUR Hedged	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond GBP Hedged	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond JPY Hedged	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond SEK Hedged	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond SGD Hedged	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Contour Tech Equity	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity CHF Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity EUR Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity GBP Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity SEK Hedged	Contour Asset Management, LLC	

* Para obtener más información sobre todos los lanzamientos de clases de participaciones llevados a cabo durante el periodo analizado, remítase al Informe de los Consejeros.

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Comisiones de rentabilidad (continuación)

Subfondos	Gestora de inversiones	Valor de referencia
Schroder GAIA Contour Tech Equity SGD Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Egerton Equity	Egerton Capital (UK) LLP	Euro Short-Term Rate (ESTR) + 1.00%
Schroder GAIA Egerton Equity GBP Hedged	Egerton Capital (UK) LLP	Euro Short-Term Rate (ESTR) + 1.00%
Schroder GAIA Egerton Equity USD Hedged	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 Hedged	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Helix EUR Hedged	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Helix GBP Hedged	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Helix JPY Hedged	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Helix SEK Hedged	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Helix SGD Hedged	Schroder Investment Management Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA SEG US Equity	Select Equity Group LP	
Schroder GAIA SEG US Equity CHF Hedged	Select Equity Group LP	
Schroder GAIA SEG US Equity EUR Hedged	Select Equity Group LP	
Schroder GAIA SEG US Equity GBP Hedged	Select Equity Group LP	
Schroder GAIA Sirios US Equity	Sirios Capital Management LP	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Sirios US Equity CHF Hedged	Sirios Capital Management LP	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Sirios US Equity EUR Hedged	Sirios Capital Management LP	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Sirios US Equity GBP Hedged	Sirios Capital Management LP	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified CHF Hedged	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified EUR Hedged	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified GBP Hedged	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Wellington Pagosa BRL Hedged	Wellington Management International Limited	Brazil CETIP DI Interbank Deposit Rate
Schroder GAIA Wellington Pagosa CHF Hedged	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Wellington Pagosa EUR Hedged	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Wellington Pagosa GBP Hedged	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Wellington Pagosa SGD Hedged	Wellington Management International Limited	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)

La comisión de rentabilidad para Schroder GAIA Asian Equity Long Short, Schroder GAIA Contour Tech Equity, Schroder GAIA Egerton Equity, Schroder GAIA SEG US Equity y Schroder GAIA Two Sigma Diversified es el 20% de la rentabilidad superior.

La comisión de rentabilidad para Schroder GAIA Helix, Schroder GAIA Sirios US Equity y Schroder GAIA Wellington Pagosa es del 20% de la rentabilidad superior (con la excepción de las Participaciones E, para las cuales la comisión es el 15% de la rentabilidad superior).

Para Schroder GAIA BlueTrend, la comisión de rentabilidad es del 10% de la rentabilidad superior.

En el caso de Schroder GAIA Cat Bond y Schroder GAIA Oaktree Credit, no se aplica ninguna comisión de rentabilidad (salvo para las Participaciones de Schroder GAIA Cat Bond PI, donde el tipo es el 10% de la rentabilidad superior).

Comisiones del depositario y de administración

El Depositario y el Administrador del fondo tienen derecho a recibir comisiones por los servicios relacionados proporcionados de conformidad con las prácticas comunes de Luxemburgo, pagaderas cada mes, del patrimonio neto del subfondo.

Reinversión de garantías en efectivo

Con el propósito de minimizar el riesgo de contraparte, los subfondos que realicen operaciones de cobertura de divisas vinculadas a Clases de Participaciones cubiertas abonarán o recibirán de la contraparte garantías en efectivo con una periodicidad diaria, lo que les permitirá reducir su exposición durante la vigencia del contrato a plazo.

Las Gestoras de inversiones podrán reinvertir las garantías en efectivo que reciben de su contraparte en relación con la cobertura de divisas.

Las garantías por cobrar o pagar al vencimiento de los contratos a plazo se indican en el Balance como «Garantías por cobrar/pagar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas netas». Las ampliaciones de garantía por cobrar o pagar se indican en el Balance como «Garantías por cobrar/pagar emergentes de contratos a plazo sobre clases de divisas cubiertas».

Contratos de divisas a plazo

Los contratos de divisas a plazo existentes se valoraron al último precio disponible el día de cálculo del Valor liquidativo sobre la base del tipo de cambio a plazo aplicable al vencimiento del contrato correspondiente. La plusvalía o minusvalía latente se muestra en el Balance bajo el apartado «Plusvalía/ (minusvalía) latente neta sobre contratos de divisas a plazo».

A 31 de marzo de 2024, los siguientes subfondos estaban comprometidos con contratos de divisas a plazo existentes:

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
Schroder GAIA Asian Equity Long Short						
Cobertura de cartera						
AUD	5.489.000	USD	3.666.735	17-abr-2024	(88.307)	
GBP	988.000	USD	1.260.233	17-abr-2024	(13.128)	
NZD	54.000	USD	33.648	17-abr-2024	(1.385)	
SGD	1.847.000	USD	1.391.530	17-abr-2024	(22.683)	
					USD	(125.503)
Cobertura de las Clases de Participaciones						
GBP	4.790.825	USD	6.119.278	30-abr-2024	(71.615)	
Schroder GAIA Asian Equity Long Short (continuación)						
USD	13.960	GBP	10.930	30-abr-2024	162	

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
					USD	(71.453)
Schroder GAIA BlueTrend						
Cobertura de cartera						
AUD	1.200.000	USD	781.867	03-abr-2024		136
AUD	21.400.000	USD	14.120.616	17-abr-2024		(169.376)
AUD	775.000	USD	505.902	24-abr-2024		(556)
BRL	1.121.800	USD	225.858	24-abr-2024		(2.686)
BRL	1.121.800	USD	222.156	28-may-2024		327
BRL	149.747.429	USD	29.829.009	20-jun-2024		(196.665)
CAD	35.548.341	USD	26.345.752	17-abr-2024		(96.362)
CHF	775.856	USD	856.606	02-abr-2024		3688
CHF	291.331	USD	321.733	03-abr-2024		1339
CHF	691.020	USD	775.526	17-abr-2024		(8.031)
CHF	820.000	USD	916.420	24-abr-2024		(4.961)
CLP	10.673.009.296	USD	11.213.013	21-jun-2024		(342.009)
CNH	8.588.720	USD	1.183.898	02-abr-2024		(1.254)
CNH	11.136.753	USD	1.534.749	03-abr-2024		(1.239)
CNH	112.649.751	USD	15.627.494	17-abr-2024		(109.821)
EUR	600.000	USD	648.371	03-abr-2024		(1.036)
EUR	15.900.000	USD	17.365.762	17-abr-2024		(201.827)
EUR	800.000	USD	869.282	24-abr-2024		(5.444)
GBP	500.000	USD	631.230	02-abr-2024		(155)
GBP	1.100.000	USD	1.389.844	03-abr-2024		(1.472)
GBP	15.448.519	USD	19.775.598	17-abr-2024		(275.654)
HUF	685.689	USD	1876	02-abr-2024		3
HUF	3.662.153.690	USD	10.018.804	17-abr-2024		3214
IDR	140.522.246.581	USD	8.975.737	20-jun-2024		(131.898)
ILS	19.926.203	USD	5.529.640	17-abr-2024		(107.274)
INR	2.899.987.854	USD	34.831.244	20-jun-2024		(144.262)
JPY	384.041.701	USD	2.595.979	17-abr-2024		(53.232)
JPY	141.595.000	USD	937.689	24-abr-2024		816
KRW	36.152.706.216	USD	27.521.578	20-jun-2024		(550.400)
MXN	8.513.506	USD	510.649	01-abr-2024		1457
MXN	22.540.889	USD	1.363.244	02-abr-2024		(7.361)
MXN	883.075.004	USD	51.972.696	17-abr-2024		1.022.841
NOK	19.224.597	USD	1.783.276	02-abr-2024		(12.484)
NOK	89.759.945	USD	8.624.794	17-abr-2024		(353.744)
NZD	600.000	USD	360.066	02-abr-2024		(1.596)
NZD	25.700.000	USD	15.857.462	17-abr-2024		(502.768)
PHP	798.776.203	USD	14.373.353	20-jun-2024		(183.188)
PLN	191.003.462	USD	48.257.399	17-abr-2024		(444.233)
SEK	87.031.884	USD	8.518.407	17-abr-2024		(382.759)
SGD	35.730.229	USD	26.820.454	17-abr-2024		(340.104)
SGD	1.741.415	USD	1.303.962	15-may-2024		(11.669)
THB	339.551.470	USD	9.519.854	17-abr-2024		(202.369)
TWD	76.476.057	USD	2.435.804	20-jun-2024		(24.160)
USD	2.804.366	AUD	4.300.000	02-abr-2024		2272
USD	2.665.980	AUD	4.100.000	03-abr-2024		(5.861)
USD	46.146.954	AUD	70.000.000	17-abr-2024		512.060
Schroder GAIA BlueTrend (continuación)						
USD	3.499.220	AUD	5.350.000	24-abr-2024		10.698

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
USD	222.829	BRL	1.121.800	24-abr-2024	(343)
USD	4.133.760	BRL	20.954.076	20-jun-2024	(12.676)
USD	45.771.531	CAD	61.904.279	17-abr-2024	60.549
USD	3.755.339	CAD	5.100.000	24-abr-2024	(10.959)
USD	900.000	CHF	815.349	02-abr-2024	(4.085)
USD	1.200.000	CHF	1.082.443	03-abr-2024	(378)
USD	42.684.797	CHF	37.669.069	17-abr-2024	846.822
USD	308.366	CHF	275.000	24-abr-2024	2693
USD	36.756.374	CLP	35.824.000.178	21-jun-2024	267.796
USD	1.183.746	CNH	8.588.720	02-abr-2024	1100
USD	1.536.018	CNH	11.136.751	03-abr-2024	2507
USD	52.761.947	CNH	379.274.098	17-abr-2024	516.358
USD	9.437.943	CNH	68.125.244	16-may-2024	40.635
USD	9861	CZK	230.000	24-abr-2024	57
USD	3.247.566	EUR	3.000.000	02-abr-2024	11.016
USD	4.647.663	EUR	4.300.000	03-abr-2024	8430
USD	31.260.204	EUR	28.800.000	17-abr-2024	170.813
USD	11.758.318	EUR	10.835.000	24-abr-2024	58.706
USD	2.901.493	GBP	2.300.000	02-abr-2024	(1.448)
USD	1.893.715	GBP	1.500.000	03-abr-2024	477
USD	23.949.927	GBP	18.948.519	17-abr-2024	32.096
USD	1.100.318	GBP	870.000	24-abr-2024	2116
USD	1.026.692	HKD	8.025.000	24-abr-2024	631
USD	110.832	HUF	40.449.944	02-abr-2024	16
USD	306.250	HUF	111.800.640	03-abr-2024	(14)
USD	5.131.262	HUF	1.870.031.529	17-abr-2024	13.646
USD	5802	HUF	2.125.000	24-abr-2024	(10)
USD	25.684.407	IDR	404.371.373.818	20-jun-2024	235.093
USD	10.077.180	ILS	36.852.128	17-abr-2024	48.886
USD	20.034.905	INR	1.672.237.574	20-jun-2024	33.140
USD	55.955.424	JPY	8.307.228.186	17-abr-2024	953.122
USD	2.235.504	JPY	336.560.000	24-abr-2024	4754
USD	2.482.812	KRW	3.315.944.977	24-abr-2024	16.702
USD	54.061.362	KRW	71.613.280.034	20-jun-2024	635.358
USD	510.201	MXN	8.513.507	01-abr-2024	(1.905)
USD	1.360.515	MXN	22.540.890	02-abr-2024	4631
USD	8.345.195	MXN	139.474.350	17-abr-2024	(25.009)
USD	1.793.976	NOK	19.224.596	02-abr-2024	23.186
USD	4.738.035	NOK	51.208.877	03-abr-2024	21.024
USD	37.139.220	NOK	393.726.483	17-abr-2024	858.757
USD	2.218.086	NZD	3.700.000	02-abr-2024	7522
USD	2.335.309	NZD	3.900.000	03-abr-2024	5256
USD	51.684.450	NZD	85.000.000	17-abr-2024	900.433
USD	27.018	NZD	45.000	24-abr-2024	132
USD	11.092.636	PHP	624.310.192	20-jun-2024	1838
USD	11.720.042	PLN	46.657.159	17-abr-2024	40.535
USD	30.340	PLN	120.000	24-abr-2024	302
USD	2.039.554	SEK	21.623.252	02-abr-2024	19.445
USD	1.607.269	SEK	17.148.193	03-abr-2024	5172
USD	38.626.966	SEK	404.433.501	17-abr-2024	820.944
Schroder GAIA BlueTrend (continuación)					
USD	499.394	SEK	5.275.000	24-abr-2024	6154

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
USD	31.756.604	SGD	42.571.761	17-abr-2024	205.864	
USD	186.225	SGD	250.000	24-abr-2024	885	
USD	33.359.639	SGD	44.838.023	15-may-2024	85.632	
USD	36.380.562	THB	1.299.198.977	17-abr-2024	729.805	
USD	483.724	THB	17.401.151	24-abr-2024	5967	
USD	2.913.131	THB	105.038.768	15-may-2024	24.055	
USD	718.060	TRY	23.890.000	24-abr-2024	(1.023)	
USD	39.985.985	TWD	1.249.391.614	20-jun-2024	586.882	
USD	396.877	ZAR	7.508.678	02-abr-2024	430	
USD	1.301.239	ZAR	24.779.845	03-abr-2024	(6.998)	
USD	14.540.576	ZAR	276.145.137	17-abr-2024	(22.197)	
USD	887.251	ZAR	16.825.000	24-abr-2024	471	
ZAR	274.280.146	USD	14.637.430	17-abr-2024	(173.008)	
					USD	4.739.729
Cobertura de las Clases de Participaciones						
BRL	172.541.161	USD	34.572.326	30-abr-2024	(267.207)	
CHF	1.589.231	USD	1.783.920	30-abr-2024	(16.251)	
EUR	87.515.291	USD	95.625.405	30-abr-2024	(1.103.691)	
GBP	122.750.355	USD	156.761.037	30-abr-2024	(1.808.042)	
SEK	39.387.043	USD	3.795.550	30-abr-2024	(111.770)	
USD	2.490.000	BRL	12.428.262	30-abr-2024	18.978	
USD	27.304	CHF	24.622	30-abr-2024	(82)	
USD	15.140	EUR	13.967	30-abr-2024	56	
USD	84.931	GBP	67.209	30-abr-2024	89	
USD	8814	SEK	92.178	30-abr-2024	193	
					USD	(3.287.727)
					USD	1.452.002
Schroder GAIA Cat Bond						
Cobertura de cartera						
USD	96.236.833	EUR	88.634.000	24-may-2024	413.599	
USD	6.516.804	NZD	10.544.000	24-may-2024	216.891	
					USD	630.490
Cobertura de las Clases de Participaciones						
CHF	292.156.179	USD	327.980.196	30-abr-2024	(3.021.013)	
EUR	925.232.667	USD	1.011.002.293	30-abr-2024	(11.696.050)	
GBP	38.715.324	USD	49.450.320	30-abr-2024	(578.317)	
JPY	1.393.094	USD	9322	29-mar-2024	(120)	
JPY	1.401.699	USD	9294	30-abr-2024	5	
SEK	8.161.966.744	USD	786.640.333	30-abr-2024	(23.270.244)	
SGD	670.346	USD	501.035	30-abr-2024	(3.928)	
USD	588.993	CHF	526.796	30-abr-2024	3048	
USD	1962	EUR	1813	30-abr-2024	3	
USD	153.477	GBP	121.862	30-abr-2024	(355)	
USD	9192	JPY	1.393.094	29-mar-2024	(10)	
USD	14.030	SEK	148.129	30-abr-2024	176	
					USD	(38.566.805)
					USD	(37.936.315)

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Cobertura de cartera

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
AUD	2.070.794	USD	1.358.302	10-may-2024	(7.385)	
EUR	1.945.915	USD	2.112.773	10-may-2024	(10.216)	
GBP	2.699.968	USD	3.420.140	10-may-2024	(11.661)	
JPY	319.699.855	USD	2.148.317	10-may-2024	(23.890)	
NOK	23.077.842	USD	2.191.807	10-may-2024	(64.046)	
USD	1.207.699	AUD	1.843.577	10-may-2024	5013	
USD	2.750.967	EUR	2.532.153	10-may-2024	14.980	
USD	1006	GBP	796	03-abr-2024	1	
USD	2.849.585	GBP	2.253.812	10-may-2024	4341	
USD	2.024.609	JPY	298.455.655	10-may-2024	41.350	
USD	2.214.172	NOK	23.433.571	10-may-2024	53.612	
USD	9419	SEK	100.000	03-abr-2024	76	
					USD	2175

Cobertura de las Clases de Participaciones						
CHF	2.978.874	USD	3.343.857	30-abr-2024	(30.519)	
EUR	45.220.930	USD	49.411.361	30-abr-2024	(570.067)	
GBP	24.309.953	USD	31.045.183	30-abr-2024	(357.696)	
SEK	72.054.875	USD	6.943.372	30-abr-2024	(204.245)	
SGD	827.298	USD	618.959	30-abr-2024	(5.463)	
USD	20.322	CHF	18.065	30-abr-2024	230	
USD	430.635	EUR	396.417	30-abr-2024	2479	
USD	32.633	GBP	25.842	30-abr-2024	12	
USD	53.941	SEK	565.216	30-abr-2024	1079	
					USD	(1.164.190)
					USD	(1.162.015)

Schroder GAIA Egerton Equity						
Cobertura de cartera						
CNY	6.861.000	EUR	889.987	11-abr-2024	(9.582)	
EUR	22.654.692	CAD	33.398.000	10-abr-2024	(194.937)	
EUR	2.157.416	CHF	2.068.000	10-abr-2024	30.739	
EUR	4.905.827	INR	442.432.000	12-abr-2024	(8.022)	
EUR	2.620.181	MXN	48.676.000	10-abr-2024	(89.586)	
EUR	2.681.136	SEK	30.146.000	10-abr-2024	70.629	
EUR	298.232.504	USD	324.531.000	10-abr-2024	(2.485.536)	
GBP	4.981.000	EUR	5.812.325	10-abr-2024	13.392	
INR	222.340.000	EUR	2.459.404	12-abr-2024	10.004	
KRW	3.101.872.000	EUR	2.145.718	11-abr-2024	(9.738)	
					EUR	(2.672.637)

Cobertura de las Clases de Participaciones						
EUR	244	GBP	209	30-abr-2024	-	
EUR	6.873.432	USD	7.449.431	30-abr-2024	(23.807)	
GBP	22.005.865	EUR	25.730.347	30-abr-2024	(10.512)	
USD	231.571.835	EUR	211.935.161	30-abr-2024	2.471.294	
					EUR	2.436.975
					EUR	(235.662)

Schroder GAIA Helix					
Cobertura de cartera					
AUD	20.427.000	USD	13.668.448	17-abr-2024	(336.227)
AUD	24.450.246	USD	16.134.832	18-abr-2024	(176.275)
Schroder GAIA Helix (continuación)					
BRL	1.770.000	USD	355.050	02-abr-2024	(1.442)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
CAD	1.350.869	USD	1.002.296	18-abr-2024	(3.823)
CHF	774.000	EUR	823.938	18-abr-2024	(29.567)
CHF	11.857.555	USD	13.768.157	18-abr-2024	(580.034)
CLP	527.285.000	USD	547.736	03-jun-2024	(11.103)
COP	765.000.000	USD	195.611	29-abr-2024	1383
DKK	50.121.116	USD	7.340.083	18-abr-2024	(77.220)
EUR	83.033	CHF	78.000	18-abr-2024	2980
EUR	34.798.234	USD	37.999.514	18-abr-2024	(393.504)
GBP	38.000	EUR	44.150	18-abr-2024	295
GBP	3.498.000	USD	4.461.583	17-abr-2024	(42.372)
GBP	20.346.729	USD	25.820.618	18-abr-2024	(115.341)
HKD	340.922.179	USD	43.676.444	18-abr-2024	(92.660)
INR	767.438.527	USD	9.197.820	18-abr-2024	(115)
JPY	5.284.645.765	USD	36.071.852	18-abr-2024	(1.068.770)
NGN	259.000.000	USD	181.119	27-jun-2024	13.555
NOK	452.000	EUR	39.458	18-abr-2024	(960)
NOK	13.514.195	USD	1.286.593	18-abr-2024	(40.374)
NZD	282.000	USD	175.719	17-abr-2024	(7.038)
NZD	247.424	USD	151.077	18-abr-2024	(3.079)
SEK	14.482.420	USD	1.393.132	18-abr-2024	(37.828)
SGD	6.793.000	USD	5.121.799	17-abr-2024	(84.936)
SGD	7.065.060	USD	5.288.542	18-abr-2024	(49.713)
USD	1.073.121	AUD	1.626.520	18-abr-2024	11.500
USD	356.559	BRL	1.770.000	02-abr-2024	2951
USD	3.137.829	BRL	15.566.489	18-abr-2024	33.096
USD	176.091	BRL	890.000	03-may-2024	(1.165)
USD	352.990	BRL	1.770.000	04-jun-2024	1471
USD	601.350	CAD	812.336	18-abr-2024	925
USD	1.708.533	CHF	1.479.551	18-abr-2024	62.957
USD	710.444	COP	2.846.795.000	29-abr-2024	(22.629)
USD	1.381.718	DKK	9.434.031	18-abr-2024	14.667
USD	8.076.059	EUR	7.412.916	18-abr-2024	65.015
USD	887.609	EUR	825.000	15-may-2024	(4.945)
USD	595.190	GBP	470.000	17-abr-2024	1413
USD	15.443.958	GBP	12.167.784	18-abr-2024	71.645
USD	7.256.583	HKD	56.694.204	18-abr-2024	8749
USD	5.992.316	JPY	880.124.660	18-abr-2024	162.771
USD	176.382	MXN	3.080.000	07-may-2024	(7.903)
USD	304.044	NOK	3.208.765	18-abr-2024	8145
USD	152.785	NZD	247.400	18-abr-2024	4800
USD	195.384	SEK	2.047.451	18-abr-2024	3776
USD	135.796	SGD	182.500	18-abr-2024	470
					USD (2.716.459)
Cobertura de las Clases de Participaciones					
CHF	835.469	USD	937.917	30-abr-2024	(7.457)
EUR	181.024.781	USD	197.821.914	30-abr-2024	(2.095.750)
GBP	26.442.998	USD	33.773.497	30-abr-2024	(364.233)
Schroder GAIA Helix (continuación)					
JPY	1.211.173	USD	8105	29-mar-2024	(102)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
JPY	1.214.407	USD	8052	30-abr-2024	6
SEK	72.810	USD	7017	30-abr-2024	(199)
SGD	30.329	USD	22.694	30-abr-2024	(191)
USD	125.149	EUR	115.190	30-abr-2024	603
USD	210.399	GBP	166.591	30-abr-2024	(81)
USD	7992	JPY	1.211.173	29-mar-2024	(11)
					USD (2.467.415)
					USD (5.183.874)

Schroder GAIA Oaktree Credit

Cobertura de cartera

AUD	73.329	USD	47.899	18-abr-2024	(93)
EUR	1429	USD	1547	03-abr-2024	(5)
EUR	2.795.823	USD	3.030.779	18-abr-2024	(12.588)
GBP	524.195	USD	664.155	18-abr-2024	(2.483)
USD	1.019.062	AUD	1.519.689	18-abr-2024	28.307
USD	22.868.028	EUR	20.828.915	18-abr-2024	382.467
USD	3.347.172	GBP	2.629.374	18-abr-2024	28.221
USD	65.731	JPY	9.800.000	18-abr-2024	835
					USD 424.661

Cobertura de las Clases de Participaciones

CHF	133.995	USD	150.428	30-abr-2024	(1.387)
EUR	13.896.931	USD	15.186.289	30-abr-2024	(176.780)
GBP	1.884.144	USD	2.406.596	30-abr-2024	(28.162)
USD	65.739	EUR	60.759	30-abr-2024	115
USD	21	GBP	16	30-abr-2024	-
					USD (206.214)
					USD 218.447

Schroder GAIA SEG US Equity

Cobertura de las Clases de Participaciones

CHF	2.392.414	USD	2.685.426	30-abr-2024	(24.395)
EUR	175.892.396	USD	192.185.961	30-abr-2024	(2.211.725)
GBP	14.047.347	USD	17.938.330	30-abr-2024	(205.769)
USD	5718	CHF	5083	30-abr-2024	65
USD	764.962	EUR	703.609	30-abr-2024	5025
USD	86.966	GBP	68.816	30-abr-2024	98
					USD (2.436.701)

Schroder GAIA Sirios US Equity

Cobertura de cartera

CAD	1.996.000	USD	1.475.439	20-jun-2024	(188)
DKK	4.975.000	USD	729.741	20-jun-2024	(7.237)
EUR	141.000	USD	153.170	20-jun-2024	(559)
GBP	2.132.000	USD	2.695.944	20-jun-2024	(3.906)
USD	188.439	CHF	165.000	20-jun-2024	3852
USD	11.846.254	EUR	10.832.000	20-jun-2024	122.244
USD	17.881.157	GBP	14.038.000	20-jun-2024	155.627
					USD 269.833

Schroder GAIA Sirios US Equity (continuación)

Cobertura de las Clases de Participaciones

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
CHF	3.190.358	USD	3.581.581	30-abr-2024	(33.012)	
EUR	24.146.973	USD	26.387.574	30-abr-2024	(307.410)	
GBP	4.091.688	USD	5.226.273	30-abr-2024	(61.161)	
USD	794.225	CHF	715.271	30-abr-2024	(1.357)	
USD	901.771	EUR	832.050	30-abr-2024	3107	
					USD	(399.833)
					USD	(130.000)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Cobertura de cartera

AUD	12.871.001	USD	8.416.617	20-jun-2024	(10.395)	
CAD	4.078.721	USD	3.008.063	20-jun-2024	6535	
CHF	10.619.004	USD	12.148.166	20-jun-2024	(268.595)	
CNH	6.699.280	USD	935.285	20-jun-2024	(9.400)	
EUR	12.981.548	USD	14.165.300	20-jun-2024	(114.729)	
GBP	26.390.975	USD	33.587.532	20-jun-2024	(264.121)	
ILS	532.724	USD	148.304	20-jun-2024	(2.922)	
JPY	1.478.813.088	USD	10.102.830	20-jun-2024	(213.326)	
KRW	389.557.200	USD	292.000	20-jun-2024	(1.377)	
MXN	79.886.979	USD	4.637.571	20-jun-2024	107.512	
NOK	13.392.484	USD	1.271.205	20-jun-2024	(35.264)	
NZD	12.220.920	USD	7.447.881	20-jun-2024	(146.117)	
PLN	22.487.660	USD	5.660.041	20-jun-2024	(34.885)	
SEK	13.828.772	USD	1.338.127	20-jun-2024	(41.917)	
SGD	9.159.730	USD	6.860.498	20-jun-2024	(52.047)	
TWD	10.101.747	USD	318.000	20-jun-2024	555	
USD	3.167.985	AUD	4.846.186	20-jun-2024	2877	
USD	11.817.840	CAD	16.023.064	20-jun-2024	(24.867)	
USD	10.671.683	CHF	9.332.302	20-jun-2024	231.558	
USD	15.358.636	CNH	110.027.020	20-jun-2024	152.180	
USD	1.580.378	CZK	36.861.741	20-jun-2024	8564	
USD	34.926.052	EUR	31.981.548	20-jun-2024	310.839	
USD	8.006.104	GBP	6.293.167	20-jun-2024	59.835	
USD	653.054	HUF	239.934.747	20-jun-2024	(1.309)	
USD	531.260	ILS	1.908.000	20-jun-2024	10.560	
USD	20.236.478	JPY	2.978.813.038	20-jun-2024	315.786	
USD	1.567.873	KRW	2.082.516.016	20-jun-2024	14.244	
USD	8.494.422	MXN	146.344.058	20-jun-2024	(198.043)	
USD	2.262.308	NOK	23.824.536	20-jun-2024	63.633	
USD	1.657.297	NZD	2.718.759	20-jun-2024	32.891	
USD	4.133.119	PLN	16.415.680	20-jun-2024	26.833	
USD	1.712.663	SEK	17.694.924	20-jun-2024	54.068	
USD	1.631.615	SGD	2.178.413	20-jun-2024	12.394	
USD	70.689	THB	2.577.600	04-abr-2024	33	
USD	395.502	TWD	12.397.011	20-jun-2024	4567	
USD	1.257.266	ZAR	23.953.911	20-jun-2024	867	
ZAR	27.635.984	USD	1.450.440	20-jun-2024	(913)	
					USD	(3.896)

Cobertura de las Clases de Participaciones

CHF	2.720.056	USD	3.053.492	30-abr-2024	(28.030)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (continuación)					
EUR	72.329.030	USD	79.039.121	30-abr-2024	(919.472)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
GBP	60.034.389	USD	76.678.332	30-abr-2024	(894.368)
USD	3031	EUR	2771	30-abr-2024	38
USD	6.271.977	GBP	4.963.233	30-abr-2024	6676
					USD (1.835.156)
					USD (1.839.052)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Cobertura de cartera

AUD	72.000	JPY	7.125.166	03-abr-2024	(155)
AUD	16.737.000	USD	10.934.072	03-abr-2024	(27.108)
AUD	1.321.000	USD	844.119	19-abr-2024	17.127
AUD	3.694.859	USD	2.411.149	08-may-2024	(891)
AUD	2.985.000	USD	1.978.357	20-jun-2024	(28.813)
BRL	19.298.000	USD	3.890.910	02-abr-2024	(43.161)
BRL	3.506.000	USD	685.837	03-abr-2024	13.135
BRL	2.588.000	USD	519.157	08-abr-2024	(3.477)
BRL	13.533.000	USD	2.704.809	03-may-2024	(14.911)
BRL	13.726.000	USD	2.739.078	04-jun-2024	(18.613)
CAD	17.977.000	USD	13.263.556	03-abr-2024	8204
CAD	3.992.000	USD	2.939.585	08-may-2024	9074
CAD	286.000	USD	212.299	20-jun-2024	(916)
CHF	4.502.000	USD	5.049.096	03-abr-2024	(56.586)
CHF	784.000	USD	868.806	08-may-2024	4011
CLP	5.448.173.000	USD	5.564.989	03-abr-2024	(4.470)
CLP	23.900.000	USD	24.378	08-may-2024	(12)
CLP	593.811.000	USD	608.418	21-jun-2024	(3.591)
CNH	109.935.000	USD	15.243.014	03-abr-2024	(105.168)
CNH	3.747.000	USD	523.939	20-jun-2024	(6.079)
COP	20.375.177.000	USD	5.162.371	03-abr-2024	107.915
COP	15.840.477.000	USD	4.094.099	08-may-2024	(21.264)
COP	2.599.194.000	USD	655.927	20-jun-2024	7684
COP	1.178.351.000	USD	290.592	11-jul-2024	9284
COP	12.039.800.000	USD	2.793.782	14-ago-2024	253.877
COP	11.967.700.000	USD	2.726.400	16-ago-2024	302.057
CZK	78.075.000	USD	3.336.611	03-abr-2024	(7.799)
CZK	19.977.000	USD	851.716	18-abr-2024	(74)
CZK	75.905.000	USD	3.250.903	09-may-2024	(15.177)
CZK	18.250.000	USD	786.556	20-jun-2024	(8.361)
DKK	4.890.000	USD	710.307	30-abr-2024	(2.041)
EGP	11.890.000	USD	222.035	06-ago-2024	20.188
EGP	11.890.000	USD	228.654	08-ago-2024	13.407
EUR	39.310.000	USD	42.702.577	03-abr-2024	(291.334)
EUR	6.459.000	USD	7.007.616	30-abr-2024	(31.513)
EUR	5.892.000	USD	6.383.545	08-may-2024	(17.772)
EUR	441.000	USD	475.067	14-may-2024	1509
EUR	3.025.000	USD	3.308.544	20-jun-2024	(34.438)
GBP	20.534.000	USD	26.085.607	03-abr-2024	(168.491)
GBP	4.969.000	USD	6.276.150	08-may-2024	(3.286)
GBP	193.000	USD	243.663	31-may-2024	13
GBP	456.000	USD	585.652	20-jun-2024	(9.869)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
HKD	255.000	USD	32.642	30-abr-2024	(32)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
HUF	4.797.730.000	USD	13.194.933	03-abr-2024	(52.131)
HUF	341.230.000	USD	933.545	08-may-2024	(964)
HUF	820.615.000	USD	2.256.587	20-jun-2024	(18.562)
IDR	7.316.000.000	USD	471.726	03-abr-2024	(10.322)
IDR	65.000.000	USD	4104	08-may-2024	(9)
IDR	4.876.000.000	USD	314.074	20-jun-2024	(7.201)
ILS	2.333.000	USD	582.300	29-mar-2024	52.212
ILS	12.900.000	USD	3.525.351	03-abr-2024	(16.794)
ILS	85.000	USD	23.253	08-may-2024	(102)
INR	2.463.512.000	USD	29.599.137	03-abr-2024	(62.269)
INR	169.380.000	USD	2.030.911	08-may-2024	(2.056)
INR	203.576.000	USD	2.447.149	20-jun-2024	(12.162)
JPY	7.020.006	AUD	72.000	03-abr-2024	(540)
JPY	7.094.447	AUD	72.000	08-may-2024	160
JPY	2.240.690.000	USD	14.925.453	03-abr-2024	(121.439)
JPY	275.958.000	USD	1.836.212	08-may-2024	(3.065)
JPY	4.599.000	USD	31.260	18-jun-2024	(513)
JPY	52.800.000	USD	355.552	20-jun-2024	(2.454)
KRW	8.725.383.000	USD	6.500.572	03-abr-2024	(18.970)
KRW	1.432.780.000	USD	1.068.276	08-may-2024	(1.863)
KZT	241.700.000	USD	530.000	20-jun-2024	(712)
MXN	481.023.000	USD	28.614.134	03-abr-2024	315.976
MXN	137.710.000	USD	7.972.170	08-abr-2024	303.707
MXN	6.150.000	USD	330.983	11-abr-2024	38.438
MXN	109.273.000	USD	6.522.106	08-may-2024	13.649
MXN	4.798.000	USD	260.959	14-may-2024	25.719
MXN	9.706.000	USD	571.817	20-jun-2024	4694
MXN	200.910.000	USD	11.054.195	28-jun-2024	865.209
MXN	98.570.000	USD	5.404.205	03-jul-2024	439.205
MXN	191.220.000	USD	10.552.693	08-jul-2024	774.155
MXN	77.010.000	USD	4.192.421	13-sep-2024	321.093
MXN	137.710.000	USD	7.197.512	07-oct-2024	843.255
MXN	145.870.000	USD	8.045.826	20-dic-2024	374.177
MXN	80.153.000	USD	4.490.742	10-ene-2025	121.665
MXN	47.355.000	USD	2.591.319	21-ene-2025	129.474
MXN	47.355.000	USD	2.595.292	29-ene-2025	122.417
MXN	107.000.000	USD	5.928.142	24-feb-2025	190.061
MXN	90.890.000	USD	5.147.096	20-mar-2025	32.397
NOK	72.600.000	USD	6.857.241	03-abr-2024	(169.827)
NOK	27.893.000	USD	2.589.413	08-may-2024	(17.824)
NZD	23.250.000	USD	14.161.125	03-abr-2024	(270.413)
NZD	13.014.000	USD	7.803.421	08-may-2024	(27.848)
NZD	165.000	USD	101.542	20-jun-2024	(2.957)
PEN	2.725.000	USD	719.877	03-abr-2024	12.690
PEN	2.990.000	USD	808.093	20-jun-2024	(5.459)
PHP	49.730.000	USD	893.902	03-abr-2024	(9.287)
PHP	28.570.000	USD	513.964	20-jun-2024	(6.422)
PLN	34.795.000	USD	8.741.505	03-abr-2024	(30.400)
PLN	20.824.000	USD	5.223.139	08-may-2024	(11.418)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
PLN	7.275.000	USD	1.844.887	20-jun-2024	(25.087)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
SEK	173.023.000	USD	16.518.947	03-abr-2024	(353.975)
SGD	7.444.000	USD	5.554.664	03-abr-2024	(41.358)
SGD	680.000	USD	513.023	20-jun-2024	(7.577)
THB	243.535.000	USD	6.780.198	03-abr-2024	(105.132)
THB	18.390.000	USD	508.714	20-jun-2024	(1.356)
TRY	5.305.000	USD	163.583	03-abr-2024	319
TRY	54.285.000	USD	1.505.926	20-jun-2024	23.017
TWD	173.320.000	USD	5.515.203	03-abr-2024	(98.615)
TWD	26.557.000	USD	833.553	08-may-2024	(191)
USD	10.948.512	AUD	16.737.000	03-abr-2024	41.545
USD	5221	AUD	8000	08-may-2024	2
USD	156.029	AUD	235.000	20-jun-2024	2547
USD	3.872.214	BRL	19.298.000	02-abr-2024	24.465
USD	703.821	BRL	3.506.000	03-abr-2024	4849
USD	312.085	BRL	1.552.000	08-abr-2024	2837
USD	103.358	BRL	511.000	10-abr-2024	1558
USD	309.986	BRL	1.550.000	03-may-2024	1899
USD	1.769.918	BRL	8.856.000	04-jun-2024	14.676
USD	153.234	BRL	770.000	28-jun-2024	986
USD	328.926	BRL	1.642.000	11-jul-2024	4675
USD	51.812	BRL	263.000	25-jul-2024	(52)
USD	13.268.195	CAD	17.977.000	03-abr-2024	(3.568)
USD	925.259	CAD	1.259.000	18-abr-2024	(4.418)
USD	1.569.716	CAD	2.125.000	08-may-2024	102
USD	10.057.717	CAD	13.540.000	20-jun-2024	50.253
USD	5.071.098	CHF	4.502.000	03-abr-2024	78.589
USD	439.842	CHF	397.000	08-may-2024	(2.133)
USD	221.138	CHF	192.000	20-jun-2024	6346
USD	5.587.280	CLP	5.448.173.000	03-abr-2024	26.762
USD	5.428.730	CLP	5.322.273.000	08-may-2024	2601
USD	914.460	CLP	877.900.000	21-jun-2024	20.273
USD	15.211.422	CNH	109.935.000	03-abr-2024	73.577
USD	7.928.972	CNH	57.368.000	08-may-2024	18.753
USD	1.029.218	CNH	7.404.000	20-jun-2024	5937
USD	5.260.684	COP	20.375.177.000	03-abr-2024	(9.602)
USD	42.155	COP	163.100.000	08-may-2024	219
USD	2.747.558	COP	12.039.800.000	14-ago-2024	(300.100)
USD	2.857.617	COP	11.967.700.000	16-ago-2024	(170.841)
USD	3.344.700	CZK	78.075.000	03-abr-2024	15.887
USD	21.843	CZK	510.000	09-may-2024	102
USD	765.006	CZK	17.749.000	20-jun-2024	8174
USD	1.035.683	DKK	7.130.000	30-abr-2024	2976
USD	86.467	DKK	585.000	20-jun-2024	1509
USD	250.580	EGP	11.890.000	06-ago-2024	8357
USD	234.748	EGP	11.890.000	08-ago-2024	(7.313)
USD	42.661.502	EUR	39.310.000	03-abr-2024	250.266
USD	16.915.284	EUR	15.591.000	30-abr-2024	76.078
USD	13.634.079	EUR	12.588.000	08-may-2024	33.884
USD	7.974.080	EUR	7.275.000	20-jun-2024	99.988
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
USD	26.086.485	GBP	20.534.000	03-abr-2024	169.374

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
USD	3.288.170	GBP	2.601.000	30-abr-2024	4817
USD	3.653.240	GBP	2.893.000	08-may-2024	1116
USD	1.117.369	GBP	875.000	20-jun-2024	12.522
USD	1.315.868	HKD	10.283.000	30-abr-2024	849
USD	371.948	HKD	2.901.000	20-jun-2024	451
USD	13.208.137	HUF	4.797.730.000	03-abr-2024	65.335
USD	857.006	HUF	322.320.000	18-abr-2024	(25.010)
USD	683.612	HUF	251.200.000	30-abr-2024	(3.231)
USD	8.218.223	HUF	2.998.500.000	08-may-2024	23.324
USD	1.452.206	HUF	530.400.000	20-jun-2024	5671
USD	464.958	IDR	7.316.000.000	03-abr-2024	3553
USD	545.763	IDR	8.583.000.000	20-jun-2024	5587
USD	580.854	ILS	2.333.000	29-mar-2024	(53.657)
USD	3.564.879	ILS	12.900.000	03-abr-2024	56.320
USD	2.096.870	ILS	7.665.000	08-may-2024	9216
USD	29.573.428	INR	2.463.512.000	03-abr-2024	36.558
USD	414.338	INR	34.850.000	12-abr-2024	(3.405)
USD	15.348	INR	1.280.000	08-may-2024	16
USD	140.074	INR	11.748.000	13-may-2024	(623)
USD	886.931	INR	73.940.000	20-jun-2024	2529
USD	115.675	INR	9.660.000	06-sep-2024	497
USD	15.027.749	JPY	2.240.690.000	03-abr-2024	223.734
USD	3.443.299	JPY	518.161.000	30-abr-2024	5733
USD	8.167.586	JPY	1.228.598.000	08-may-2024	6197
USD	9.500.219	JPY	1.418.950.000	01-jul-2024	(3.685)
USD	6.576.882	KRW	8.725.383.000	03-abr-2024	95.281
USD	5.451.492	KRW	7.336.153.000	08-may-2024	(8.783)
USD	278.603	KZT	127.600.000	20-jun-2024	(823)
USD	28.292.179	MXN	481.023.000	03-abr-2024	(637.933)
USD	7.423.720	MXN	137.710.000	08-abr-2024	(852.156)
USD	202.413	MXN	3.809.000	11-abr-2024	(26.388)
USD	188.071	MXN	3.374.000	07-may-2024	(13.767)
USD	14.858.916	MXN	248.950.000	08-may-2024	(31.097)
USD	11.613.035	MXN	202.591.000	20-jun-2024	(420.356)
USD	11.197.669	MXN	200.910.000	28-jun-2024	(721.733)
USD	5.396.010	MXN	98.570.000	03-jul-2024	(447.399)
USD	10.518.846	MXN	191.220.000	08-jul-2024	(808.001)
USD	4.626.436	MXN	80.153.000	10-jul-2024	(119.887)
USD	2.668.702	MXN	47.355.000	19-jul-2024	(131.450)
USD	2.671.650	MXN	47.355.000	29-jul-2024	(124.059)
USD	6.094.782	MXN	107.000.000	23-ago-2024	(197.243)
USD	4.262.939	MXN	77.010.000	13-sep-2024	(250.574)
USD	5.285.071	MXN	90.890.000	20-sep-2024	(36.075)
USD	7.747.489	MXN	137.710.000	07-oct-2024	(293.277)
USD	6.821.649	NOK	72.600.000	03-abr-2024	134.235
USD	62.446	NOK	650.000	18-jun-2024	2463
USD	14.055.943	NZD	23.250.000	03-abr-2024	165.227
USD	284.162	NZD	473.000	08-may-2024	1555
USD	101.891	NZD	165.000	20-jun-2024	3306
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
USD	734.798	PEN	2.725.000	03-abr-2024	2232

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de divisas a plazo (continuación)

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
USD	116.710	PEN	435.000	08-may-2024	(144)	
USD	1.370.646	PEN	5.057.000	20-jun-2024	13.147	
USD	884.258	PHP	49.730.000	03-abr-2024	(357)	
USD	256.351	PHP	14.430.000	08-may-2024	(185)	
USD	743.774	PHP	41.710.000	20-jun-2024	2801	
USD	8.741.588	PLN	34.795.000	03-abr-2024	30.485	
USD	155.527	PLN	620.000	08-may-2024	357	
USD	471.493	PLN	1.956.000	14-may-2024	(18.013)	
USD	776.368	PLN	3.057.000	20-jun-2024	11.677	
USD	16.747.785	SEK	173.023.000	03-abr-2024	582.812	
USD	8.823.187	SEK	93.548.000	08-may-2024	70.862	
USD	414.750	SEK	4.204.000	20-jun-2024	20.698	
USD	5.539.254	SGD	7.444.000	03-abr-2024	25.948	
USD	4.035.987	SGD	5.424.000	08-may-2024	12.205	
USD	512.562	SGD	680.000	20-jun-2024	7116	
USD	6.766.793	THB	243.535.000	03-abr-2024	91.727	
USD	4.286.087	THB	155.365.000	08-may-2024	15.502	
USD	990.227	THB	35.410.000	20-jun-2024	13.308	
USD	163.760	TRY	5.305.000	03-abr-2024	(142)	
USD	157.093	TRY	5.305.000	08-may-2024	160	
USD	470.184	TRY	17.105.000	20-jun-2024	(11.581)	
USD	163.905	TRY	5.876.000	09-jul-2024	1982	
USD	5.481.500	TWD	173.320.000	03-abr-2024	64.911	
USD	27.037.277	ZAR	519.410.000	03-abr-2024	(384.592)	
USD	19.363.204	ZAR	367.107.000	08-may-2024	36.714	
USD	2.970.725	ZAR	55.852.000	20-jun-2024	41.248	
ZAR	519.410.000	USD	27.360.537	03-abr-2024	61.334	
ZAR	3.830.000	USD	202.015	08-may-2024	(383)	
					USD	227.826
Cobertura de las Clases de Participaciones						
BRL	65.896.128	USD	13.203.952	30-abr-2024	(102.298)	
CHF	10.507.713	USD	11.796.054	30-abr-2024	(108.547)	
EUR	87.607.504	USD	95.736.125	30-abr-2024	(1.114.816)	
GBP	51.832.791	USD	66.203.520	30-abr-2024	(772.782)	
SGD	2.630.080	USD	1.967.921	30-abr-2024	(17.540)	
USD	263.582	CHF	237.696	30-abr-2024	(802)	
USD	22.174.425	EUR	20.459.996	30-abr-2024	76.413	
USD	153.736	GBP	121.638	30-abr-2024	187	
USD	25	SGD	34	30-abr-2024	-	
					USD	(2.040.185)
					USD	(1.812.359)

Los contratos de divisas a plazo detallados a continuación estaban vinculados a las siguientes contrapartes:

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contrapartes de contratos de divisas a plazo

Subfondo	Contraparte	Plusvalía/ (minusvalía) latente
S Schroder GAIA Asian Equity Long Short	ANZ	(61.287)
	Barclays Bank	(11.185)
	BNP Paribas	(7.607)
	Canadian Imperial Bank of Commerce	(327)
	HSBC	(71.453)
	Royal Bank of Canada	(770)
	Standard Chartered Bank	(15.231)
	State Street	(24.683)
	UBS	(4.413)
		USD
S Schroder GAIA BlueTrend	HSBC	(3.287.727)
	UBS	4.739.729
		USD
S Schroder GAIA Cat Bond	Brown Brothers Harriman & Co	630.490
	HSBC	(38.566.805)
		USD
S Schroder GAIA Contour Tech Equity	Brown Brothers Harriman & Co	77
	HSBC	(1.164.190)
	Morgan Stanley	2098
		USD
S Schroder GAIA Egerton Equity	Brown Brothers Harriman & Co	(2.655.299)
	HSBC	2.419.637
		EUR
S Schroder GAIA Helix	Goldman Sachs	(2.672.908)
	HSBC	(2.467.415)
	J.P. Morgan	(43.551)
		USD
S Schroder GAIA Oaktree Credit	Brown Brothers Harriman & Co	(5)
	HSBC	(206.214)
	State Street	424.666
		USD
S Schroder GAIA SEG US Equity	HSBC	(2.436.701)
		USD
S Schroder GAIA Sirios US Equity	HSBC	(399.833)
	Morgan Stanley	269.833
		USD
S Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	(50.122)
	Deutsche Bank	(164.283)
	HSBC	(1.835.156)
	Morgan Stanley	17.989
	Newedge Group	192.520
		USD
S Schroder GAIA Wellington Pagosa		

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contrapartes de contratos de divisas a plazo (continuación)

Subfondo	Contraparte	Plusvalía/ (minusvalía) latente
	Bank of America	37.582
	Barclays Bank	(606.816)
	BNP Paribas	99.981
	Citi Bank	(204.277)
	Deutsche Bank	695.223
	Goldman Sachs	113.859
	HSBC	(2.331.555)
	J.P. Morgan	614.757
	Morgan Stanley	(429.566)
	Standard Chartered Bank	(15.739)
	UBS	214.192
	USD	(1.812.359)

Operaciones al contado

Las operaciones al contado se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo sobre la base del tipo de cambio al contado al vencimiento del contrato correspondiente. La plusvalía o la minusvalía latente se muestra en el Balance en el epígrafe «Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre operaciones al contado».

A 31 de marzo de 2024, el siguiente subfondo estaba comprometido con operaciones al contado:

Divisa comprada	Cantidad comprada	Divisa vendida	Cantidad vendida	Fecha de liquidación	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Cobertura de cartera					
GBP	4.959.103	USD	6.265.856	03-abr-2024	(6.725)
USD	11.629	CHF	10.485	04-abr-2024	3
				USD	(6.722)

Contrapartes de operaciones al contado

Fondo	Contraparte	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
	Brown Brothers Harriman & Co	(6.722)
	USD	(6.722)

Contratos de futuros

Los contratos de futuros se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo. La plusvalía/(minusvalía) latente se muestra en el Balance bajo el apartado «Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos de futuros». A 31 de marzo de 2024, los siguientes subfondos mantenían contratos de futuros abiertos sobre índices (expuestos a renta variable), valores de renta fija y divisas:

Fecha de vencimiento	Cantidad	Contrato	Contraparte	Divisa	Posición (corta)/ larga	Precio de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend							
Dic-24	381	Futuro sobre CORRA a 3 meses	J.P. Morgan	CAD	(67.197.289)	95,49	53.616
Mar-25	65	Futuro sobre CORRA a 3 meses	J.P. Morgan	CAD	(11.492.027)	95,77	2879
Jun-25	60	Futuro sobre CORRA a 3 meses	J.P. Morgan	CAD	(10.632.922)	96,02	(129)
Sep-25	63	Futuro sobre CORRA a 3 meses	J.P. Morgan	CAD	(11.196.735)	96,22	9357
Dic-24	59	Futuro sobre Euribor a 3 meses	Morgan Stanley	EUR	15.431.047	96,98	620
Mar-25	55	Futuro sobre Euribor a 3 meses	Morgan Stanley	EUR	14.418.736	97,22	2320
Jun-25	49	Futuro sobre Euribor a 3 meses	Morgan Stanley	EUR	12.869.318	97,41	3641
Sep-26	16	Futuro sobre Euribor a 3 meses	Morgan Stanley	EUR	4.216.024	97,72	769

Schroder GAIA BlueTrend (continuación)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de futuros (continuación)

Fecha de vencimiento	Cantidad	Contrato	Contraparte	Divisa	Posición (corta)/ larga	Precio de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Mar-25	1	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(238.600)	95,43	25
Jun-25	2	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	478.825	95,70	(325)
Sep-25	6	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	1.440.063	95,94	(1.038)
Dic-26	52	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(12.522.988)	96,41	(9.663)
Mar-27	48	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(11.559.713)	96,43	(11.288)
Jun-27	45	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(10.836.038)	96,43	(12.338)
Sep-27	42	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(10.112.850)	96,43	(12.300)
Dic-27	41	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(9.872.438)	96,42	(10.613)
Mar-28	42	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(10.110.925)	96,41	(11.600)
Jun-28	41	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(9.869.525)	96,39	(10.450)
Jun-24	337	Futuro sobre efecto bancario a 90 días	Morgan Stanley	AUD	217.324.447	9,90	(6.506)
Sep-24	117	Futuro sobre efecto bancario a 90 días	Morgan Stanley	AUD	(75.465.080)	9,90	(7.522)
Dic-24	84	Futuro sobre efecto bancario a 90 días	Morgan Stanley	AUD	(54.198.075)	9,90	(8.556)
Mar-25	83	Futuro sobre efecto bancario a 90 días	Morgan Stanley	AUD	(53.567.838)	9,91	(11.790)
Abr-24	10	Futuro sobre índice Amsterdam	Morgan Stanley	EUR	(1.895.043)	883,28	(10.810)
Jun-24	449	Futuro sobre bono australiano a 3 años	Morgan Stanley	AUD	(31.246.453)	106,91	(35.650)
Jun-24	84	Futuro sobre bono australiano a 10 años	Morgan Stanley	AUD	(6.332.745)	116,58	(48.451)
Abr-24	1489	Futuro sobre índice BIST 30	Morgan Stanley	TRY	4.768.489	10.099,75	(116.990)
Abr-24	115	Futuro sobre índice CAC 40	Morgan Stanley	EUR	10.000.407	8.223,50	202.304
Jun-24	667	Futuro sobre bono canadiense a 10 años	J.P. Morgan	CAD	(58.851.397)	120,34	(405.758)
Abr-24	35	Futuro sobre CBOE VIX	Morgan Stanley	USD	(519.440)	14,37	16.536
May-24	50	Futuro sobre CBOE VIX	Morgan Stanley	USD	(777.430)	15,42	6505
Jun-24	20	Futuro sobre índice Dax	Morgan Stanley	EUR	9.718.281	18.776,00	409.963
Jun-24	33	Futuro sobre Dow Jones E-mini e-CBOT	J.P. Morgan	USD	6.494.620	40.176,00	134.420
Jun-24	6	Futuro sobre E-mini S&P 500 ESG	Morgan Stanley	USD	1.369.440	468,98	37.500
Jun-24	8	Futuro sobre E-mini S&P 500	Morgan Stanley	USD	2.114.763	5.308,50	8638
Jun-24	21	Futuro sobre bono Euro BUXL a 30 años	Morgan Stanley	EUR	(3.000.605)	135,80	(76.059)
Jun-24	123	Futuro sobre Euro Stoxx 50	Morgan Stanley	EUR	6.508.686	5.045,00	185.956
Jun-24	172	Futuro sobre Euro-BOBL	Morgan Stanley	EUR	(21.824.930)	118,25	(117.801)
Jun-24	135	Futuro sobre Euro-BTP	Morgan Stanley	EUR	17.213.807	119,01	119.375
Jun-24	115	Futuro sobre Euro-Bund	Morgan Stanley	EUR	(16.409.297)	133,38	(138.859)
Jun-24	130	Futuro sobre Euro-OAT	Morgan Stanley	EUR	(17.873.739)	128,17	(102.167)
Jun-24	129	Futuro sobre índice FTSE 100	Morgan Stanley	GBP	12.699.803	7.988,00	306.046
Abr-24	349	Futuro sobre FTSE China A50	Morgan Stanley	USD	4.260.977	12.120,00	(31.097)
Jun-24	40	Futuro sobre índice FTSE MIB	Morgan Stanley	EUR	7.097.457	34.211,00	284.250
Abr-24	275	Futuro sobre índice FTSE Taiwan	Morgan Stanley	USD	18.866.669	1.725,00	108.331
Jun-24	199	Futuro sobre FTSE/JSE Top 40	Morgan Stanley	ZAR	(7.037.797)	68.927,00	(204.269)
Abr-24	37	Futuro sobre índice Hang Seng	Morgan Stanley	HKD	(3.907.895)	16.570,00	(8.663)
Abr-24	107	Futuro sobre índice Hang Seng TECH	Morgan Stanley	HKD	(2.353.563)	3.472,00	(19.689)
Abr-24	40	Futuro sobre índice HSCEI	Morgan Stanley	HKD	(1.475.961)	5.814,00	(9.685)
Abr-24	24	Futuro sobre índice IBEX 35	Morgan Stanley	EUR	(2.770.129)	11.067,10	(95.409)
Mar-25	80	Futuro sobre índice ICE SONIA a 3 meses	Morgan Stanley	GBP	24.117.130	95,61	16.440
Jun-25	63	Futuro sobre índice ICE SONIA a 3 meses	Morgan Stanley	GBP	19.040.289	95,86	15.588
Sep-25	58	Futuro sobre índice ICE SONIA a 3 meses	Morgan Stanley	GBP	17.560.813	96,06	19.295
Dic-26	51	Futuro sobre índice ICE SONIA a 3 meses	Morgan Stanley	GBP	(15.501.678)	96,51	(29.108)
Abr-24	169	Futuro sobre IFSC Nifty 50	Morgan Stanley	USD	7.544.069	22.481,50	54.678
Jun-24	79	Futuro sobre bono a 10 años de Japón (OSE)	Morgan Stanley	JPY	76.024.130	145,88	105.610
Jun-24	310	Futuro sobre índice KOSPI12	J.P. Morgan	KRW	21.078.765	375,70	549.276
Jun-24	38	Futuro sobre Gilt largo	Morgan Stanley	GBP	4.760.451	99,94	32.841
Abr-24	491	Futuro sobre Mini Bovespa	Morgan Stanley	BRL	2.593.064	128.794,00	(71.317)
Jun-24	381	Futuro sobre índice MSCI EAFE	Morgan Stanley	USD	44.554.368	2.357,10	348.388
Jun-24	311	Futuro sobre índice MSCI Emerging Markets	Morgan Stanley	USD	16.326.635	1.049,00	(14.685)
Abr-24	182	Futuro sobre índice MSCI Singapore ETS	Morgan Stanley	SGD	3.914.294	290,85	6069
Jun-24	12	Futuro sobre Nasdaq 100 E-mini	Morgan Stanley	USD	4.400.414	18.475,00	33.586
Jun-24	22	Futuro sobre Nikkei 225 (OSE)	Morgan Stanley	JPY	5.787.351	40.230,00	59.260

Schroder GAIA BlueTrend (continuación)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de futuros (continuación)

Fecha de vencimiento	Cantidad	Contrato	Contraparte	Divisa	Posición (corta)/ larga	Precio de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
Jun-24	24	Futuro sobre Nikkei 225 (SGX)	Morgan Stanley	JPY	3.117.679	40.175,00	67.022	
Abr-24	77	Futuro sobre índice OMXS30	Morgan Stanley	SEK	(1.768.744)	2.524,50	(47.273)	
Jun-24	25	Futuro sobre Russell 2000 E-mini	Morgan Stanley	USD	2.636.065	2.145,90	46.310	
Jun-24	16	Futuro sobre S&P MidCap 400 E-mini	Morgan Stanley	USD	4.779.315	3.077,40	144.525	
Jun-24	188	Futuro sobre índice S&P/TSX 60	J.P. Morgan	CAD	36.742.521	1.341,40	492.457	
Jun-24	684	Futuro sobre índice SET 50	J.P. Morgan	THB	(3.145.967)	833,30	21.734	
Jun-24	296	Futuro sobre Short-Term Euro-BTP	Morgan Stanley	EUR	(33.795.806)	105,88	(15.870)	
Jun-24	480	Futuro sobre bono a 3 años de Corea del Sur	J.P. Morgan	KRW	37.379.617	104,85	4227	
Jun-24	59	Futuro sobre bono a 10 años de Corea del Sur	J.P. Morgan	KRW	4.968.052	113,58	9642	
Jun-24	299	Futuro sobre SPI 200	Morgan Stanley	AUD	37.700.150	7.951,00	1.029.835	
Jun-24	32	Futuro sobre índice Stoxx Euro ESG-X	Morgan Stanley	EUR	639.715	189,90	15.881	
Jun-24	147	Futuro sobre índice Swiss Market	Morgan Stanley	CHF	18.862.172	11.635,00	102.678	
Jun-24	71	Futuro sobre índice Topix	Morgan Stanley	JPY	12.697.582	2.749,50	198.078	
Jun-24	32	Futuro sobre índice WIG20	Morgan Stanley	PLN	384.919	2.430,00	4435	
							USD	3.557.178
Schroder GAIA Helix								
Jun-24	28	Futuro sobre E-mini S&P 500	Goldman Sachs	USD	(7.261.360)	5.308,50	(170.540)	
Jun-24	68	Futuro sobre Euro Stoxx	J.P. Morgan	EUR	(1.851.790)	515,80	(42.228)	
Jun-24	52	Futuro sobre índice FTSE 100	Goldman Sachs	GBP	(5.090.205)	7.988,00	(157.033)	
Jun-24	19	Futuro sobre índice FTSE 250	Goldman Sachs	GBP	(941.579)	19.969,00	(17.003)	
Jun-24	64	Futuro sobre FTSE/JSE Top 40	Goldman Sachs	ZAR	(2.297.381)	68.927,00	(32.187)	
Jun-24	142	Futuro sobre MSCI Asia	J.P. Morgan	USD	(8.253.520)	575,20	85.680	
Jun-24	461	Futuro sobre MSCI China	J.P. Morgan	USD	(9.828.925)	421,30	117.960	
Jun-24	42	Futuro sobre índice MSCI EAFE	J.P. Morgan	USD	(4.918.495)	2.357,10	(31.415)	
Jun-24	267	Futuro sobre índice MSCI Emerging Markets	J.P. Morgan	USD	(14.030.675)	1.049,00	26.525	
Jun-24	340	Futuro sobre MSCI Europe	Goldman Sachs	EUR	(12.198.475)	336,30	(150.461)	
Jun-24	77	Futuro sobre MSCI Poland	Goldman Sachs	USD	(1.713.597)	226,60	(31.224)	
Jun-24	37	Futuro sobre MSCI Switzerland	J.P. Morgan	CHF	(1.526.091)	3.728,00	(5.340)	
Jun-24	81	Futuro sobre índice MSCI World	J.P. Morgan	USD	(8.725.320)	10.906,00	(108.540)	
Jun-24	12	Futuro sobre SPI 200	J.P. Morgan	AUD	(1.530.612)	7.951,00	(25.558)	
Jun-24	3	Futuro sobre Stoxx 600 Banks	Goldman Sachs	EUR	28.842	186,60	1387	
Jun-24	56	Futuro sobre índice Topix	Goldman Sachs	JPY	(9.971.747)	2.749,50	(201.830)	
Jun-24	4	Futuro sobre bono US Ultra (CBT)	Goldman Sachs	USD	(512.674)	129,00	(3.326)	
							USD	(745.133)
Schroder GAIA Oaktree Credit								
Jun-24	92	Futuro sobre pagaré a 2 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	18.836.173	102,24	(23.610)	
Jun-24	65	Futuro sobre pagaré a 5 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	6.940.658	107,02	15.358	
							USD	(8.252)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified								
Jun-24	14	Futuro sobre Euribor a 3 meses	Newedge Group	EUR	(3.637.397)	96,36	(944)	
Sep-24	1	Futuro sobre Euribor a 3 meses	Newedge Group	EUR	260.879	96,68	(121)	
Dic-24	60	Futuro sobre Euribor a 3 meses	Newedge Group	EUR	(15.668.947)	96,98	(24.274)	
Mar-25	54	Futuro sobre Euribor a 3 meses	Newedge Group	EUR	14.145.018	97,22	13.836	
Jun-25	76	Futuro sobre Euribor a 3 meses	Newedge Group	EUR	19.915.719	97,41	50.504	
Sep-24	1	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(237.363)	94,87	200	
Dic-24	87	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(20.726.650)	95,14	34.788	
Mar-25	212	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(50.653.089)	95,43	75.189	
Jun-25	176	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(42.216.396)	95,70	108.395	
Sep-25	110	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(26.483.613)	95,94	101.488	
Dic-25	65	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(15.654.713)	96,12	35.213	
Mar-26	17	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	(4.091.663)	96,25	1250	
Jun-26	34	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	8.230.588	96,33	(42.963)	
Sep-26	29	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	6.987.100	96,38	88	
Abr-24	10	Futuro sobre índice Amsterdam	Morgan Stanley	EUR	(1.865.418)	883,28	(40.436)	

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (continuación)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de futuros (continuación)

Fecha de vencimiento	Cantidad	Contrato	Contraparte	Divisa	Posición (corta)/ larga	Precio de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Jun-24	18	Futuro sobre bono australiano a 3 años	Newedge Group	AUD	1.252.762	106,91	1309
Jun-24	9	Futuro sobre bono australiano a 10 años	Newedge Group	AUD	681.753	116,58	1946
Jun-24	1	Futuro sobre dólar australiano	Morgan Stanley	USD	66.020	65,33	(690)
Jun-24	3	Futuro sobre libra esterlina	Morgan Stanley	USD	239.306	126,27	(2.550)
Abr-24	51	Futuro sobre índice CAC 40	Citi Bank	EUR	4.475.849	8.223,50	48.832
Jun-24	180	Futuro sobre bono canadiense a 10 años	Citi Bank	CAD	(15.896.741)	120,34	(94.696)
Jun-24	3	Futuro sobre dólar canadiense	Morgan Stanley	USD	(222.225)	73,94	405
Abr-24	50	Futuro sobre CBOE VIX	Morgan Stanley	USD	768.627	14,37	(50.192)
May-24	31	Futuro sobre CBOE VIX	Morgan Stanley	USD	(496.196)	15,42	18.223
Jun-24	20	Futuro sobre índice Dax	Newedge Group	EUR	(9.918.299)	18.776,00	(209.944)
Jun-24	81	Futuro sobre Dow Jones E-mini e-CBOT	Morgan Stanley	USD	(15.900.721)	40.176,00	(370.559)
Jun-24	192	Futuro sobre E-mini S&P 500	Morgan Stanley	USD	50.182.144	5.308,50	779.456
Jun-24	9	Futuro sobre bono Euro BUXL a 30 años	Newedge Group	EUR	(1.287.478)	135,80	(31.092)
Jun-24	2	Futuro sobre Euro FX	Morgan Stanley	USD	(273.138)	1,08	2600
Jun-24	166	Futuro sobre Euro Stoxx 50	Newedge Group	EUR	8.848.623	5.045,00	186.421
Jun-24	95	Futuro sobre Euro Stoxx Banks	Morgan Stanley	EUR	652.310	135,40	41.552
Jun-24	125	Futuro sobre Euro-BOBL	Morgan Stanley	EUR	(15.884.717)	118,25	(62.034)
Jun-24	158	Futuro sobre Euro-BTP	Newedge Group	EUR	19.993.399	119,01	292.843
Jun-24	175	Futuro sobre Euro-Bund	Morgan Stanley	EUR	(24.919.320)	133,38	(262.657)
Jun-24	85	Futuro sobre Euro-OAT	Newedge Group	EUR	(11.669.704)	128,17	(83.773)
Jun-24	170	Futuro sobre Euro-Schatz	Morgan Stanley	EUR	(19.365.913)	105,70	(19.943)
Jun-24	5	Futuro sobre índice FTSE 100	Newedge Group	GBP	502.859	7.988,00	1243
Abr-24	279	Futuro sobre FTSE China A50	Newedge Group	USD	(3.398.407)	12.120,00	16.927
Jun-24	20	Futuro sobre índice FTSE MIB	Newedge Group	EUR	3.592.570	34.211,00	98.283
Jun-24	70	Futuro sobre FTSE/JSE Top 40	Newedge Group	ZAR	(2.475.725)	68.927,00	(71.736)
Abr-24	1	Futuro sobre índice IBEX 35	Newedge Group	EUR	(113.004)	11.067,10	(6.393)
Mar-25	9	Futuro sobre índice ICE SONIA a 3 meses	Newedge Group	GBP	2.711.335	95,61	3692
Abr-24	54	Futuro sobre IFSC Nifty 50	Newedge Group	USD	2.402.097	22.481,50	25.905
Jun-24	25	Futuro sobre bono a 10 años de Japón (OSE)	Newedge Group	JPY	24.026.457	145,88	65.233
Jun-24	2	Futuro sobre yen japonés	Morgan Stanley	USD	(171.156)	66,86	4018
Jun-24	13	Futuro sobre índice KOSDAQ150	Newedge Group	KRW	143.135	1.534,90	5082
Jun-24	125	Futuro sobre índice KOSPI2	Newedge Group	KRW	(8.445.079)	375,70	(275.905)
Jun-24	104	Futuro sobre Gilt largo	Newedge Group	GBP	12.923.015	99,94	195.469
Jun-24	7	Futuro sobre peso mexicano	Morgan Stanley	USD	205.201	5,95	2874
Jun-24	21	Futuro sobre índice MSCI EAFE	Citi Bank	USD	(2.442.510)	2.357,10	(32.445)
Jun-24	124	Futuro sobre índice MSCI Emerging Markets	Citi Bank	USD	(6.496.706)	1.049,00	(7.094)
Abr-24	53	Futuro sobre índice MSCI Singapore ETS	Newedge Group	SGD	(1.138.404)	290,85	(3.240)
Jun-24	93	Futuro sobre Nasdaq 100 E-mini	Morgan Stanley	USD	34.525.491	18.475,00	(161.991)
Jun-24	1	Futuro sobre dólar neozelandés	Morgan Stanley	USD	(61.250)	59,75	1500
Jun-24	12	Futuro sobre Nikkei 225 (OSE)	Newedge Group	JPY	3.151.348	40.230,00	37.713
Jun-24	21	Futuro sobre Nikkei 225 (YEN)	Morgan Stanley	JPY	(2.766.498)	40.360,00	(32.947)
Abr-24	86	Futuro sobre índice OMXS30	Newedge Group	SEK	(2.010.308)	2.524,50	(17.971)
Jun-24	107	Futuro sobre Russell 2000 E-mini	Morgan Stanley	USD	(11.246.590)	2.145,90	(233.975)
Jun-24	9	Futuro sobre S&P MidCap 400 E-mini	Morgan Stanley	USD	2.687.645	3.077,40	82.015
Jun-24	22	Futuro sobre índice S&P/TSX 60	Citi Bank	CAD	4.291.372	1.341,40	65.913
Jun-24	52	Futuro sobre índice SET 50	Newedge Group	THB	238.750	833,30	(1.235)
Jun-24	59	Futuro sobre Short-Term Euro-BTP	Newedge Group	EUR	6.726.932	105,88	12.558
Jun-24	233	Futuro sobre bono a 10 años de Corea del Sur	Newedge Group	KRW	(19.569.746)	113,58	(87.926)
Jun-24	16	Futuro sobre bono a 3 años de Corea del Sur	Newedge Group	KRW	1.244.702	104,85	1426
Jun-24	33	Futuro sobre SPI 200	Newedge Group	AUD	4.172.938	7.951,00	101.609
Jun-24	1	Futuro sobre Stoxx 600 Banks	Newedge Group	EUR	9985	186,60	81
Jun-24	48	Futuro sobre Stoxx Europe 600	Newedge Group	EUR	1.295.759	510,80	26.824
Jun-24	1	Futuro sobre franco suizo	Morgan Stanley	USD	142.969	111,82	(3.194)
Abr-24	57	Futuro sobre TAIEX	Newedge Group	TWD	7.066.946	20.202,00	129.230

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (continuación)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de futuros (continuación)

Fecha de vencimiento	Cantidad	Contrato	Contraparte	Divisa	Posición (corta)/ larga	Precio de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Jun-24	20	Futuro sobre índice Topix	Newedge Group	JPY	(3.535.143)	2.749,50	(97.437)
Jun-24	162	Futuro sobre pagaré a 10 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	17.862.703	110,80	86.391
Jun-24	29	Futuro sobre bono a 10 años US Ultra	Morgan Stanley	USD	(3.301.922)	114,61	(21.750)
Jun-24	116	Futuro sobre pagaré a 2 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	(23.734.195)	102,24	14.008
Jun-24	4	Futuro sobre pagaré a 3 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	833.898	104,28	351
Jun-24	251	Futuro sobre pagaré a 5 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	(26.786.228)	107,02	(74.694)
Abr-24	23	Futuro sobre índice US Dollar	Newedge Group	KRW	224.559	1.345,90	5382
Jun-24	1	Futuro sobre índice US Dollar	Morgan Stanley	USD	102.559	104,27	1710
Jun-24	39	Futuro sobre bono largo de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	(4.622.836)	120,44	(74.227)
Jun-24	3	Futuro sobre bono US Ultra (CBT)	Morgan Stanley	USD	(389.344)	129,00	2344
Abr-24	142	Futuro sobre VSTOXX Mini	Newedge Group	EUR	(231.970)	14,15	15.197
Jun-24	25	Futuro sobre índice WIG20	Newedge Group	PLN	(306.191)	2.430,00	2008
						USD	298.496
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Sep-24	194	Futuro sobre SOFR a 3 meses	Morgan Stanley	USD	46.009.088	94,87	437
Jun-24	21	Futuro sobre bono australiano a 10 años	Morgan Stanley	AUD	1.591.636	116,58	3663
Jun-24	18	Futuro sobre bono australiano a 3 años	Morgan Stanley	AUD	1.254.209	106,91	(138)
Jun-24	16	Futuro sobre bono canadiense a 10 años	Morgan Stanley	CAD	1.418.092	120,34	3369
Jun-24	13	Futuro sobre bono canadiense a 5 años	Morgan Stanley	CAD	(1.071.714)	111,47	1905
Jun-24	7	Futuro sobre E-mini S&P 500	Morgan Stanley	USD	(1.849.650)	5.308,50	(8.325)
Jun-24	31	Futuro sobre Euro Stoxx 50	Morgan Stanley	EUR	(1.643.339)	5.045,00	(43.928)
Jun-24	111	Futuro sobre Euro Stoxx Banks	Morgan Stanley	EUR	(775.172)	135,40	(35.551)
Jun-24	3	Futuro sobre Euro-BOBL	Morgan Stanley	EUR	(382.366)	118,25	(356)
Jun-24	2	Futuro sobre Euro-Bund	Morgan Stanley	EUR	(285.593)	133,38	(2.201)
Jun-24	19	Futuro sobre Euro-Schatz	Morgan Stanley	EUR	(2.166.271)	105,70	(383)
Jun-24	1	Futuro sobre bono a 10 años de Japón (OSE)	Morgan Stanley	JPY	(962.082)	145,88	(1.586)
Jun-24	11	Futuro sobre Gilt largo	Morgan Stanley	GBP	(1.381.423)	99,94	(6.109)
Jun-24	41	Futuro sobre S&P 500 Micro E-mini	Morgan Stanley	USD	(1.065.724)	5.308,50	(22.519)
Jun-24	5	Futuro sobre índice Topix	Morgan Stanley	JPY	(889.219)	2.749,50	(18.926)
Jun-24	38	Futuro sobre pagaré a 10 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	(4.199.656)	110,80	(10.625)
Jun-24	8	Futuro sobre bono a 10 años US Ultra	Morgan Stanley	USD	(923.500)	114,61	6625
Jun-24	159	Futuro sobre pagaré a 2 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	32.524.766	102,24	(11.750)
Jun-24	280	Futuro sobre pagaré a 5 años de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	(29.987.056)	107,02	22.681
Jun-24	2	Futuro sobre bono largo de EE. UU. (CBT)	Morgan Stanley	USD	(245.547)	120,44	4672
Jun-24	18	Futuro sobre bono US Ultra (CBT)	Morgan Stanley	USD	2.291.281	129,00	30.719
						USD	(88.326)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de opciones

Los contratos de opciones se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo, y el valor de mercado, si es distinto de cero, se muestra en el Balance en el epígrafe «Opciones y swaptions a valor de mercado».

A 31 de marzo de 2024, los siguientes subfondos estaban comprometidos con contratos de opciones existentes sobre índices financieros y participaciones internacionales cotizadas:

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend						
(4.495.649)	Venta sobre UBS ETC vinculada a una cesta de Systematica Strategy Delta-1 sobre un contrato de futuros sobre materias primas Precio de ejercicio 58,32 Con vencimiento el 28-mar-2024	UBS	USD	(14.833)	-	14.833
				USD	-	14.833
Schroder GAIA Contour Tech Equity						
2884	Compra sobre Paramount Global Precio de ejercicio 17,50 Con vencimiento el 21-jun-2024	Morgan Stanley	USD	236.488	77.868	(158.620)
(2.884)	Compra sobre Paramount Global Precio de ejercicio 22,50 Con vencimiento el 21-jun-2024	Morgan Stanley	USD	(60.564)	(21.630)	38.934
				USD	56.238	(119.686)
Schroder GAIA Helix						
229	Compra sobre Hang Seng Index Precio de ejercicio 17.100,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	J.P. Morgan	HKD	344.201	198.966	(145.235)
5	Venta sobre el índice CBOE Mini Precio de ejercicio 4.850,00 Con vencimiento el 21-jun-2024	UBS	USD	24.319	13.325	(10.994)
23	Venta sobre el índice CBOE Mini Precio de ejercicio 5.000,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	UBS	USD	62.416	14.950	(47.466)
17	Venta sobre el índice CBOE Mini Precio de ejercicio 5.100,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	UBS	USD	28.623	21.335	(7.288)
71	Venta sobre Deutsche Boerse AG German Stock Index DAX Precio de ejercicio 17.400,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	UBS	EUR	27.880	7994	(19.886)
5.443.927	Venta sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 146,00 Con vencimiento el 17-abr-2024	Goldman Sachs	USD	28.494	5816	(22.678)
60	Venta sobre el índice FTSE 100 Precio de ejercicio 7.600,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	UBS	GBP	31.556	4358	(27.198)
74	Venta sobre el índice FTSE 100 Precio de ejercicio 7.800,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	UBS	GBP	28.231	21.267	(6.964)
(55)	Venta sobre el índice Hang Seng Precio de ejercicio 16.000,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	UBS	HKD	(50.070)	(40.056)	10.014
153.500	Venta sobre el índice JPHEUML1 Precio de ejercicio 106,45 Con vencimiento el 19-abr-2024	J.P. Morgan	USD	227.042	112.950	(114.092)
20	Venta sobre el índice MSCI Emerging Markets Precio de ejercicio 1.010,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Barclays Bank	USD	11.874	4950	(6.924)
20	Venta sobre el índice MSCI Emerging Markets Precio de ejercicio 940,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	UBS	USD	12.874	1050	(11.824)
				USD	366.905	(410.535)
Schroder GAIA SEG US Equity						
500	Compra sobre 3M Co. Precio de ejercicio 105,00 Con vencimiento el 20-jun-2025	Goldman Sachs	USD	501.442	758.749	257.307
326	Compra sobre Citizens Financial Group, Inc. Precio de ejercicio 27,50 Con vencimiento el 16-ene-2026	Goldman Sachs	USD	300.001	407.500	107.499

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA SEG US Equity (continuación)						
196	Compra sobre Coherent Corp. Precio de ejercicio 40,00 Con vencimiento el 17-ene-2025	Goldman Sachs	USD	224.777	503.720	278.943
257	Compra sobre Coherent Corp. Precio de ejercicio 75,00 Con vencimiento el 16-ene-2026	Goldman Sachs	USD	339.195	355.945	16.750
170	Compra sobre eBay, Inc. Precio de ejercicio 50,00 Con vencimiento el 16-ene-2026	Goldman Sachs	USD	178.844	184.450	5606
623	Compra sobre Intel Corp. Precio de ejercicio 30,00 Con vencimiento el 17-ene-2025	Goldman Sachs	USD	593.320	985.898	392.578
1142	Compra sobre Intel Corp. Precio de ejercicio 55,00 Con vencimiento el 18-dic-2026	Goldman Sachs	USD	1.038.954	947.860	(91.094)
211	Compra sobre PayPal Holdings, Inc. Precio de ejercicio 70,00 Con vencimiento el 16-ene-2026	Goldman Sachs	USD	304.911	327.578	22.667
1645	Compra sobre Pinterest, Inc. Precio de ejercicio 40,00 Con vencimiento el 20-jun-2025	Goldman Sachs	USD	1.005.139	908.863	(96.276)
26	Compra sobre el índice Russell 2000 Precio de ejercicio 2.100,00 Con vencimiento el 20-jun-2025	Goldman Sachs	USD	479.271	657.800	178.529
1366	Compra sobre VF Corp. Precio de ejercicio 17,50 Con vencimiento el 19-sep-2025	Goldman Sachs	USD	386.615	424.143	37.528
95	Venta sobre Eli Lilly & Co. Precio de ejercicio 500,00 Con vencimiento el 18-dic-2026	Goldman Sachs	USD	327.753	276.450	(51.303)
				USD	6.738.956	1.058.734
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
274	Compra sobre Antero Resources Corp. Precio de ejercicio 33,00 Con vencimiento el 17-ene-2025	Morgan Stanley	USD	76.185	82.610	6425
45	Compra sobre Apple, Inc. Precio de ejercicio 180,00 Con vencimiento el 26-abr-2024	Morgan Stanley	USD	5220	4927	(293)
45	Compra sobre Apple, Inc. Precio de ejercicio 185,00 Con vencimiento el 05-abr-2024	Morgan Stanley	USD	3096	112	(2.984)
4	Compra sobre Broadcom, Inc. Precio de ejercicio 1.470,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	11.351	2379	(8.972)
(46)	Compra sobre Celsius Holdings, Inc. Precio de ejercicio 100,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	(21.879)	(12.697)	9182
17	Compra sobre Charter Communications, Inc. Precio de ejercicio 330,00 Con vencimiento el 28-mar-2024	Morgan Stanley	USD	2593	85	(2.508)
57	Compra sobre Chesapeake Energy Corp. Precio de ejercicio 100,00 Con vencimiento el 17-ene-2025	Morgan Stanley	USD	22.709	28.500	5791
88	Compra sobre EchoStar Corp. Precio de ejercicio 20,00 Con vencimiento el 19-jul-2024	Morgan Stanley	USD	11.673	6292	(5.381)
(51)	Compra sobre elf Beauty, Inc. Precio de ejercicio 260,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	(29.464)	(8.288)	21.176
108	Compra sobre Endeavor Group Holdings, Inc. Precio de ejercicio 26,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	7702	7560	(142)
11	Compra sobre Enphase Energy, Inc. Precio de ejercicio 122,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	5555	7013	1458

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
258	Compra sobre EQT Corp. Precio de ejercicio 43,00 Con vencimiento el 17-ene-2025	Morgan Stanley	USD	91.156	70.692	(20.464)
(4.905.000)	Compra sobre divisas AUD/USD Precio de ejercicio 0,64 Con vencimiento el 17-abr-2024	Bank of America	AUD	(90.429)	(68.626)	21.803
360.000	Compra sobre divisas AUD/USD Precio de ejercicio 0,65 Con vencimiento el 04-abr-2024	Bank of America	AUD	2174	682	(1.492)
355.000	Compra sobre divisas AUD/USD Precio de ejercicio 0,66 Con vencimiento el 18-abr-2024	Bank of America	AUD	2090	861	(1.229)
4.905.000	Compra sobre divisas AUD/USD Precio de ejercicio 0,67 Con vencimiento el 17-abr-2024	Bank of America	AUD	33.578	1385	(32.193)
211.000	Compra sobre divisas EUR/AUD Precio de ejercicio 1,65 Con vencimiento el 11-abr-2024	Morgan Stanley	EUR	1629	1095	(534)
216.000	Compra sobre divisas EUR/AUD Precio de ejercicio 1,66 Con vencimiento el 25-abr-2024	Bank of America	EUR	1532	1256	(276)
224.000	Compra sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,08 Con vencimiento el 03-may-2024	UBS	EUR	3175	1624	(1.551)
214.000	Compra sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,09 Con vencimiento el 18-abr-2024	UBS	EUR	1404	267	(1.137)
214.000	Compra sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,09 Con vencimiento el 19-jun-2024	HSBC	EUR	2528	1598	(930)
211.000	Compra sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,10 Con vencimiento el 11-abr-2024	Bank of America	EUR	1569	79	(1.490)
185.000	Compra sobre divisas GBP/AUD Precio de ejercicio 1,93 Con vencimiento el 25-abr-2024	Morgan Stanley	GBP	1556	1670	114
183.000	Compra sobre divisas GBP/JPY Precio de ejercicio 189,02 Con vencimiento el 18-abr-2024	Morgan Stanley	GBP	1986	2852	866
186.000	Compra sobre divisas GBP/JPY Precio de ejercicio 189,81 Con vencimiento el 04-abr-2024	Morgan Stanley	GBP	1996	1842	(154)
190.000	Compra sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,27 Con vencimiento el 30-abr-2024	Barclays Bank	GBP	3385	695	(2.690)
102.000	Compra sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,28 Con vencimiento el 14-jun-2024	Barclays Bank	GBP	1507	642	(865)
385.000	Compra sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,61 Con vencimiento el 03-jun-2024	HSBC	NZD	3866	1370	(2.496)
385.000	Compra sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,61 Con vencimiento el 04-abr-2024	Bank of America	NZD	2168	10	(2.158)
1.077.000	Compra sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 4,93 Con vencimiento el 08-abr-2024	Bank of America	USD	27.920	18.798	(9.122)
241.000	Compra sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 4,97 Con vencimiento el 02-may-2024	Morgan Stanley	USD	5400	4204	(1.196)
348.000	Compra sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 4,99 Con vencimiento el 11-abr-2024	Deutsche Bank	USD	3535	3370	(165)
1.418.000	Compra sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,00 Con vencimiento el 17-abr-2024	UBS	USD	15.073	14.075	(998)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
349.000	Compra sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,00 Con vencimiento el 29-abr-2024	Barclays Bank	USD	3668	4692	1024
233.000	Compra sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,02 Con vencimiento el 14-jun-2024	Morgan Stanley	USD	4511	4741	230
1.778.000	Compra sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,04 Con vencimiento el 18-abr-2024	Morgan Stanley	USD	19.645	12.371	(7.274)
532.000	Compra sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,06 Con vencimiento el 23-jul-2024	Bank of America	USD	19.714	12.494	(7.220)
312.000	Compra sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,22 Con vencimiento el 03-abr-2024	Bank of America	USD	3430	10	(3.420)
1.491.000	Compra sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,52 Con vencimiento el 01-abr-2024	Barclays Bank	USD	24.870	-	(24.870)
241.000	Compra sobre divisas USD/CAD Precio de ejercicio 1,35 Con vencimiento el 07-may-2024	Goldman Sachs	USD	2498	2224	(274)
231.000	Compra sobre divisas USD/CAD Precio de ejercicio 1,35 Con vencimiento el 11-abr-2024	Bank of America	USD	1330	1585	255
233.000	Compra sobre divisas USD/CAD Precio de ejercicio 1,35 Con vencimiento el 21-jun-2024	UBS	USD	2209	2653	444
242.000	Compra sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,86 Con vencimiento el 03-may-2024	UBS	USD	3473	9952	6479
(240.000)	Compra sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,88 Con vencimiento el 14-may-2024	Goldman Sachs	USD	(3.214)	(5.510)	(2.296)
232.000	Compra sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,88 Con vencimiento el 19-jun-2024	UBS	USD	2841	4892	2051
2.588.000	Compra sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,89 Con vencimiento el 08-nov-2024	UBS	USD	26.786	45.119	18.333
(232.000)	Compra sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,90 Con vencimiento el 27-jun-2024	UBS	USD	(2.945)	(2.482)	463
(242.000)	Compra sobre divisas USD/CLP Precio de ejercicio 953,50 Con vencimiento el 02-may-2024	Morgan Stanley	USD	(6.693)	(8.070)	(1.377)
348.000	Compra sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 7,18 Con vencimiento el 11-abr-2024	HSBC	USD	1023	4184	3161
349.000	Compra sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 7,19 Con vencimiento el 04-abr-2024	Morgan Stanley	USD	1056	3380	2324
1.725.000	Compra sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 7,35 Con vencimiento el 05-mar-2025	J.P. Morgan	USD	13.019	18.615	5596
1.704.000	Compra sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 7,35 Con vencimiento el 18-feb-2025	BNP Paribas	USD	15.847	17.905	2058
232.000	Compra sobre divisas USD/COP Precio de ejercicio 3.902,35 Con vencimiento el 27-jun-2024	Barclays Bank	USD	4816	5579	763
240.000	Compra sobre divisas USD/COP Precio de ejercicio 3.980,00 Con vencimiento el 14-may-2024	Bank of America	USD	6521	1744	(4.777)
1.882.000	Compra sobre divisas USD/CZK Precio de ejercicio 24,68 Con vencimiento el 16-abr-2024	Bank of America	USD	21.088	210	(20.878)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
1.437.000	Compra sobre divisas USD/HUF Precio de ejercicio 362,95 Con vencimiento el 09-abr-2024	J.P. Morgan	USD	16.215	13.290	(2.925)
355.000	Compra sobre divisas USD/HUF Precio de ejercicio 364,36 Con vencimiento el 02-abr-2024	J.P. Morgan	USD	4027	1512	(2.515)
1.437.000	Compra sobre divisas USD/HUF Precio de ejercicio 366,05 Con vencimiento el 04-abr-2024	Goldman Sachs	USD	15.540	4210	(11.330)
351.000	Compra sobre divisas USD/HUF Precio de ejercicio 366,45 Con vencimiento el 11-abr-2024	Goldman Sachs	USD	3952	1818	(2.134)
(1.882.000)	Compra sobre divisas USD/HUF Precio de ejercicio 406,50 Con vencimiento el 16-abr-2024	Citi Bank	USD	(31.226)	(74)	31.152
(349.000)	Compra sobre divisas USD/ILS Precio de ejercicio 3,57 Con vencimiento el 02-abr-2024	Bank of America	USD	(4.125)	(10.175)	(6.050)
242.000	Compra sobre divisas USD/INR Precio de ejercicio 83,34 Con vencimiento el 02-may-2024	Morgan Stanley	USD	1419	924	(495)
2.043.000	Compra sobre divisas USD/INR Precio de ejercicio 83,49 Con vencimiento el 04-sep-2024	Goldman Sachs	USD	16.906	20.693	3787
244.000	Compra sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 143,15 Con vencimiento el 12-abr-2024	Bank of America	USD	4508	12.808	8300
(241.000)	Compra sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 144,36 Con vencimiento el 02-may-2024	BNP Paribas	USD	(4.595)	(10.315)	(5.720)
(233.000)	Compra sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 146,18 Con vencimiento el 14-jun-2024	Morgan Stanley	USD	(3.935)	(6.876)	(2.941)
(347.000)	Compra sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 147,00 Con vencimiento el 11-abr-2024	Morgan Stanley	USD	(3.456)	(9.732)	(6.276)
237.000	Compra sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 148,55 Con vencimiento el 24-may-2024	Morgan Stanley	USD	3596	4343	747
233.000	Compra sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 150,50 Con vencimiento el 25-abr-2024	Bank of America	USD	2068	2224	156
(348.000)	Compra sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 16,83 Con vencimiento el 11-abr-2024	Bank of America	USD	(2.727)	(899)	1828
233.000	Compra sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 16,94 Con vencimiento el 14-jun-2024	Morgan Stanley	USD	4052	2912	(1.140)
(352.000)	Compra sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 16,95 Con vencimiento el 04-abr-2024	Barclays Bank	USD	(2.934)	(152)	2782
241.000	Compra sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 17,39 Con vencimiento el 02-may-2024	Morgan Stanley	USD	5140	382	(4.758)
1.274.000	Compra sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 17,87 Con vencimiento el 03-may-2024	Deutsche Bank	USD	45.979	871	(45.108)
1.229.000	Compra sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 18,39 Con vencimiento el 10-may-2024	Bank of America	USD	43.204	588	(42.616)
(1.229.000)	Compra sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 19,69 Con vencimiento el 10-may-2024	Bank of America	USD	(19.674)	(137)	19.537
(233.000)	Compra sobre divisas USD/SEK Precio de ejercicio 10,30 Con vencimiento el 14-jun-2024	Morgan Stanley	USD	(4.028)	(8.954)	(4.926)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
(241.000)	Compra sobre divisas USD/SEK Precio de ejercicio 10,39 Con vencimiento el 02-may-2024	HSBC	USD	(4.997)	(7.229)	(2.232)
(348.000)	Compra sobre divisas USD/ZAR Precio de ejercicio 18,63 Con vencimiento el 11-abr-2024	HSBC	USD	(4.382)	(6.723)	(2.341)
1.084.000	Compra sobre divisas USD/ZAR Precio de ejercicio 19,28 Con vencimiento el 02-abr-2024	Bank of America	USD	15.778	531	(15.247)
311.000	Compra sobre Lululemon Athletica, Inc. Precio de ejercicio 19,74 Con vencimiento el 09-abr-2024	UBS	USD	3729	135	(3.594)
22	Compra sobre Madison Square Garden Sports Corp. Precio de ejercicio 430,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	9153	2134	(7.019)
18	Compra sobre Maplebear, Inc. Precio de ejercicio 210,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	5554	1008	(4.546)
39	Compra sobre Marvell Technology, Inc. Precio de ejercicio 40,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	3985	1950	(2.035)
30	Compra sobre Meta Platforms, Inc. Precio de ejercicio 70,00 Con vencimiento el 26-abr-2024	Morgan Stanley	USD	5828	12.825	6997
6	Compra sobre el índice MSCI Emerging Markets Precio de ejercicio 520,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	6846	1695	(5.151)
8	Compra sobre NVIDIA Corp. Precio de ejercicio 1.080,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	7907	6080	(1.827)
(10)	Compra sobre PayPal Holdings, Inc. Precio de ejercicio 1.050,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	(35.858)	(19.400)	16.458
79	Compra sobre el índice Russell 2000 Precio de ejercicio 70,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	9584	8058	(1.526)
2	Compra sobre el índice Russell 2000 Precio de ejercicio 2.170,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	4595	3910	(685)
8	Compra sobre el índice S&P North American Expanded Technology Software Precio de ejercicio 2.190,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	29.611	28.280	(1.331)
460	Compra sobre Snowflake, Inc. Precio de ejercicio 862,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	3616	1218	(2.398)
22	Compra sobre SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF Precio de ejercicio 170,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	4629	6182	1553
165	Compra sobre Tesla, Inc. Precio de ejercicio 5.955,00 Con vencimiento el 26-abr-2024	Morgan Stanley	USD	14.175	31.897	17.722
28	Compra sobre Tesla, Inc. Precio de ejercicio 190,00 Con vencimiento el 05-abr-2024	Morgan Stanley	USD	4312	2758	(1.554)
29	Compra sobre TKO Group Holdings, Inc. Precio de ejercicio 215,00 Con vencimiento el 28-mar-2024	Morgan Stanley	USD	15.829	29	(15.800)
23	Compra sobre Tripadvisor, Inc. Precio de ejercicio 91,14 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	4888	1725	(3.163)
83	Compra sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 30,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	4406	2283	(2.123)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
32	Compra sobre Twilio, Inc. Precio de ejercicio 85,00 Con vencimiento el 21-jun-2024	Morgan Stanley	USD	10.795	1680	(9.115)
8727	Compra sobre Ubisoft Entertainment SA Precio de ejercicio 32,00 Con vencimiento el 20-dic-2024	Goldman Sachs	EUR	20.143	5156	(14.987)
45	Compra sobre Walt Disney Co. Precio de ejercicio 135,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	8052	7223	(829)
33	Compra sobre Wayfair, Inc. Precio de ejercicio 74,00 Con vencimiento el 26-abr-2024	Morgan Stanley	USD	11.413	8003	(3.410)
(17)	Venta sobre Advanced Micro Devices, Inc. Precio de ejercicio 160,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	(2.160)	(1.590)	570
17	Venta sobre Antero Resources, Inc. Precio de ejercicio 180,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	9157	11.433	2276
45	Venta sobre Alphabet, Inc. Precio de ejercicio 145,00 Con vencimiento el 26-abr-2024	Morgan Stanley	USD	10.221	9900	(321)
62	Venta sobre Amazon.com, Inc. Precio de ejercicio 165,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	3957	2108	(1.849)
(274)	Venta sobre Antero Resources Corp. Precio de ejercicio 20,00 Con vencimiento el 17-ene-2025	Morgan Stanley	USD	(40.479)	(21.098)	19.381
176.995	Venta sobre Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA Precio de ejercicio 10,00 Con vencimiento el 21-jun-2024	Goldman Sachs	EUR	51.382	40.174	(11.208)
40	Venta sobre Blackstone, Inc. Precio de ejercicio 115,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	7300	1380	(5.920)
391	Venta sobre Carlyle Group, Inc. Precio de ejercicio 42,50 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	35.705	4888	(30.817)
285	Venta sobre Carlyle Group, Inc. Precio de ejercicio 45,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	39.135	38.475	(660)
119	Venta sobre el índice CBOE Mini Precio de ejercicio 500,00 Con vencimiento el 05-abr-2024	Morgan Stanley	USD	10.371	952	(9.419)
46	Venta sobre Celsius Holdings, Inc. Precio de ejercicio 85,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	37.751	40.250	2499
17	Venta sobre Charter Communications, Inc. Precio de ejercicio 250,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	7590	850	(6.740)
(57)	Venta sobre Chesapeake Energy Corp. Precio de ejercicio 60,00 Con vencimiento el 17-ene-2025	Morgan Stanley	USD	(9.670)	(7.553)	2117
(11)	Venta sobre Coinbase Global, Inc. Precio de ejercicio 190,00 Con vencimiento el 12-abr-2024	Morgan Stanley	USD	(1.778)	(600)	1178
11	Venta sobre Coinbase Global, Inc. Precio de ejercicio 225,00 Con vencimiento el 12-abr-2024	Morgan Stanley	USD	8717	3520	(5.197)
119	Venta sobre Comcast Corp. Precio de ejercicio 41,00 Con vencimiento el 26-abr-2024	Morgan Stanley	USD	9809	7616	(2.193)
6	Venta sobre Costco Wholesale Corp. Precio de ejercicio 700,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	4984	3720	(1.264)
28	Venta sobre Digital Realty Trust, Inc. Precio de ejercicio 137,00 Con vencimiento el 12-abr-2024	Morgan Stanley	USD	6017	2450	(3.567)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
3290	Venta sobre el índice Dow Jones U.S. Real Estate Precio de ejercicio 217,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	4639	4639	-
11	Venta sobre Duolingo, Inc. Precio de ejercicio 200,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	4713	2530	(2.183)
51	Venta sobre elf Beauty, Inc. Precio de ejercicio 180,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	47.437	37.230	(10.207)
(258)	Venta sobre EQT Corp. Precio de ejercicio 28,00 Con vencimiento el 17-ene-2025	Morgan Stanley	USD	(35.522)	(27.477)	8045
5	Venta sobre Equinix, Inc. Precio de ejercicio 710,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	6481	2775	(3.706)
5	Venta sobre Equinix, Inc. Precio de ejercicio 770,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	5440	2000	(3.440)
12.136	Venta sobre el índice Euro Stoxx Banks Precio de ejercicio 132,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Goldman Sachs	EUR	19.828	18.760	(1.068)
3.465.000	Venta sobre divisas AUD/USD Precio de ejercicio 0,65 Con vencimiento el 01-may-2024	Morgan Stanley	AUD	21.125	15.998	(5.127)
360.000	Venta sobre divisas AUD/USD Precio de ejercicio 0,65 Con vencimiento el 04-abr-2024	Bank of America	AUD	2174	1066	(1.108)
355.000	Venta sobre divisas AUD/USD Precio de ejercicio 0,66 Con vencimiento el 18-abr-2024	Bank of America	AUD	2090	2811	721
211.000	Venta sobre divisas EUR/AUD Precio de ejercicio 1,65 Con vencimiento el 11-abr-2024	Morgan Stanley	EUR	1629	760	(869)
216.000	Venta sobre divisas EUR/AUD Precio de ejercicio 1,66 Con vencimiento el 25-abr-2024	Bank of America	EUR	1532	1467	(65)
1.721.000	Venta sobre divisas EUR/PLN Precio de ejercicio 4,34 Con vencimiento el 10-may-2024	Barclays Bank	EUR	13.020	15.896	2876
224.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,08 Con vencimiento el 03-may-2024	UBS	EUR	3175	1395	(1.780)
214.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,09 Con vencimiento el 18-abr-2024	UBS	EUR	1404	2852	1448
214.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,09 Con vencimiento el 19-jun-2024	HSBC	EUR	2528	3136	608
211.000	Venta sobre divisas EUR/USD Precio de ejercicio 1,10 Con vencimiento el 11-abr-2024	Bank of America	EUR	1569	3496	1927
185.000	Venta sobre divisas GBP/AUD Precio de ejercicio 1,93 Con vencimiento el 25-abr-2024	Morgan Stanley	GBP	1556	1079	(477)
183.000	Venta sobre divisas GBP/JPY Precio de ejercicio 189,02 Con vencimiento el 18-abr-2024	Morgan Stanley	GBP	1986	918	(1.068)
186.000	Venta sobre divisas GBP/JPY Precio de ejercicio 189,81 Con vencimiento el 04-abr-2024	Morgan Stanley	GBP	1996	366	(1.630)
940.000	Venta sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,22 Con vencimiento el 29-may-2024	Bank of America	GBP	10.063	1486	(8.577)
190.000	Venta sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,27 Con vencimiento el 30-abr-2024	Barclays Bank	GBP	3385	2973	(412)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
102.000	Venta sobre divisas GBP/USD Precio de ejercicio 1,28 Con vencimiento el 14-jun-2024	Barclays Bank	GBP	1507	2612	1105
3.760.000	Venta sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,60 Con vencimiento el 17-abr-2024	Bank of America	NZD	21.022	27.889	6867
3.735.000	Venta sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,60 Con vencimiento el 18-abr-2024	Bank of America	NZD	21.710	31.096	9386
385.000	Venta sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,61 Con vencimiento el 03-jun-2024	HSBC	NZD	3866	5933	2067
385.000	Venta sobre divisas NZD/USD Precio de ejercicio 0,61 Con vencimiento el 04-abr-2024	Bank of America	NZD	2168	4937	2769
(1.082.000)	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 4,71 Con vencimiento el 09-jul-2024	Morgan Stanley	USD	(13.495)	(1.383)	12.112
(1.491.000)	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 4,80 Con vencimiento el 01-abr-2024	Barclays Bank	USD	(19.562)	-	19.562
(506.000)	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 4,87 Con vencimiento el 26-jun-2024	Morgan Stanley	USD	(3.345)	(2.535)	810
1.077.000	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 4,93 Con vencimiento el 08-abr-2024	Bank of America	USD	25.770	618	(25.152)
241.000	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 4,97 Con vencimiento el 02-may-2024	Morgan Stanley	USD	5400	1223	(4.177)
1.082.000	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 4,99 Con vencimiento el 09-jul-2024	Morgan Stanley	USD	39.138	14.809	(24.329)
348.000	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 4,99 Con vencimiento el 11-abr-2024	Deutsche Bank	USD	3535	1329	(2.206)
349.000	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,00 Con vencimiento el 29-abr-2024	Barclays Bank	USD	3668	2430	(1.238)
233.000	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,02 Con vencimiento el 14-jun-2024	Morgan Stanley	USD	4511	3299	(1.212)
506.000	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,03 Con vencimiento el 26-jun-2024	Morgan Stanley	USD	9801	8018	(1.783)
532.000	Venta sobre divisas USD/BRL Precio de ejercicio 5,06 Con vencimiento el 23-jul-2024	Bank of America	USD	17.620	11.036	(6.584)
(3.107.000)	Venta sobre divisas USD/CAD Precio de ejercicio 1,32 Con vencimiento el 17-abr-2024	Bank of America	USD	(18.682)	(207)	18.475
241.000	Venta sobre divisas USD/CAD Precio de ejercicio 1,35 Con vencimiento el 07-may-2024	Goldman Sachs	USD	2498	864	(1.634)
231.000	Venta sobre divisas USD/CAD Precio de ejercicio 1,35 Con vencimiento el 11-abr-2024	Bank of America	USD	1330	396	(934)
233.000	Venta sobre divisas USD/CAD Precio de ejercicio 1,35 Con vencimiento el 21-jun-2024	UBS	USD	2209	1685	(524)
3.107.000	Venta sobre divisas USD/CAD Precio de ejercicio 1,36 Con vencimiento el 17-abr-2024	Bank of America	USD	52.076	22.434	(29.642)
(2.588.000)	Venta sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,82 Con vencimiento el 08-nov-2024	UBS	USD	(29.115)	(6.237)	22.878

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
242.000	Venta sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,86 Con vencimiento el 03-may-2024	UBS	USD	3473	33	(3.440)
(240.000)	Venta sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,88 Con vencimiento el 14-may-2024	Goldman Sachs	USD	(3.214)	(431)	2783
232.000	Venta sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,88 Con vencimiento el 19-jun-2024	UBS	USD	2841	1290	(1.551)
(232.000)	Venta sobre divisas USD/CHF Precio de ejercicio 0,90 Con vencimiento el 27-jun-2024	UBS	USD	(2.945)	(3.317)	(372)
(242.000)	Venta sobre divisas USD/CLP Precio de ejercicio 953,50 Con vencimiento el 02-may-2024	Morgan Stanley	USD	(6.693)	(1.365)	5328
(1.725.000)	Venta sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 6,82 Con vencimiento el 05-mar-2025	J.P. Morgan	USD	(14.566)	(10.855)	3711
(1.704.000)	Venta sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 6,84 Con vencimiento el 18-feb-2025	BNP Paribas	USD	(16.495)	(10.757)	5738
348.000	Venta sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 7,18 Con vencimiento el 11-abr-2024	HSBC	USD	1023	128	(895)
349.000	Venta sobre divisas USD/CNH Precio de ejercicio 7,19 Con vencimiento el 04-abr-2024	Morgan Stanley	USD	1056	67	(989)
1.082.000	Venta sobre divisas USD/COP Precio de ejercicio 3.755,00 Con vencimiento el 09-jul-2024	Morgan Stanley	USD	17.487	6988	(10.499)
232.000	Venta sobre divisas USD/COP Precio de ejercicio 3.902,35 Con vencimiento el 27-jun-2024	Barclays Bank	USD	4816	4405	(411)
240.000	Venta sobre divisas USD/COP Precio de ejercicio 3.980,00 Con vencimiento el 14-may-2024	Bank of America	USD	6521	7076	555
(1.082.000)	Venta sobre divisas USD/COP Precio de ejercicio 4.055,00 Con vencimiento el 09-jul-2024	Morgan Stanley	USD	(49.580)	(48.210)	1370
(1.882.000)	Venta sobre divisas USD/CZK Precio de ejercicio 22,50 Con vencimiento el 16-abr-2024	Bank of America	USD	(17.879)	(90)	17.789
1.882.000	Venta sobre divisas USD/HUF Precio de ejercicio 353,80 Con vencimiento el 16-abr-2024	Citi Bank	USD	23.284	737	(22.547)
355.000	Venta sobre divisas USD/HUF Precio de ejercicio 364,36 Con vencimiento el 02-abr-2024	J.P. Morgan	USD	4027	929	(3.098)
351.000	Venta sobre divisas USD/HUF Precio de ejercicio 366,45 Con vencimiento el 11-abr-2024	Goldman Sachs	USD	3952	3012	(940)
(349.000)	Venta sobre divisas USD/ILS Precio de ejercicio 3,57 Con vencimiento el 02-abr-2024	Bank of America	USD	(4.125)	(12)	4113
1.876.000	Venta sobre divisas USD/INR Precio de ejercicio 82,38 Con vencimiento el 08-abr-2024	Bank of America	USD	8560	133	(8.427)
613.000	Venta sobre divisas USD/INR Precio de ejercicio 82,38 Con vencimiento el 09-may-2024	UBS	USD	2697	281	(2.416)
242.000	Venta sobre divisas USD/INR Precio de ejercicio 83,34 Con vencimiento el 02-may-2024	Morgan Stanley	USD	1419	575	(844)
2.043.000	Venta sobre divisas USD/INR Precio de ejercicio 83,49 Con vencimiento el 04-sep-2024	Goldman Sachs	USD	16.906	12.214	(4.692)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
244.000	Venta sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 143,15 Con vencimiento el 12-abr-2024	Bank of America	USD	4508	60	(4.448)
(241.000)	Venta sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 144,36 Con vencimiento el 02-may-2024	BNP Paribas	USD	(4.611)	(310)	4301
(233.000)	Venta sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 146,18 Con vencimiento el 14-jun-2024	Morgan Stanley	USD	(3.935)	(1.583)	2352
(347.000)	Venta sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 147,00 Con vencimiento el 11-abr-2024	Morgan Stanley	USD	(3.456)	(271)	3185
237.000	Venta sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 148,55 Con vencimiento el 24-may-2024	Morgan Stanley	USD	3596	1926	(1.670)
233.000	Venta sobre divisas USD/JPY Precio de ejercicio 150,50 Con vencimiento el 25-abr-2024	Bank of America	USD	2068	1755	(313)
(348.000)	Venta sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 16,83 Con vencimiento el 11-abr-2024	Bank of America	USD	(2.727)	(4.630)	(1.903)
233.000	Venta sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 16,94 Con vencimiento el 14-jun-2024	Morgan Stanley	USD	4052	4558	506
(352.000)	Venta sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 16,95 Con vencimiento el 04-abr-2024	Barclays Bank	USD	(2.934)	(6.778)	(3.844)
241.000	Venta sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 17,39 Con vencimiento el 02-may-2024	Morgan Stanley	USD	5140	10.278	5138
1.274.000	Venta sobre divisas USD/MXN Precio de ejercicio 17,87 Con vencimiento el 03-may-2024	Deutsche Bank	USD	41.317	88.866	47.549
(233.000)	Venta sobre divisas USD/SEK Precio de ejercicio 10,30 Con vencimiento el 14-jun-2024	Morgan Stanley	USD	(4.028)	(958)	3070
(241.000)	Venta sobre divisas USD/SEK Precio de ejercicio 10,39 Con vencimiento el 02-may-2024	HSBC	USD	(4.997)	(416)	4581
538.000	Venta sobre divisas USD/TRY Precio de ejercicio 33,29 Con vencimiento el 08-jul-2024	Bank of America	USD	8463	1623	(6.840)
(348.000)	Venta sobre divisas USD/ZAR Precio de ejercicio 18,63 Con vencimiento el 11-abr-2024	HSBC	USD	(4.382)	(800)	3582
23	Venta sobre International Business Machines Corp. Precio de ejercicio 180,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	7997	1093	(6.904)
23	Venta sobre Microsoft Corp. Precio de ejercicio 400,00 Con vencimiento el 26-abr-2024	Morgan Stanley	USD	7580	6095	(1.485)
5	Venta sobre el índice NASDAQ-100 Reduced Value Precio de ejercicio 3.600,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	31.657	28.000	(3.657)
(6)	Venta sobre NVIDIA Corp. Precio de ejercicio 720,00 Con vencimiento el 28-mar-2024	Morgan Stanley	USD	(2.875)	(6)	2869
10	Venta sobre NVIDIA Corp. Precio de ejercicio 825,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	51.845	24.050	(27.795)
6	Venta sobre NVIDIA Corp. Precio de ejercicio 830,00 Con vencimiento el 28-mar-2024	Morgan Stanley	USD	13.915	6	(13.909)
104	Venta sobre el índice Philadelphia Semiconductor Precio de ejercicio 4.530,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	7488	6206	(1.282)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de opciones (continuación)

Valor teórico sujeto a compra o venta	Contrato	Contraparte	Divisa	Prima pagada/ (recibida)	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
181	Venta sobre el índice Philadelphia Semiconductor Precio de ejercicio 4.635,00 Con vencimiento el 28-mar-2024	J.P. Morgan	USD	6832	-	(6.832)
22	Venta sobre Roku, Inc. Precio de ejercicio 59,00 Con vencimiento el 28-mar-2024	Morgan Stanley	USD	2160	22	(2.138)
3	Venta sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 5.000,00 Con vencimiento el 28-mar-2024	Morgan Stanley	USD	10.871	38	(10.833)
7	Venta sobre el índice S&P 500 Precio de ejercicio 5.125,00 Con vencimiento el 17-may-2024	Morgan Stanley	USD	31.866	26.950	(4.916)
(132)	Venta sobre el índice S&P Retail Select Industry Precio de ejercicio 7.284,00 Con vencimiento el 28-mar-2024	Morgan Stanley	USD	(3.070)	-	3070
132	Venta sobre el índice S&P Retail Select Industry Precio de ejercicio 7.812,00 Con vencimiento el 28-mar-2024	Morgan Stanley	USD	14.752	-	(14.752)
63	Venta sobre Shopify, Inc. Precio de ejercicio 69,00 Con vencimiento el 28-mar-2024	Morgan Stanley	USD	5614	63	(5.551)
4867	Venta sobre SoftBank Group Corp. Precio de ejercicio 7.668,90 Con vencimiento el 15-abr-2024	Goldman Sachs	JPY	8537	557	(7.980)
28	Venta sobre Tesla, Inc. Precio de ejercicio 150,00 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	10.481	4466	(6.015)
34	Venta sobre Trade Desk, Inc. Precio de ejercicio 77,00 Con vencimiento el 05-abr-2024	Morgan Stanley	USD	5027	102	(4.925)
153	Venta sobre Walmart, Inc. Precio de ejercicio 58,33 Con vencimiento el 19-abr-2024	Morgan Stanley	USD	4179	2601	(1.578)
85	Venta sobre Walt Disney Co. Precio de ejercicio 110,00 Con vencimiento el 05-abr-2024	Morgan Stanley	USD	5496	298	(5.198)
				USD	955.860	(357.547)

Swaptions

Las swaptions se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo. El valor de mercado se muestra en el Balance en el epígrafe «Opciones y swaptions a valor de mercado».

A 31 de marzo de 2024, los siguientes subfondos estaban comprometidos con swaptions pendientes sobre índices financieros y participaciones internacionales cotizadas:

Posición de protección	Descripción	Contraparte	Divisa	Prima	Cantidad nominal	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Compra	IRS «Paga tipo fijo al 7,69% Recibe tipo variable MXN TIIE Mar 2026», Venta 7,69%, 13-mar-2026	J.P. Morgan	MXN	384.124	157.510.000	312.142	(71.981)
Compra	IRS «Recibe tipo fijo al 6,80% Paga tipo variable MXN TIIE Feb 2030», Compra 6,80%, 04-feb-2030	J.P. Morgan	MXN	541.676	228.495.000	18.506	(523.170)
Compra	IRS «Recibe tipo fijo al 7,06% Paga tipo variable MXN TIIE Jun 2024», Compra 7,06%, 26-jun-2024	J.P. Morgan	MXN	195.967	188.310.000	576	(195.391)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Swaptions (continuación)

Posición de protección	Descripción	Contraparte	Divisa	Prima	Cantidad nominal	Valor de mercado	Plusvalía/(minusvalía) latente	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)								
Compra	IRS «Recibe tipo fijo al 7,29% Paga tipo variable MXN TIIIE Mar 2026», Compra, 7,29%, 05-mar-2026	J.P. Morgan	MXN	396.524	157.510.000	90.347	(306.177)	
Compra	IRS «Recibe tipo fijo al 7,96% Paga tipo variable MXN TIIIE Ene 2025», Compra 7,96%, 21-ene-2025	J.P. Morgan	MXN	101.038	91.350.000	58.484	(42.554)	
Compra	SWP «Recibe tipo fijo al 8,05% Paga tipo variable MXN TIIIE Jul 2023», Compra 8,05%, 06-abr-2028	J.P. Morgan	MXN	73.126	17.150.000	40.865	(32.261)	
Compra	SWP «Paga tipo fijo al 9,74% Recibe tipo variable MXN TIIIE Abr 2028», Venta 9,74%, 06-abr-2028	J.P. Morgan	MXN	76.455	17.150.000	43.017	(33.439)	
Venta	IRS «Recibe tipo fijo al 7,21% Paga tipo variable MXN TIIIE Ene 2025», Compra 7,21%, 21-ene-2025	J.P. Morgan	MXN	(30.522)	91.350.000	(15.727)	14.795	
						USD	548.210	(1.190.178)

Contratos de swaps de rentabilidad total

Los subfondos pueden emplear swaps de rentabilidad total. Un swap de rentabilidad total es un contrato financiero bilateral que les permite disfrutar de todos los beneficios de flujo de caja de un activo sin poseer realmente ese activo (el «Activo de referencia»). Los subfondos deberán pagar una comisión periódica (pago fijo o variable) a cambio de su derecho de recibir la rentabilidad total de los Activos de referencia (cupones, plusvalías y/o minusvalías). El Activo de referencia puede ser prácticamente cualquier activo que sea una inversión apta para los subfondos. Por su parte, los subfondos pueden emplear dichos instrumentos para ganar exposición en un mercado apto o para fines de cobertura.

Los swaps de rentabilidad total se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo. Las ganancias o las pérdidas latentes sobre los swaps de rentabilidad total al final del periodo están representados por el valor de los intereses por percibir (o pagar), sobre la base de los tipos de interés de los correspondientes acuerdos de swap, menos (o más, respectivamente) el valor del rendimiento por pagar (o percibir, respectivamente), sobre la base del valor de rentabilidad total de los activos subyacentes, que se calcula a partir del valor razonable actual de la renta variable más el dividendo distribuido por tal renta variable para el ejercicio del swap correspondiente. La plusvalía/(minusvalía) latente se muestra en el Balance en el epígrafe «Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos de swaps de rentabilidad total».

A 31 de marzo de 2024, los siguientes subfondos estaban comprometidos con contratos de swaps de rentabilidad total:

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/(minusvalía) latente
Schroder GAIA Egerton Equity						
Compra en largo	Industria aeroespacial y defensa	J.P. Morgan	GBP	5.346.026	21-ago-2024	5.352.641
Compra en largo	Industria aeroespacial y defensa	Morgan Stanley	EUR	11.118.468	28-feb-2025	6.226.173
Compra en largo	Líneas aéreas	J.P. Morgan	EUR	15.491.726	22-abr-2025	2.563.013
Compra en largo	Bancos	Merrill Lynch	EUR	5.997.203	30-abr-2025	619.246
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	GBP	7.176.922	28-feb-2025	82.630
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	Merrill Lynch	GBP	4.254.904	30-abr-2025	75.267
Compra en largo	Entretenimiento	Morgan Stanley	GBP	5.340.515	15-may-2025	899.636
Compra en largo	Constructores de viviendas	Goldman Sachs	GBP	7.774.644	07-ago-2024	(623.894)
Venta en corto	Industria aeroespacial y defensa	J.P. Morgan	USD	2.594.576	21-abr-2025	(106.952)
Venta en corto	Industria aeroespacial y defensa	Merrill Lynch	USD	1.300.175	31-dic-2024	49.244
Venta en corto	Ropa	J.P. Morgan	USD	2.188.355	18-oct-2024	185.440
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Goldman Sachs	USD	4.300.511	18-jul-2025	503.478
Venta en corto	Bioteología	Goldman Sachs	USD	863.572	28-abr-2026	(110.925)
Venta en corto	Bioteología	J.P. Morgan	USD	2.556.099	03-jun-2024	(46.951)
Venta en corto	Materiales de construcción	Goldman Sachs	CHF	1.226.007	20-ene-2027	(90.837)
Venta en corto	Materiales de construcción	Goldman Sachs	SEK	1.264.613	12-ago-2026	442.831
Venta en corto	Materiales de construcción	Morgan Stanley	USD	989.645	28-feb-2025	(273.329)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
Schroder GAIA Egerton Equity (continuación)							
Venta en corto	Productos químicos	J.P. Morgan	USD	1.416.186	30-dic-2024	131.184	
Venta en corto	Productos químicos	Morgan Stanley	USD	705.409	28-feb-2025	(35.871)	
Venta en corto	Servicios comerciales	Goldman Sachs	USD	1.038.047	24-jul-2024	334.991	
Venta en corto	Servicios comerciales	Morgan Stanley	EUR	695.947	28-feb-2025	(6.731)	
Venta en corto	Informática	Goldman Sachs	USD	1.665.035	13-ene-2027	109.535	
Venta en corto	Cosméticos y cuidado personal	J.P. Morgan	USD	1.223.802	17-mar-2025	(94.196)	
Venta en corto	Electrónica	Merrill Lynch	USD	1.118.669	29-nov-2024	(114.284)	
Venta en corto	Alimentos	Goldman Sachs	USD	2.131.689	13-ene-2027	120.524	
Venta en corto	Alimentos	Morgan Stanley	EUR	1.006.377	28-feb-2025	(85.843)	
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	SEK	1.369.479	28-abr-2026	33.897	
Venta en corto	Salud (productos)	J.P. Morgan	USD	887.523	21-abr-2025	(25.881)	
Venta en corto	Salud (productos)	J.P. Morgan	USD	713.043	22-abr-2025	(27.257)	
Venta en corto	Salud (servicios)	J.P. Morgan	USD	2.185.387	28-mar-2025	78.505	
Venta en corto	Mobiliario del hogar	Goldman Sachs	USD	294.905	02-dic-2026	(118.131)	
Venta en corto	Mobiliario del hogar	Morgan Stanley	JPY	1.395.287	28-feb-2025	106.352	
Venta en corto	Productos/artículos para el hogar	Merrill Lynch	USD	2.663.711	29-nov-2024	(337.256)	
Venta en corto	Utensilios del hogar	Morgan Stanley	USD	1.771.148	28-feb-2025	(494.155)	
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	1.547.054	28-feb-2025	(48.914)	
Venta en corto	Alojamiento	Goldman Sachs	USD	1.580.390	15-mar-2027	8909	
Venta en corto	Alojamiento	Morgan Stanley	USD	1.486.485	28-feb-2025	(40.836)	
Venta en corto	Maquinaria (diversificado)	Merrill Lynch	USD	1.169.986	31-dic-2024	(105.915)	
Venta en corto	Maquinaria (diversificado)	Merrill Lynch	USD	904.180	31-mar-2025	(98.017)	
Venta en corto	Embalaje y contenedores	Goldman Sachs	CHF	1.008.309	28-oct-2026	(52.003)	
Venta en corto	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	USD	1.806.867	07-abr-2025	164.707	
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	1.451.140	28-feb-2025	22.891	
Venta en corto	Sector inmobiliario	J.P. Morgan	USD	1.916.124	17-mar-2025	(242.783)	
Venta en corto	REIT	Morgan Stanley	USD	1.355.558	28-feb-2025	762.319	
Venta en corto	Ventas minoristas	Goldman Sachs	SEK	1.631.840	26-ene-2027	(191.940)	
Venta en corto	Ventas minoristas	Goldman Sachs	USD	2.382.607	09-dic-2026	(331.281)	
Venta en corto	Ventas minoristas	Goldman Sachs	USD	1.134.799	10-dic-2026	(224.288)	
Venta en corto	Ventas minoristas	J.P. Morgan	CAD	3.752.509	23-dic-2024	288.966	
Venta en corto	Ventas minoristas	Merrill Lynch	USD	1.697.757	30-abr-2025	43.631	
Venta en corto	Semiconductores	J.P. Morgan	USD	3.319.462	21-oct-2024	(331.051)	
Venta en corto	Semiconductores	Merrill Lynch	USD	924.304	30-abr-2025	(37.816)	
Venta en corto	Software	Merrill Lynch	USD	182.980	30-abr-2025	(178)	
Venta en corto	Varios*	Morgan Stanley	EUR	1.765.734	28-feb-2025	(58.711)	
Venta en corto	Varios*	Morgan Stanley	USD	29.448.018	28-feb-2025	(533.180)	
						EUR	14.316.604
Schroder GAIA Helix							
Venta en corto	Índice de renta variable	Barclays Bank	USD	39.020.247	09-sep-2024	(87.090)	
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	JPY	6.592.436	09-sep-2024	(169.378)	
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	USD	110.781.380	09-sep-2024	(2.412.839)	
Venta en corto	Índice de renta variable	J.P. Morgan	JPY	20.475.664	09-sep-2024	(403.560)	
Venta en corto	Índice de renta variable	J.P. Morgan	USD	177.357.567	09-sep-2024	(1.639.030)	
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	JPY	56.923.178	09-sep-2024	(1.514.562)	
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	20.033.005	09-sep-2024	12.096	
						USD	(6.214.363)
Schroder GAIA Sirios US Equity							
Compra en largo	Industria aeroespacial y defensa	Goldman Sachs	USD	1.930.303	12-jun-2025	194.120	

* El contrato se mantiene en una cesta de varios valores denominados en USD.

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Sirios US Equity (continuación)						
Compra en largo	Industria aeroespacial y defensa	Merrill Lynch	USD	5.547.140	24-may-2024	837.673
Compra en largo	Bebidas	Merrill Lynch	USD	2.263.867	24-dic-2024	(111.605)
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	Merrill Lynch	USD	10.507.783	24-may-2024	629.538
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	184.579	12-jun-2025	3441
Compra en largo	Capital riesgo	Merrill Lynch	USD	2.817.877	24-abr-2025	(21.654)
Compra en largo	Semiconductores	Merrill Lynch	USD	3.794.597	24-jul-2024	78.978
Venta en corto	Industria aeroespacial y defensa	Goldman Sachs	USD	743.061	09-abr-2025	23.376
Venta en corto	Industria aeroespacial y defensa	Merrill Lynch	USD	187.453	07-oct-2024	(9.506)
Venta en corto	Industria aeroespacial y defensa	Merrill Lynch	USD	618.753	10-feb-2025	19.133
Venta en corto	Líneas aéreas	Merrill Lynch	USD	673.426	15-oct-2024	(43.577)
Venta en corto	Ropa	Goldman Sachs	USD	951.949	30-abr-2025	(8.151)
Venta en corto	Bancos	Merrill Lynch	USD	805.521	24-may-2024	(54.691)
Venta en corto	Bancos	Merrill Lynch	USD	748.846	03-feb-2025	(36.436)
Venta en corto	Bancos	Merrill Lynch	USD	275.127	28-mar-2025	(13.999)
Venta en corto	Bebidas	Goldman Sachs	USD	69.439	05-feb-2025	(5.747)
Venta en corto	Bebidas	Merrill Lynch	USD	1.044.558	21-ene-2025	(41.904)
Venta en corto	Bebidas	Merrill Lynch	USD	198.143	24-feb-2025	5399
Venta en corto	Bebidas	Merrill Lynch	USD	73.505	07-abr-2025	(2.296)
Venta en corto	Servicios comerciales	Merrill Lynch	USD	1.655.212	24-may-2024	(55.647)
Venta en corto	Servicios comerciales	Merrill Lynch	USD	2.400.243	28-oct-2024	(17.121)
Venta en corto	Informática	Goldman Sachs	USD	871.681	12-sep-2024	(20.058)
Venta en corto	Informática	Merrill Lynch	USD	343.474	22-abr-2024	(791)
Venta en corto	Informática	Merrill Lynch	USD	464.520	29-abr-2024	(4.475)
Venta en corto	Informática	Merrill Lynch	USD	1.034.246	11-oct-2024	10.444
Venta en corto	Informática	Merrill Lynch	USD	723.151	18-nov-2024	49.143
Venta en corto	Informática	Merrill Lynch	USD	356.344	11-feb-2025	(6.328)
Venta en corto	Cosméticos y cuidado personal	Merrill Lynch	USD	110.392	24-abr-2025	(2.506)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	715.045	12-jun-2024	(77.557)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	740.589	12-mar-2025	10.981
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Merrill Lynch	USD	1.719.275	24-jun-2024	(183.688)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Merrill Lynch	USD	189.720	28-abr-2025	(5.082)
Venta en corto	Componentes y equipos eléctricos	Goldman Sachs	USD	94.584	23-abr-2025	(4.334)
Venta en corto	Electrónica	Goldman Sachs	USD	185.688	12-sep-2024	8606
Venta en corto	Electrónica	Merrill Lynch	USD	790.529	03-feb-2025	(90.207)
Venta en corto	Control medioambiental	Goldman Sachs	USD	790.859	12-jun-2025	(263.568)
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	USD	4.805.315	12-jun-2024	(126.129)
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	USD	1.712.758	12-dic-2024	(27.561)
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	USD	3.217.059	12-jun-2025	(230.434)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	11.346.829	29-may-2024	(218.754)
Venta en corto	Alimentos	Goldman Sachs	USD	89.006	05-feb-2025	(9.722)
Venta en corto	Alimentos	Merrill Lynch	USD	843.355	24-sep-2024	(176.130)
Venta en corto	Alimentos	Merrill Lynch	USD	1.136.984	21-ene-2025	(91.541)
Venta en corto	Herramientas manuales/ automáticas	Merrill Lynch	USD	688.719	14-may-2024	(62.792)
Venta en corto	Herramientas manuales/ automáticas	Merrill Lynch	USD	532.205	24-dic-2024	(66.931)
Venta en corto	Salud (productos)	Merrill Lynch	USD	591.653	10-abr-2024	(20.866)
Venta en corto	Salud (productos)	Merrill Lynch	USD	336.349	24-jun-2024	26.152
Venta en corto	Salud (productos)	Merrill Lynch	USD	442.226	24-jul-2024	32.187
Venta en corto	Salud (productos)	Merrill Lynch	USD	548.175	15-ene-2025	47.803
Venta en corto	Salud (productos)	Merrill Lynch	USD	497.974	26-mar-2025	17.468

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente	
Schroder GAIA Sirios US Equity (continuación)							
Venta en corto	Salud (servicios)	Goldman Sachs	USD	1.088.169	12-dic-2024	(118.439)	
Venta en corto	Internet	Goldman Sachs	USD	871.598	16-ene-2025	134.088	
Venta en corto	Internet	Merrill Lynch	USD	241.082	26-jul-2024	(9.570)	
Venta en corto	Internet	Merrill Lynch	USD	664.858	24-dic-2024	3646	
Venta en corto	Internet	Merrill Lynch	USD	319.729	03-feb-2025	(67.783)	
Venta en corto	Internet	Merrill Lynch	USD	915.749	28-feb-2025	(78.881)	
Venta en corto	Internet	Merrill Lynch	USD	188.581	28-abr-2025	(699)	
Venta en corto	Tiempo libre	Merrill Lynch	USD	817.330	12-nov-2024	(80.546)	
Venta en corto	Alojamiento	Merrill Lynch	USD	56.576	22-ene-2025	553	
Venta en corto	Maquinaria (diversificado)	Goldman Sachs	USD	1.052.789	12-dic-2024	51.731	
Venta en corto	Medios de comunicación	Goldman Sachs	USD	637.415	09-abr-2025	(62.406)	
Venta en corto	Medios de comunicación	Merrill Lynch	USD	513.494	14-may-2024	(14.118)	
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Merrill Lynch	USD	145.144	24-sep-2024	(10.659)	
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Merrill Lynch	USD	183.549	28-ene-2025	(35.597)	
Venta en corto	REIT	Merrill Lynch	USD	718.634	24-dic-2024	(22.103)	
Venta en corto	REIT	Merrill Lynch	USD	735.210	24-abr-2025	(89.460)	
Venta en corto	Ventas minoristas	Goldman Sachs	USD	73.797	09-abr-2025	(2.610)	
Venta en corto	Ventas minoristas	Merrill Lynch	USD	248.033	18-sep-2024	5050	
Venta en corto	Semiconductores	Goldman Sachs	USD	265.511	12-sep-2024	(21.452)	
Venta en corto	Semiconductores	Merrill Lynch	USD	96.785	01-jul-2024	(1.580)	
Venta en corto	Semiconductores	Merrill Lynch	USD	744.057	18-sep-2024	32.443	
Venta en corto	Semiconductores	Merrill Lynch	USD	810.398	12-nov-2024	(46.029)	
Venta en corto	Semiconductores	Merrill Lynch	USD	663.775	10-feb-2025	33.966	
Venta en corto	Semiconductores	Merrill Lynch	USD	857.009	14-abr-2025	(34.390)	
Venta en corto	Software	Merrill Lynch	USD	368.490	24-may-2024	(2.974)	
Venta en corto	Software	Merrill Lynch	USD	638.110	18-oct-2024	(50.253)	
Venta en corto	Software	Merrill Lynch	USD	184.128	07-mar-2025	(23.641)	
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	692.225	16-may-2024	(5.057)	
Venta en corto	Telecomunicaciones	Goldman Sachs	USD	255.107	12-dic-2024	33.324	
Venta en corto	Telecomunicaciones	Merrill Lynch	USD	743.686	02-dic-2024	40.311	
Venta en corto	Transporte	Merrill Lynch	USD	562.977	05-nov-2024	(10.712)	
Venta en corto	Transporte	Morgan Stanley	USD	756.259	16-may-2024	(255)	
						USD	(571.448)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Compra en largo	Varios*	Morgan Stanley	USD	330.780.411	18-oct-2024	4.972.679	
						USD	4.972.679
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Compra en largo	Publicidad	Goldman Sachs	USD	115.393	18-jul-2025	(632)	
Compra en largo	Publicidad	Morgan Stanley	USD	83.987	19-may-2025	623	
Compra en largo	Publicidad	Morgan Stanley	USD	240.059	18-may-2033	11.614	
Compra en largo	Industria aeroespacial y defensa	J.P. Morgan	EUR	104.210	05-may-2028	5649	
Compra en largo	Agricultura	Goldman Sachs	GBP	39.059	24-may-2033	491	
Compra en largo	Ropa	Morgan Stanley	USD	132.699	18-may-2033	2709	
Compra en largo	Ropa	Morgan Stanley	USD	290.967	18-may-2033	16.344	
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	EUR	261.707	24-may-2033	12.191	
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	EUR	125.553	24-may-2033	1884	
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	EUR	222.806	24-may-2033	6601	
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	USD	2.035.353	24-may-2033	41.157	

* El contrato se mantiene en una cesta de varios valores denominados en USD.

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	USD	1.142.240	24-may-2033	35.136
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	USD	84.302	24-may-2033	4360
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	USD	1.706.428	24-may-2033	21.254
Compra en largo	Bancos	Goldman Sachs	USD	1.449.379	24-may-2033	83.068
Compra en largo	Bancos	J.P. Morgan	EUR	135.069	05-may-2028	3759
Compra en largo	Bancos	J.P. Morgan	EUR	343.653	05-may-2028	29.260
Compra en largo	Bancos	J.P. Morgan	EUR	102.449	05-may-2028	11.736
Compra en largo	Bancos	J.P. Morgan	EUR	169.847	05-may-2028	12.602
Compra en largo	Bancos	J.P. Morgan	GBP	108	05-may-2028	9
Compra en largo	Bancos	J.P. Morgan	JPY	223.656	08-may-2028	12.096
Compra en largo	Bancos	J.P. Morgan	JPY	219.117	08-may-2028	16.774
Compra en largo	Bancos	J.P. Morgan	JPY	284.238	08-may-2028	15.646
Compra en largo	Bancos	J.P. Morgan	USD	1.448.986	05-may-2028	81.773
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	EUR	139.485	18-may-2033	761
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	EUR	148.568	18-may-2033	8171
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	EUR	147.814	18-may-2033	9889
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	EUR	2265	18-may-2033	7
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	JPY	330.091	18-may-2033	(2.001)
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	JPY	255.089	18-may-2033	2127
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	JPY	606.888	18-may-2033	17.349
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	USD	61.848	18-may-2033	3250
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	USD	752.963	18-may-2033	73.584
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	USD	616.001	18-may-2033	56.413
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	USD	3.397.806	18-may-2033	26.587
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	USD	146.864	18-may-2033	12.169
Compra en largo	Bancos	Morgan Stanley	USD	133.770	18-may-2033	3687
Compra en largo	Biotecnología	Goldman Sachs	DKK	84.549	24-may-2033	3135
Compra en largo	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	104.626	08-feb-2029	3532
Compra en largo	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	101.816	15-mar-2029	3404
Compra en largo	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	69.835	24-may-2033	(2.068)
Compra en largo	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	127.218	24-may-2033	(1.811)
Compra en largo	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	1392	24-may-2033	(26)
Compra en largo	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	16.208	24-may-2033	413
Compra en largo	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	197.923	24-may-2033	7060
Compra en largo	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	12.174	24-may-2033	(206)
Compra en largo	Biotecnología	J.P. Morgan	USD	213.462	05-may-2028	(197)
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	DKK	172.246	18-may-2033	3255
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	238.344	18-may-2033	17.895
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	366.106	18-may-2033	9267
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	16.753	18-may-2033	(15)
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	159.296	18-may-2033	4163
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	286.830	18-may-2033	14.942
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	75.306	18-may-2033	3783
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	77.161	18-may-2033	2014
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	249.161	18-may-2033	(237)
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	94.369	18-may-2033	6186
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	98.528	18-may-2033	(923)
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	54.618	18-may-2033	(3.364)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	6771	18-may-2033	473
Compra en largo	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	54.554	18-may-2033	(1.129)
Compra en largo	Servicios comerciales	Goldman Sachs	EUR	97.749	24-may-2033	8024
Compra en largo	Servicios comerciales	Goldman Sachs	USD	254.188	24-may-2033	1901
Compra en largo	Servicios comerciales	Goldman Sachs	USD	42.115	24-may-2033	1613
Compra en largo	Servicios comerciales	Goldman Sachs	USD	309.298	24-may-2033	(421)
Compra en largo	Servicios comerciales	J.P. Morgan	USD	175.836	05-may-2028	18.620
Compra en largo	Servicios comerciales	J.P. Morgan	USD	4767	05-may-2028	179
Compra en largo	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	472.335	18-may-2033	13.653
Compra en largo	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	383.052	18-may-2033	21.071
Compra en largo	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	1.645.577	18-may-2033	10.275
Compra en largo	Informática	Goldman Sachs	USD	137.518	24-may-2033	(3.255)
Compra en largo	Informática	J.P. Morgan	USD	20.636	05-may-2028	(1.373)
Compra en largo	Informática	Morgan Stanley	USD	19.403	18-may-2033	(140)
Compra en largo	Cosméticos y cuidado personal	Morgan Stanley	USD	70.776	18-may-2033	(1.186)
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	496.616	24-may-2033	(479)
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	399.288	24-may-2033	914
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	74.093	24-may-2033	(289)
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	209.880	24-may-2033	4560
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	EUR	6758	05-may-2028	1048
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	USD	99.870	05-may-2028	7350
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	EUR	192.344	18-may-2033	14.384
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	USD	128.676	18-may-2033	4368
Compra en largo	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	USD	499.174	18-may-2033	(96)
Compra en largo	Eléctrico	J.P. Morgan	USD	141.512	05-may-2028	2842
Compra en largo	Electrónica	Goldman Sachs	USD	10.383	24-may-2033	575
Compra en largo	Electrónica	Morgan Stanley	USD	156.491	18-may-2033	(5.575)
Compra en largo	Fuentes alternativas de energía	Goldman Sachs	USD	86.867	24-may-2033	5562
Compra en largo	Fuentes alternativas de energía	J.P. Morgan	USD	76.226	05-may-2028	3500
Compra en largo	Entretenimiento	Goldman Sachs	GBP	361.926	13-nov-2028	11.479
Compra en largo	Entretenimiento	J.P. Morgan	GBP	174.120	05-may-2028	3413
Compra en largo	Entretenimiento	J.P. Morgan	USD	19.177	16-may-2033	1475
Compra en largo	Entretenimiento	Morgan Stanley	USD	447.024	18-may-2033	14.836
Compra en largo	Entretenimiento	Morgan Stanley	USD	103.666	18-may-2033	1998
Compra en largo	Entretenimiento	Morgan Stanley	USD	289.680	18-may-2033	17.246
Compra en largo	Entretenimiento	Morgan Stanley	USD	382.965	18-may-2033	44.681
Compra en largo	Entretenimiento	Morgan Stanley	USD	520.084	18-may-2033	38.989
Compra en largo	Entretenimiento	Morgan Stanley	USD	106.466	18-may-2033	8591
Compra en largo	Entretenimiento	Morgan Stanley	USD	361.429	18-may-2033	3920
Compra en largo	Índice de renta variable	Goldman Sachs	USD	273.167	24-may-2033	(1.359)
Compra en largo	Índice de renta variable	Morgan Stanley	EUR	549.246	18-may-2033	8380
Compra en largo	Índice de renta variable	Morgan Stanley	EUR	540.793	18-may-2033	11.657
Compra en largo	Índice de renta variable	Morgan Stanley	EUR	900.932	18-may-2033	1523
Compra en largo	Índice de renta variable	Morgan Stanley	GBP	524.163	18-may-2033	4788
Compra en largo	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	705.890	18-may-2033	1985
Compra en largo	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	459.704	18-may-2033	(6.988)
Compra en largo	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	947.630	18-may-2033	35.602
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	141.375	24-may-2033	5501

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	208.224	24-may-2033	5640
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	57.647	24-may-2033	5888
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	403.715	24-may-2033	807
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	17.276	24-may-2033	(28)
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	5183	24-may-2033	130
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	28.251	24-may-2033	2464
Compra en largo	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	86.766	25-may-2033	(5.193)
Compra en largo	Salud (productos)	J.P. Morgan	USD	102.292	22-abr-2025	4661
Compra en largo	Salud (productos)	J.P. Morgan	USD	930.707	05-may-2028	20.414
Compra en largo	Salud (productos)	J.P. Morgan	USD	87.258	05-may-2028	4969
Compra en largo	Salud (productos)	J.P. Morgan	USD	301.646	05-may-2028	4691
Compra en largo	Salud (productos)	Morgan Stanley	USD	238.177	18-may-2033	306
Compra en largo	Salud (productos)	Morgan Stanley	USD	79.252	18-may-2033	1269
Compra en largo	Salud (productos)	Morgan Stanley	USD	339.216	18-may-2033	2405
Compra en largo	Salud (productos)	Morgan Stanley	USD	441.983	18-may-2033	14.231
Compra en largo	Salud (productos)	Morgan Stanley	USD	557.163	18-may-2033	9433
Compra en largo	Salud (servicios)	Goldman Sachs	USD	208.466	24-may-2033	(2.640)
Compra en largo	Salud (servicios)	Goldman Sachs	USD	187.674	24-may-2033	(792)
Compra en largo	Salud (servicios)	Goldman Sachs	USD	28.940	24-may-2033	411
Compra en largo	Salud (servicios)	Goldman Sachs	USD	22.678	24-may-2033	470
Compra en largo	Salud (servicios)	Goldman Sachs	USD	23.316	24-may-2033	1383
Compra en largo	Salud (servicios)	Goldman Sachs	USD	26.528	24-may-2033	2045
Compra en largo	Salud (servicios)	J.P. Morgan	USD	53.729	05-may-2028	1399
Compra en largo	Salud (servicios)	J.P. Morgan	USD	398.148	05-may-2028	4255
Compra en largo	Salud (servicios)	J.P. Morgan	USD	301.606	05-may-2028	414
Compra en largo	Salud (servicios)	J.P. Morgan	USD	229.786	05-may-2028	23.900
Compra en largo	Salud (servicios)	Morgan Stanley	USD	55.923	18-may-2033	2230
Compra en largo	Salud (servicios)	Morgan Stanley	USD	119.451	18-may-2033	4289
Compra en largo	Salud (servicios)	Morgan Stanley	USD	102.161	18-may-2033	(3.407)
Compra en largo	Salud (servicios)	Morgan Stanley	USD	6985	18-may-2033	1024
Compra en largo	Salud (servicios)	Morgan Stanley	USD	89.401	18-may-2033	9365
Compra en largo	Constructores de viviendas	Morgan Stanley	USD	259.887	18-may-2033	28.886
Compra en largo	Mobiliario del hogar	J.P. Morgan	JPY	23.406	08-may-2028	(36)
Compra en largo	Mobiliario del hogar	Morgan Stanley	JPY	144.950	18-may-2033	(5.701)
Compra en largo	Seguros	Goldman Sachs	DKK	73.132	24-may-2033	198
Compra en largo	Seguros	Goldman Sachs	EUR	109.025	24-may-2033	2645
Compra en largo	Seguros	J.P. Morgan	EUR	1.325.705	05-may-2028	100.855
Compra en largo	Seguros	J.P. Morgan	EUR	155.222	05-may-2028	14.665
Compra en largo	Seguros	J.P. Morgan	GBP	13.854	05-may-2028	1380
Compra en largo	Seguros	J.P. Morgan	GBP	332.538	05-may-2028	4514
Compra en largo	Seguros	J.P. Morgan	JPY	122.013	08-may-2028	(2.966)
Compra en largo	Seguros	Morgan Stanley	DKK	125.617	18-may-2033	254
Compra en largo	Seguros	Morgan Stanley	GBP	66.569	18-may-2033	1942
Compra en largo	Seguros	Morgan Stanley	NOK	379.979	19-may-2033	7526
Compra en largo	Internet	Goldman Sachs	EUR	412.815	24-may-2033	(5.129)
Compra en largo	Internet	Goldman Sachs	HKD	178.937	08-abr-2024	(2.510)
Compra en largo	Internet	Goldman Sachs	HKD	64.613	08-abr-2024	3354
Compra en largo	Internet	Goldman Sachs	USD	479.738	24-may-2033	(18.923)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Compra en largo	Internet	Goldman Sachs	USD	46.390	24-may-2033	345
Compra en largo	Internet	J.P. Morgan	EUR	17.255	20-may-2033	496
Compra en largo	Internet	J.P. Morgan	GBP	45.937	05-may-2028	671
Compra en largo	Internet	J.P. Morgan	HKD	91.471	22-jul-2025	722
Compra en largo	Internet	J.P. Morgan	USD	323.628	05-may-2028	(2.792)
Compra en largo	Internet	J.P. Morgan	USD	204.967	05-may-2028	825
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	HKD	88.679	18-may-2033	(2.033)
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	PLN	194.396	18-may-2033	6147
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	108.827	28-feb-2025	(4.701)
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	203.354	28-feb-2025	7548
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	1.512.570	24-jun-2025	51.685
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	360.691	18-may-2033	(8.439)
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	448.353	18-may-2033	3723
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	156.160	18-may-2033	5008
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	735.832	18-may-2033	2250
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	272.602	18-may-2033	9507
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	397.254	18-may-2033	5577
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	380.426	18-may-2033	4601
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	452.046	18-may-2033	53.923
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	435.254	18-may-2033	23.905
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	95.765	18-may-2033	3986
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	214.019	18-may-2033	(2.025)
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	381.547	18-may-2033	43.382
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	55.394	18-may-2033	14
Compra en largo	Internet	Morgan Stanley	USD	45.460	18-may-2033	3140
Compra en largo	Tiempo libre	Morgan Stanley	USD	453.283	18-may-2033	35.476
Compra en largo	Alojamiento	J.P. Morgan	HKD	35.613	05-may-2028	3172
Compra en largo	Alojamiento	J.P. Morgan	USD	74.594	05-may-2028	3477
Compra en largo	Alojamiento	Morgan Stanley	USD	545.554	28-feb-2025	(10.453)
Compra en largo	Alojamiento	Morgan Stanley	USD	653.399	18-may-2033	20.705
Compra en largo	Alojamiento	Morgan Stanley	USD	262.349	18-may-2033	10.282
Compra en largo	Alojamiento	Morgan Stanley	USD	442.884	18-may-2033	18.719
Compra en largo	Medios de comunicación	J.P. Morgan	USD	38.364	15-may-2033	3973
Compra en largo	Medios de comunicación	J.P. Morgan	USD	171.110	15-may-2033	9005
Compra en largo	Medios de comunicación	Morgan Stanley	USD	744.356	18-may-2033	69.216
Compra en largo	Medios de comunicación	Morgan Stanley	USD	67.959	18-may-2033	1785
Compra en largo	Medios de comunicación	Morgan Stanley	USD	34.278	18-may-2033	1995
Compra en largo	Medios de comunicación	Morgan Stanley	USD	138.831	18-may-2033	3997
Compra en largo	Medios de comunicación	Morgan Stanley	USD	59.365	18-may-2033	(3.015)
Compra en largo	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	444.103	05-may-2028	(10.755)
Compra en largo	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	1.507.421	05-may-2028	114.665
Compra en largo	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	353.405	05-may-2028	25.188
Compra en largo	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	172.415	05-may-2028	540
Compra en largo	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	78.243	18-may-2033	2121
Compra en largo	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	445.789	18-may-2033	19.316
Compra en largo	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	492.913	18-may-2033	36.181
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	CHF	84.992	24-may-2033	2250
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	EUR	196.891	24-may-2033	12.263
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	GBP	309.199	05-abr-2024	11.561

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	JPY	199.608	12-sep-2028	(5.308)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	JPY	496.178	12-sep-2028	(11.630)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	USD	57.966	24-may-2033	(603)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	USD	98.569	24-may-2033	609
Compra en largo	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	CHF	144.166	05-may-2028	(4.935)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	USD	277.778	05-may-2028	17.787
Compra en largo	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	USD	362.680	05-may-2028	(15.939)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	DKK	538.792	18-may-2033	(3.887)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	EUR	10.228	18-may-2033	971
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	JPY	4356	18-may-2033	(52)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	JPY	14.467	18-may-2033	(53)
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	389.906	18-may-2033	12.299
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	370.209	18-may-2033	7397
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	627.904	18-may-2033	39.659
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	178.693	18-may-2033	3362
Compra en largo	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	235.218	18-may-2033	(9.900)
Compra en largo	Tuberías	J.P. Morgan	USD	264.411	05-may-2028	9736
Compra en largo	Tuberías	J.P. Morgan	USD	293.266	05-may-2028	13.863
Compra en largo	Tuberías	J.P. Morgan	USD	442.720	05-may-2028	17.266
Compra en largo	Tuberías	J.P. Morgan	USD	158.433	05-may-2028	5630
Compra en largo	Tuberías	Morgan Stanley	USD	68.736	18-may-2033	1296
Compra en largo	Tuberías	Morgan Stanley	USD	135.895	18-may-2033	7642
Compra en largo	Tuberías	Morgan Stanley	USD	171.989	18-may-2033	9770
Compra en largo	Capital riesgo	J.P. Morgan	GBP	264.855	05-may-2028	13.352
Compra en largo	Capital riesgo	J.P. Morgan	USD	67.337	05-may-2028	2767
Compra en largo	Capital riesgo	Morgan Stanley	USD	236.432	18-may-2033	9487
Compra en largo	Sector inmobiliario	Goldman Sachs	SEK	124.633	24-may-2033	7192
Compra en largo	Sector inmobiliario	Morgan Stanley	USD	232.786	18-may-2033	(4.978)
Compra en largo	REIT	Goldman Sachs	USD	194.241	24-may-2033	2954
Compra en largo	REIT	Goldman Sachs	USD	127.714	24-may-2033	5061
Compra en largo	REIT	J.P. Morgan	USD	57.459	05-may-2028	(2.956)
Compra en largo	REIT	J.P. Morgan	USD	352.882	05-may-2028	(9.629)
Compra en largo	REIT	Morgan Stanley	USD	355.387	18-may-2033	202
Compra en largo	REIT	Morgan Stanley	USD	66.583	18-may-2033	377
Compra en largo	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	215.398	18-may-2033	(958)
Compra en largo	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	123.658	18-may-2033	9781
Compra en largo	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	652.031	18-may-2033	26.768
Compra en largo	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	456.548	18-may-2033	5159
Compra en largo	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	1.417.925	18-may-2033	(12.654)
Compra en largo	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	389.039	18-may-2033	42.749
Compra en largo	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	317.241	18-may-2033	14.131
Compra en largo	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	193.663	18-may-2033	(12.792)
Compra en largo	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	641.008	18-may-2033	41.630
Compra en largo	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	40.398	18-may-2033	301
Compra en largo	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	206.483	18-may-2033	11.913
Compra en largo	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	321.305	18-may-2033	13.218
Compra en largo	Semiconductores	Goldman Sachs	EUR	165.858	24-may-2033	43.659
Compra en largo	Semiconductores	J.P. Morgan	USD	20.650	05-may-2028	(465)
Compra en largo	Semiconductores	J.P. Morgan	USD	102.962	15-may-2033	4396

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Compra en largo	Semiconductores	Morgan Stanley	USD	468.881	27-ene-2026	4315
Compra en largo	Semiconductores	Morgan Stanley	USD	45.040	18-may-2033	11.901
Compra en largo	Semiconductores	Morgan Stanley	USD	81.726	18-may-2033	987
Compra en largo	Semiconductores	Morgan Stanley	USD	32.496	18-may-2033	3192
Compra en largo	Semiconductores	Morgan Stanley	USD	58.293	18-may-2033	1876
Compra en largo	Semiconductores	Morgan Stanley	USD	146.044	18-may-2033	(249)
Compra en largo	Software	Goldman Sachs	EUR	48.794	24-may-2033	1446
Compra en largo	Software	Goldman Sachs	USD	138.242	08-ene-2029	(166)
Compra en largo	Software	Goldman Sachs	USD	58.682	24-may-2033	(622)
Compra en largo	Software	Goldman Sachs	USD	55.264	24-may-2033	(372)
Compra en largo	Software	Goldman Sachs	USD	216.637	24-may-2033	281
Compra en largo	Software	J.P. Morgan	USD	28.993	05-may-2028	153
Compra en largo	Software	J.P. Morgan	USD	54.331	05-may-2028	(7.035)
Compra en largo	Software	J.P. Morgan	USD	73.455	16-may-2033	(1.946)
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	353.887	18-may-2033	7835
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	153.697	18-may-2033	6613
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	173.612	18-may-2033	(1.273)
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	466.807	18-may-2033	10.864
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	55.384	18-may-2033	572
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	94.055	18-may-2033	3671
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	195.648	18-may-2033	4863
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	53.386	18-may-2033	892
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	113.285	18-may-2033	1480
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	23.451	18-may-2033	(195)
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	100.912	18-may-2033	2665
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	40.271	18-may-2033	2519
Compra en largo	Software	Morgan Stanley	USD	48.060	18-may-2033	905
Compra en largo	Telecomunicaciones	Goldman Sachs	USD	181.829	24-may-2033	2248
Compra en largo	Telecomunicaciones	J.P. Morgan	USD	25.230	05-may-2028	466
Compra en largo	Telecomunicaciones	Morgan Stanley	CAD	28.735	18-may-2033	(1.071)
Compra en largo	Telecomunicaciones	Morgan Stanley	SGD	130.358	18-may-2033	432
Compra en largo	Telecomunicaciones	Morgan Stanley	USD	382.875	18-may-2033	12.351
Compra en largo	Telecomunicaciones	Morgan Stanley	USD	436.514	18-may-2033	(12.764)
Compra en largo	Varios*	Morgan Stanley	USD	13.416.009	25-may-2033	48.263
Compra en largo	Varios*	Morgan Stanley	USD	34.210	25-may-2033	13
Venta en corto	Publicidad	J.P. Morgan	USD	79.662	15-may-2033	(1.064)
Venta en corto	Publicidad	Morgan Stanley	USD	174.258	19-may-2025	(1.291)
Venta en corto	Publicidad	Morgan Stanley	USD	64.291	19-may-2025	(8.967)
Venta en corto	Publicidad	Morgan Stanley	USD	258.236	18-may-2033	(12.596)
Venta en corto	Agricultura	Morgan Stanley	USD	169.093	18-may-2033	(7.784)
Venta en corto	Ropa	Goldman Sachs	EUR	27.303	24-may-2033	640
Venta en corto	Ropa	J.P. Morgan	EUR	128.272	05-may-2028	15.111
Venta en corto	Ropa	Morgan Stanley	USD	252.924	18-may-2033	(8.746)
Venta en corto	Ropa	Morgan Stanley	USD	532.958	18-may-2033	23.868
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Goldman Sachs	USD	54.806	18-jul-2025	(41)
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	J.P. Morgan	HKD	112.026	05-may-2028	17.429
Venta en corto	Fabricantes de automóviles	Morgan Stanley	USD	817.850	18-may-2033	(61.100)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	CAD	1.048.641	25-may-2033	(21.264)

* El contrato se mantiene en una cesta de varios valores estadounidenses.

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	CHF	128.090	24-may-2033	243
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	EUR	172.885	24-may-2033	(7.191)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	EUR	106.193	24-may-2033	(4.473)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	GBP	359.034	24-may-2033	(1.070)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	ILS	147.689	25-may-2033	(2.554)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	JPY	123.940	24-may-2033	2799
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	PLN	435.315	24-may-2033	(24.133)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	SEK	129.307	24-may-2033	(87)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	SEK	409.260	24-may-2033	45.957
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	USD	1.079.080	24-may-2033	(17.685)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	USD	2.152.725	24-may-2033	(109.029)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	USD	1.063.468	24-may-2033	(68.316)
Venta en corto	Bancos	Goldman Sachs	USD	1.160.171	24-may-2033	(30.373)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	DKK	126.038	05-may-2028	(5.353)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	EUR	792.146	05-may-2028	(64.428)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	EUR	141.489	05-may-2028	(12.351)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	EUR	1.020.084	05-may-2028	(100.408)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	EUR	816.443	05-may-2028	(25.693)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	EUR	128.206	05-may-2028	(10.481)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	GBP	310.862	05-may-2028	(19.348)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	NOK	102.869	05-may-2028	(792)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	SEK	1.742.736	22-may-2024	169.767
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	SEK	552.531	05-may-2028	28.271
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	SEK	323.643	05-may-2028	23.583
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	USD	476.137	05-may-2028	(34.039)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	USD	109.666	05-may-2028	(1.220)
Venta en corto	Bancos	J.P. Morgan	USD	796.477	05-may-2028	(32.692)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	CAD	2.269.204	18-may-2033	(84.791)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	CHF	260.867	18-may-2033	(1.476)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	DKK	147.477	18-may-2033	(2.604)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	EUR	139.504	18-may-2033	(8.453)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	EUR	163.719	18-may-2033	288
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	JPY	1.151.416	18-may-2033	(22.997)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	JPY	118.858	18-may-2033	1371
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	JPY	134.396	18-may-2033	551
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	JPY	382.421	18-may-2033	12.165
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	NOK	490.250	19-may-2033	(16.412)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	SEK	95.443	18-may-2033	5943
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	SEK	146.515	18-may-2033	10.059
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	SEK	394.360	18-may-2033	38.618
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	USD	2.411.227	18-may-2033	(134.793)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	USD	560.454	18-may-2033	(48.293)
Venta en corto	Bancos	Morgan Stanley	USD	505.687	18-may-2033	(29.834)
Venta en corto	Bebidas	Goldman Sachs	USD	140.066	24-may-2033	(2.567)
Venta en corto	Bebidas	Morgan Stanley	USD	253.906	18-may-2033	(15.960)
Venta en corto	Bebidas	Morgan Stanley	USD	174.519	18-may-2033	3378
Venta en corto	Bioteología	Goldman Sachs	USD	161.889	15-mar-2029	(2.017)
Venta en corto	Bioteología	Goldman Sachs	USD	100.356	24-may-2033	(3.055)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Venta en corto	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	185.727	24-may-2033	4050
Venta en corto	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	54.811	24-may-2033	(785)
Venta en corto	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	2019	24-may-2033	(15)
Venta en corto	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	27.027	24-may-2033	737
Venta en corto	Biotecnología	Goldman Sachs	USD	84.900	24-may-2033	(9.960)
Venta en corto	Biotecnología	J.P. Morgan	USD	175.505	05-may-2028	27.803
Venta en corto	Biotecnología	J.P. Morgan	USD	52.377	05-may-2028	(279)
Venta en corto	Biotecnología	J.P. Morgan	USD	10.328	05-may-2028	325
Venta en corto	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	207.110	18-may-2033	(7.676)
Venta en corto	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	112.930	18-may-2033	(2.859)
Venta en corto	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	96.144	18-may-2033	424
Venta en corto	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	60.299	18-may-2033	318
Venta en corto	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	94.669	18-may-2033	3936
Venta en corto	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	61.272	18-may-2033	(7.728)
Venta en corto	Biotecnología	Morgan Stanley	USD	144.088	18-may-2033	5433
Venta en corto	Materiales de construcción	Morgan Stanley	USD	179.077	18-may-2033	(10.149)
Venta en corto	Carbón	J.P. Morgan	USD	44.135	05-may-2028	(2.562)
Venta en corto	Carbón	J.P. Morgan	USD	79.132	05-may-2028	5926
Venta en corto	Carbón	Morgan Stanley	USD	1134	18-may-2033	(39)
Venta en corto	Servicios comerciales	Goldman Sachs	USD	961	28-may-2025	7
Venta en corto	Servicios comerciales	Goldman Sachs	USD	613.289	09-sep-2025	(7.188)
Venta en corto	Servicios comerciales	Goldman Sachs	USD	726.571	24-may-2033	(5.251)
Venta en corto	Servicios comerciales	Goldman Sachs	USD	235.839	24-may-2033	(2.522)
Venta en corto	Servicios comerciales	Goldman Sachs	USD	149.575	24-may-2033	1782
Venta en corto	Servicios comerciales	J.P. Morgan	USD	67.486	05-may-2028	(378)
Venta en corto	Servicios comerciales	J.P. Morgan	USD	198.518	05-may-2028	(5.465)
Venta en corto	Servicios comerciales	J.P. Morgan	USD	392.338	05-may-2028	(10.279)
Venta en corto	Servicios comerciales	J.P. Morgan	USD	62.964	05-may-2028	(2.372)
Venta en corto	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	206.239	19-may-2025	(11.789)
Venta en corto	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	452.466	18-may-2033	(14.298)
Venta en corto	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	317.316	18-may-2033	(7.327)
Venta en corto	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	215.233	18-may-2033	(2.605)
Venta en corto	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	25.559	18-may-2033	(94)
Venta en corto	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	201.971	18-may-2033	(6.773)
Venta en corto	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	278.603	18-may-2033	47.019
Venta en corto	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	150.195	18-may-2033	4635
Venta en corto	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	101.093	18-may-2033	(340)
Venta en corto	Servicios comerciales	Morgan Stanley	USD	299.109	18-may-2033	(17.400)
Venta en corto	Informática	Goldman Sachs	USD	101.663	13-ene-2027	4091
Venta en corto	Informática	J.P. Morgan	USD	33.756	20-feb-2026	(262)
Venta en corto	Informática	Morgan Stanley	USD	200.241	18-may-2033	115
Venta en corto	Informática	Morgan Stanley	USD	932.148	18-may-2033	6156
Venta en corto	Informática	Morgan Stanley	USD	372.823	18-may-2033	17.201
Venta en corto	Informática	Morgan Stanley	USD	289.566	18-may-2033	(6.763)
Venta en corto	Cosméticos y cuidado personal	Goldman Sachs	EUR	49.807	24-may-2033	(215)
Venta en corto	Cosméticos y cuidado personal	J.P. Morgan	EUR	78.413	05-may-2028	(53)
Venta en corto	Cosméticos y cuidado personal	Morgan Stanley	EUR	67.506	18-may-2033	1125
Venta en corto	Distribución/venta mayorista	Morgan Stanley	USD	171.753	18-may-2033	(21.351)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	EUR	35.393	24-may-2033	(1.813)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	GBP	57.998	12-mar-2025	(307)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	GBP	118.635	24-may-2033	(6.079)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	GBP	48.689	24-may-2033	460
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	268.608	18-jul-2025	(5.308)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	377.057	24-may-2033	(17.578)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	930.742	24-may-2033	(7.276)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	487.951	24-may-2033	(24.598)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	637.073	24-may-2033	10.538
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	128.149	24-may-2033	(5.698)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	144.179	24-may-2033	243
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	283.622	24-may-2033	(6.973)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Goldman Sachs	USD	69.489	24-may-2033	(433)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	EUR	221.736	05-may-2028	(16.361)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	EUR	244.711	05-may-2028	(6.634)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	JPY	334.043	08-may-2028	648
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	SEK	131.822	05-may-2028	(2.836)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	USD	411.973	05-may-2028	(23.500)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	USD	96.706	05-may-2028	(4.440)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	J.P. Morgan	USD	40.810	05-may-2028	(1.134)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	AUD	520.687	18-may-2033	8577
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	EUR	177.540	18-may-2033	(6.016)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	JPY	333.650	18-may-2033	(10.308)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	SEK	295.578	18-may-2033	3332
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	USD	1.927.813	18-may-2033	(122.284)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	USD	362.904	18-may-2033	140
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	USD	51.848	18-may-2033	(4.820)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	USD	455.238	18-may-2033	(3.699)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	USD	542.871	18-may-2033	7595
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	USD	121.094	18-may-2033	(7.565)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	USD	601.072	18-may-2033	(11.106)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	USD	176.735	18-may-2033	(15.826)
Venta en corto	Servicios financieros diversificados	Morgan Stanley	USD	712.949	18-may-2033	(19.165)
Venta en corto	Eléctrico	Goldman Sachs	USD	262.004	24-may-2033	(2.465)
Venta en corto	Eléctrico	J.P. Morgan	USD	53.572	05-may-2028	(1.096)
Venta en corto	Eléctrico	J.P. Morgan	USD	233.879	05-may-2028	(4.102)
Venta en corto	Eléctrico	J.P. Morgan	USD	176.974	05-may-2028	(3.459)
Venta en corto	Eléctrico	J.P. Morgan	USD	134.398	05-may-2028	(386)
Venta en corto	Eléctrico	J.P. Morgan	USD	38.341	05-may-2028	(2.121)
Venta en corto	Eléctrico	J.P. Morgan	USD	185.255	05-may-2028	(8.406)
Venta en corto	Eléctrico	J.P. Morgan	USD	90.507	05-may-2028	(5.445)
Venta en corto	Eléctrico	J.P. Morgan	USD	101.227	05-may-2028	(3.983)
Venta en corto	Eléctrico	Morgan Stanley	USD	184.035	18-may-2033	(6.004)
Venta en corto	Eléctrico	Morgan Stanley	USD	92.810	18-may-2033	(1.268)
Venta en corto	Eléctrico	Morgan Stanley	USD	215.057	18-may-2033	(4.522)
Venta en corto	Eléctrico	Morgan Stanley	USD	73.350	18-may-2033	(2.618)
Venta en corto	Eléctrico	Morgan Stanley	USD	21.462	18-may-2033	(518)
Venta en corto	Eléctrico	Morgan Stanley	USD	224.904	18-may-2033	(11.492)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Venta en corto	Eléctrico	Morgan Stanley	USD	46.176	18-may-2033	(3.072)
Venta en corto	Eléctrico	Morgan Stanley	USD	29.780	18-may-2033	(997)
Venta en corto	Eléctrico	Morgan Stanley	USD	38.115	18-may-2033	(1.423)
Venta en corto	Eléctrico	Morgan Stanley	USD	44.244	18-may-2033	(990)
Venta en corto	Componentes y equipos eléctricos	Goldman Sachs	EUR	356.454	24-may-2033	(663)
Venta en corto	Componentes y equipos eléctricos	J.P. Morgan	EUR	15.832	05-may-2028	537
Venta en corto	Electrónica	Goldman Sachs	EUR	279.757	24-may-2033	(4.054)
Venta en corto	Electrónica	Goldman Sachs	JPY	383.377	24-may-2033	18.847
Venta en corto	Electrónica	Goldman Sachs	USD	158.244	12-sep-2024	(8.791)
Venta en corto	Electrónica	Goldman Sachs	USD	152.435	18-jul-2025	(3.326)
Venta en corto	Electrónica	J.P. Morgan	JPY	414	08-may-2028	(8)
Venta en corto	Electrónica	Morgan Stanley	EUR	65.055	18-may-2033	(1.139)
Venta en corto	Electrónica	Morgan Stanley	JPY	14.131	18-may-2033	95
Venta en corto	Electrónica	Morgan Stanley	USD	216.595	18-may-2033	(405)
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	Goldman Sachs	DKK	149.303	14-abr-2028	92
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	Goldman Sachs	USD	8233	24-may-2033	187
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	J.P. Morgan	SEK	1475	05-may-2028	81
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	J.P. Morgan	USD	16.647	05-may-2028	871
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	J.P. Morgan	USD	2434	05-may-2028	-
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	J.P. Morgan	USD	46.062	05-may-2028	(7.301)
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	J.P. Morgan	USD	52.432	05-may-2028	(2.946)
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	Morgan Stanley	SEK	6790	18-may-2033	29
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	Morgan Stanley	USD	24.309	18-may-2033	(803)
Venta en corto	Fuentes alternativas de energía	Morgan Stanley	USD	8413	18-may-2033	(3.124)
Venta en corto	Ingeniería y construcción	Goldman Sachs	EUR	85.576	24-may-2033	(1.735)
Venta en corto	Ingeniería y construcción	J.P. Morgan	EUR	1101	05-may-2028	(7)
Venta en corto	Ingeniería y construcción	Morgan Stanley	EUR	91.190	18-may-2033	40
Venta en corto	Entretenimiento	Goldman Sachs	SEK	222.826	07-abr-2027	4489
Venta en corto	Entretenimiento	J.P. Morgan	SEK	124.259	20-may-2033	(1.377)
Venta en corto	Entretenimiento	J.P. Morgan	USD	132.841	05-may-2028	(2.743)
Venta en corto	Entretenimiento	Morgan Stanley	USD	230.438	18-may-2033	(10.503)
Venta en corto	Entretenimiento	Morgan Stanley	USD	192.453	18-may-2033	(1.409)
Venta en corto	Entretenimiento	Morgan Stanley	USD	70.847	18-may-2033	944
Venta en corto	Entretenimiento	Morgan Stanley	USD	313.373	18-may-2033	(14.850)
Venta en corto	Entretenimiento	Morgan Stanley	USD	326.361	18-may-2033	(28.252)
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	USD	381.593	24-may-2033	(6.117)
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	USD	424.726	24-may-2033	3200
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	USD	1.346.574	24-may-2033	3345
Venta en corto	Índice de renta variable	Goldman Sachs	USD	386.953	26-may-2033	(359)
Venta en corto	Índice de renta variable	J.P. Morgan	USD	988.108	05-may-2028	(26.154)
Venta en corto	Índice de renta variable	J.P. Morgan	USD	901.632	05-may-2028	(13.755)
Venta en corto	Índice de renta variable	J.P. Morgan	USD	431.579	15-may-2033	(40.816)
Venta en corto	Índice de renta variable	J.P. Morgan	USD	61.698	20-may-2033	(1.575)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	EUR	347.943	18-may-2033	(2.969)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	EUR	352.547	18-may-2033	(5.688)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	EUR	595.688	18-may-2033	(36.188)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	EUR	406.590	18-may-2033	(879)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	1.209.358	18-may-2033	(26.006)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	179.488	18-may-2033	(7.883)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	99.392	18-may-2033	(2.009)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	2.093.773	18-may-2033	(87.528)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	250.899	18-may-2033	(10.671)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	770.749	18-may-2033	(23.895)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	87.242	18-may-2033	(1.875)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	1.005.927	18-may-2033	(35.358)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	5.304.418	18-may-2033	(268.245)
Venta en corto	Índice de renta variable	Morgan Stanley	USD	1.004.861	18-may-2033	(3.298)
Venta en corto	Alimentos	J.P. Morgan	CHF	194.822	05-may-2028	(1.863)
Venta en corto	Alimentos	Morgan Stanley	EUR	181.598	28-feb-2025	6001
Venta en corto	Alimentos	Morgan Stanley	USD	318.687	18-may-2033	(2.238)
Venta en corto	Alimentos	Morgan Stanley	USD	226.933	18-may-2033	(3.791)
Venta en corto	Gas	J.P. Morgan	USD	561.347	05-may-2028	(40.801)
Venta en corto	Gas	Morgan Stanley	USD	183.535	18-may-2033	(7.243)
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	CHF	359.420	05-abr-2024	9227
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	DKK	194.006	24-may-2033	(2.058)
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	DKK	142.695	24-may-2033	(207)
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	HKD	132.401	24-may-2033	44.320
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	99.982	24-may-2033	(5.243)
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	296.007	24-may-2033	(933)
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	151.967	24-may-2033	(2.993)
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	111.813	24-may-2033	(4.387)
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	44.918	24-may-2033	1508
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	138.329	24-may-2033	(565)
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	109.850	24-may-2033	(2.759)
Venta en corto	Salud (productos)	Goldman Sachs	USD	304.777	24-may-2033	600
Venta en corto	Salud (productos)	J.P. Morgan	AUD	140.128	05-may-2028	(2.513)
Venta en corto	Salud (productos)	J.P. Morgan	DKK	147.715	05-may-2028	5328
Venta en corto	Salud (productos)	J.P. Morgan	HKD	52	05-may-2028	17
Venta en corto	Salud (productos)	J.P. Morgan	JPY	189.587	08-may-2028	(2.177)
Venta en corto	Salud (productos)	J.P. Morgan	USD	2020	05-may-2028	2013
Venta en corto	Salud (productos)	J.P. Morgan	USD	1616	05-may-2028	1609
Venta en corto	Salud (productos)	Morgan Stanley	HKD	25.136	18-may-2033	8331
Venta en corto	Salud (productos)	Morgan Stanley	USD	444.303	18-may-2033	(17.701)
Venta en corto	Salud (productos)	Morgan Stanley	USD	161.324	18-may-2033	(3.701)
Venta en corto	Salud (productos)	Morgan Stanley	USD	150.632	18-may-2033	(2.112)
Venta en corto	Salud (productos)	Morgan Stanley	USD	49.592	18-may-2033	(1.656)
Venta en corto	Salud (productos)	Morgan Stanley	USD	213.869	18-may-2033	(3.588)
Venta en corto	Salud (servicios)	Goldman Sachs	EUR	238.070	24-may-2033	1254
Venta en corto	Salud (servicios)	Goldman Sachs	EUR	90.770	24-may-2033	(5.061)
Venta en corto	Salud (servicios)	Goldman Sachs	USD	248.415	24-may-2033	(10.484)
Venta en corto	Salud (servicios)	Goldman Sachs	USD	178.221	24-may-2033	(1.550)
Venta en corto	Salud (servicios)	J.P. Morgan	EUR	121.372	05-may-2028	8742
Venta en corto	Salud (servicios)	J.P. Morgan	EUR	45.798	05-may-2028	(3.717)
Venta en corto	Salud (servicios)	Morgan Stanley	EUR	526.650	18-may-2033	(24.420)
Venta en corto	Salud (servicios)	Morgan Stanley	USD	15.706	18-may-2033	(1.163)
Venta en corto	Constructores de viviendas	Morgan Stanley	USD	106.139	18-may-2033	(24.570)
Venta en corto	Productos/artículos para el hogar	Morgan Stanley	USD	368.007	18-may-2033	106
Venta en corto	Seguros	Goldman Sachs	EUR	179.545	24-may-2033	(1.712)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Venta en corto	Seguros	Goldman Sachs	EUR	201.958	24-may-2033	(8.816)
Venta en corto	Seguros	J.P. Morgan	CHF	1.445.674	05-may-2028	(12.255)
Venta en corto	Seguros	J.P. Morgan	CHF	270.125	05-may-2028	6837
Venta en corto	Seguros	J.P. Morgan	CHF	662.236	05-may-2028	(52.196)
Venta en corto	Seguros	J.P. Morgan	EUR	955.668	05-may-2028	(55.118)
Venta en corto	Seguros	J.P. Morgan	EUR	130.253	05-may-2028	(10.730)
Venta en corto	Seguros	J.P. Morgan	EUR	232.030	05-may-2028	10.846
Venta en corto	Seguros	J.P. Morgan	JPY	405.382	20-feb-2025	8424
Venta en corto	Seguros	Morgan Stanley	CHF	363.905	18-may-2033	840
Venta en corto	Seguros	Morgan Stanley	EUR	551.758	18-may-2033	(7.973)
Venta en corto	Seguros	Morgan Stanley	EUR	311.543	18-may-2033	(21.774)
Venta en corto	Seguros	Morgan Stanley	EUR	274.612	18-may-2033	9858
Venta en corto	Seguros	Morgan Stanley	NOK	304.453	19-may-2033	19.195
Venta en corto	Internet	Goldman Sachs	EUR	277.506	24-may-2033	(14.364)
Venta en corto	Internet	Goldman Sachs	GBP	170.362	24-may-2033	9562
Venta en corto	Internet	Goldman Sachs	USD	165.794	24-may-2033	(508)
Venta en corto	Internet	J.P. Morgan	GBP	198.037	05-may-2028	(1.986)
Venta en corto	Internet	J.P. Morgan	GBP	32.578	20-may-2033	2352
Venta en corto	Internet	J.P. Morgan	HKD	128.301	22-jul-2024	(8.792)
Venta en corto	Internet	J.P. Morgan	HKD	180.865	24-feb-2026	(13.141)
Venta en corto	Internet	J.P. Morgan	USD	128.748	05-may-2028	(18.335)
Venta en corto	Internet	J.P. Morgan	USD	65.062	16-may-2033	(856)
Venta en corto	Internet	J.P. Morgan	USD	34.415	16-may-2033	(1.216)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	HKD	200.110	18-may-2033	(14.090)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	714.527	19-may-2025	(19.215)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	403.258	19-may-2025	(14.972)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	353.358	18-may-2033	(4.701)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	272.633	18-may-2033	(3.728)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	275.106	18-may-2033	(1.921)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	259.545	18-may-2033	(3.990)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	587.205	18-may-2033	(36.791)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	395.334	18-may-2033	(13.975)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	109.529	18-may-2033	(1.169)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	226.543	18-may-2033	(1.425)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	67.956	18-may-2033	(3.934)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	340.699	18-may-2033	3259
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	281.101	18-may-2033	(31.961)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	372.793	18-may-2033	(478)
Venta en corto	Internet	Morgan Stanley	USD	68.405	18-may-2033	(1.261)
Venta en corto	Tiempo libre	Morgan Stanley	USD	361.992	18-may-2033	(37.408)
Venta en corto	Tiempo libre	Morgan Stanley	USD	190.533	18-may-2033	(1.217)
Venta en corto	Tiempo libre	Morgan Stanley	USD	279.160	18-may-2033	(25.505)
Venta en corto	Tiempo libre	Morgan Stanley	USD	122.524	18-may-2033	(4.961)
Venta en corto	Alojamiento	Goldman Sachs	GBP	260.966	22-dic-2033	(9.854)
Venta en corto	Alojamiento	J.P. Morgan	GBP	121	20-may-2033	(5)
Venta en corto	Alojamiento	J.P. Morgan	USD	145.052	15-may-2033	128
Venta en corto	Alojamiento	Morgan Stanley	USD	327.128	18-may-2033	7083
Venta en corto	Alojamiento	Morgan Stanley	USD	261.546	18-may-2033	(23.823)
Venta en corto	Alojamiento	Morgan Stanley	USD	268.477	18-may-2033	(9.064)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Venta en corto	Alojamiento	Morgan Stanley	USD	378.287	18-may-2033	(38.199)
Venta en corto	Alojamiento	Morgan Stanley	USD	260.967	18-may-2033	(3.426)
Venta en corto	Maquinaria (construcción y minería)	J.P. Morgan	USD	95.317	05-may-2028	(21.612)
Venta en corto	Maquinaria (diversificado)	Goldman Sachs	SEK	545.880	24-may-2033	2643
Venta en corto	Medios de comunicación	J.P. Morgan	USD	68.325	15-may-2033	(1.717)
Venta en corto	Medios de comunicación	Morgan Stanley	USD	354.884	19-may-2025	24
Venta en corto	Medios de comunicación	Morgan Stanley	USD	696.318	18-may-2033	(8.727)
Venta en corto	Medios de comunicación	Morgan Stanley	USD	254.910	18-may-2033	(23.704)
Venta en corto	Medios de comunicación	Morgan Stanley	USD	177.700	18-may-2033	(3.954)
Venta en corto	Fabricación diversa	Morgan Stanley	SEK	491.822	18-may-2033	569
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	AUD	345.438	24-may-2033	(11.894)
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	CAD	8013	25-may-2033	(111)
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	CAD	43.438	25-may-2033	(2.251)
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	EUR	27.543	24-may-2033	(142)
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	EUR	121.157	24-may-2033	196
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	GBP	88.443	24-may-2033	(6.594)
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	NOK	31.015	24-may-2033	(34)
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	NOK	115.199	24-may-2033	(5.047)
Venta en corto	Petróleo y gas	Goldman Sachs	USD	133.652	11-dic-2028	(3.455)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	AUD	247	05-may-2028	(18)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	CAD	634.574	05-may-2028	(54.622)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	EUR	58.887	05-may-2028	(3.904)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	NOK	11.480	05-may-2028	(432)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	251.122	05-may-2028	(15.012)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	180.174	05-may-2028	(2.472)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	139.335	05-may-2028	(15.249)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	18.743	05-may-2028	(2.046)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	71.929	05-may-2028	(4.909)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	520.632	05-may-2028	(54.523)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	887.488	05-may-2028	(90.274)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	65.938	05-may-2028	(13.863)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	98.977	05-may-2028	(10.264)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	46.561	05-may-2028	(2.189)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	16.939	05-may-2028	(1.135)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	186.431	05-may-2028	(27.039)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	170.463	05-may-2028	(21.711)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	92.494	05-may-2028	(7.539)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	104.629	05-may-2028	2298
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	508.257	05-may-2028	(56.709)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	119.603	05-may-2028	(861)
Venta en corto	Petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	4235	05-may-2028	(568)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	AUD	10.054	18-may-2033	(558)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	CAD	267.132	18-may-2033	(10.922)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	CAD	69.326	18-may-2033	(523)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	CAD	763.143	18-may-2033	(22.065)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	CAD	437.367	18-may-2033	(13.637)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	CAD	445.280	18-may-2033	(41.961)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	CAD	434.695	18-may-2033	(23.570)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	CAD	97.234	18-may-2033	1284

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	CAD	151.438	18-may-2033	(7.402)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	CAD	75.014	18-may-2033	(5.162)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	GBP	10.607	18-may-2033	(302)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	NOK	227.515	19-may-2033	(3.443)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	25.550	18-may-2033	(886)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	48.989	18-may-2033	(3.204)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	63.647	18-may-2033	(2.748)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	103.514	18-may-2033	(4.982)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	14.037	18-may-2033	94
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	70.423	18-may-2033	(6.407)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	196.631	18-may-2033	(16.526)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	85.729	18-may-2033	(7.509)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	115.397	18-may-2033	(12.810)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	42.834	18-may-2033	(1.800)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	24.998	18-may-2033	968
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	169.570	18-may-2033	(5.808)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	186.594	18-may-2033	(12.232)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	14.657	18-may-2033	(254)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	798	18-may-2033	(22)
Venta en corto	Petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	389.655	18-may-2033	(17.780)
Venta en corto	Servicios de petróleo y gas	Goldman Sachs	USD	427.261	24-may-2033	(13.415)
Venta en corto	Servicios de petróleo y gas	Goldman Sachs	USD	72.040	24-may-2033	(3.759)
Venta en corto	Servicios de petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	116.111	05-may-2028	5781
Venta en corto	Servicios de petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	102.283	05-may-2028	(4.699)
Venta en corto	Servicios de petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	1275	05-may-2028	32
Venta en corto	Servicios de petróleo y gas	J.P. Morgan	USD	70.713	05-may-2028	(8.276)
Venta en corto	Servicios de petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	205.213	18-may-2033	(9.192)
Venta en corto	Servicios de petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	115.041	18-may-2033	(1.633)
Venta en corto	Servicios de petróleo y gas	Morgan Stanley	USD	175	18-may-2033	(6)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	CHF	52.801	24-may-2033	(3.800)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	EUR	220.404	24-may-2033	(1.636)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	EUR	119.943	24-may-2033	(4.020)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	EUR	128.864	24-may-2033	2540
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	USD	72.640	24-may-2033	140
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Goldman Sachs	USD	21.586	24-may-2033	(109)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	EUR	528.222	20-jun-2024	(17.967)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	EUR	56.394	05-may-2028	(5.319)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	J.P. Morgan	JPY	132.161	08-may-2028	10.022
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	EUR	475.843	18-may-2033	(17.184)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	EUR	85.103	18-may-2033	(7.057)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	EUR	17.474	18-may-2033	(542)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	HKD	133.646	18-may-2033	14.400
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	247.710	18-may-2033	(16)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	562.775	18-may-2033	(17.400)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	132.051	18-may-2033	853
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	133.779	18-may-2033	(2.149)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	611.159	18-may-2033	(19.339)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	71.315	18-may-2033	(3.568)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	176.621	18-may-2033	(5.024)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	154.713	18-may-2033	(1.651)
Venta en corto	Productos farmacéuticos	Morgan Stanley	USD	197.913	18-may-2033	1367
Venta en corto	Tuberías	Goldman Sachs	USD	114.707	24-may-2033	(1.972)
Venta en corto	Tuberías	J.P. Morgan	USD	210.056	05-may-2028	(11.481)
Venta en corto	Tuberías	J.P. Morgan	USD	324.347	05-may-2028	(11.348)
Venta en corto	Tuberías	J.P. Morgan	USD	269.176	05-may-2028	(38.581)
Venta en corto	Tuberías	J.P. Morgan	USD	55.174	05-may-2028	(2.749)
Venta en corto	Tuberías	Morgan Stanley	CAD	92.561	18-may-2033	(3.639)
Venta en corto	Tuberías	Morgan Stanley	USD	1182	18-may-2033	(47)
Venta en corto	Tuberías	Morgan Stanley	USD	113.344	18-may-2033	(4.766)
Venta en corto	Capital riesgo	Goldman Sachs	USD	60.047	24-may-2033	(1.697)
Venta en corto	Capital riesgo	Goldman Sachs	USD	704.512	24-may-2033	(8.051)
Venta en corto	Capital riesgo	J.P. Morgan	CHF	378.037	05-may-2028	(3.499)
Venta en corto	Capital riesgo	J.P. Morgan	SEK	587.564	05-may-2028	(72.027)
Venta en corto	Capital riesgo	J.P. Morgan	USD	582.036	05-may-2028	(10.484)
Venta en corto	Capital riesgo	Morgan Stanley	CHF	134.933	18-may-2033	(206)
Venta en corto	Capital riesgo	Morgan Stanley	SEK	242.285	18-may-2033	1935
Venta en corto	Capital riesgo	Morgan Stanley	USD	1.568.873	18-may-2033	(80.346)
Venta en corto	Capital riesgo	Morgan Stanley	USD	951.649	18-may-2033	(49.739)
Venta en corto	REIT	Goldman Sachs	EUR	114.310	24-may-2033	(3.781)
Venta en corto	REIT	Goldman Sachs	GBP	322	24-may-2033	(18)
Venta en corto	REIT	J.P. Morgan	EUR	114.660	05-may-2028	(9.127)
Venta en corto	REIT	J.P. Morgan	USD	267.481	05-may-2028	(8.047)
Venta en corto	REIT	J.P. Morgan	USD	334.493	05-may-2028	(309)
Venta en corto	REIT	Morgan Stanley	EUR	125.764	18-may-2033	(5.142)
Venta en corto	REIT	Morgan Stanley	USD	262.986	18-may-2033	(5.937)
Venta en corto	REIT	Morgan Stanley	USD	196.285	18-may-2033	2150
Venta en corto	REIT	Morgan Stanley	USD	338.136	18-may-2033	1401
Venta en corto	REIT	Morgan Stanley	USD	264.042	18-may-2033	(5.864)
Venta en corto	REIT	Morgan Stanley	USD	127.349	18-may-2033	(721)
Venta en corto	Ventas minoristas	J.P. Morgan	EUR	75.801	05-may-2028	(26.908)
Venta en corto	Ventas minoristas	J.P. Morgan	SEK	68.831	05-may-2028	(16.875)
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	171.592	19-may-2025	(3.573)
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	346.357	18-may-2033	(9.623)
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	341.399	18-may-2033	(13.949)
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	848.027	18-may-2033	(8.537)
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	337.418	18-may-2033	(3.255)
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	335.427	18-may-2033	(4.727)
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	275.041	18-may-2033	(4.999)
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	64.592	18-may-2033	(5.096)
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	201.638	18-may-2033	(25.437)
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	159.506	18-may-2033	3218
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	262.928	18-may-2033	(6.275)
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	396.874	18-may-2033	(1.011)
Venta en corto	Ventas minoristas	Morgan Stanley	USD	164.983	18-may-2033	(12.207)
Venta en corto	Semiconductores	J.P. Morgan	USD	33.894	15-may-2033	(336)
Venta en corto	Semiconductores	Morgan Stanley	USD	353.303	18-may-2033	(4.247)
Venta en corto	Semiconductores	Morgan Stanley	USD	55.066	18-may-2033	374
Venta en corto	Semiconductores	Morgan Stanley	USD	229.790	18-may-2033	(4.929)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de rentabilidad total (continuación)

Posición de protección	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)						
Venta en corto	Semiconductores	Morgan Stanley	USD	111.532	18-may-2033	1040
Venta en corto	Software	Goldman Sachs	USD	62.818	24-may-2033	(1.749)
Venta en corto	Software	Goldman Sachs	USD	110.737	24-may-2033	(1.286)
Venta en corto	Software	Goldman Sachs	USD	144.079	24-may-2033	(5.776)
Venta en corto	Software	Goldman Sachs	USD	297.749	24-may-2033	16.513
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	275.287	18-may-2033	4317
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	694.310	18-may-2033	8274
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	271.429	18-may-2033	(18.485)
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	218.306	18-may-2033	(8.544)
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	199.106	18-may-2033	(111)
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	164.018	18-may-2033	(5.853)
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	269.217	18-may-2033	(7.085)
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	150.356	18-may-2033	(2.947)
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	101.093	18-may-2033	3517
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	172.891	18-may-2033	1572
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	132.263	18-may-2033	(959)
Venta en corto	Software	Morgan Stanley	USD	166.982	18-may-2033	(5.322)
Venta en corto	Telecomunicaciones	J.P. Morgan	USD	101.890	15-may-2033	530
Venta en corto	Telecomunicaciones	Morgan Stanley	CAD	481.743	18-may-2033	5993
Venta en corto	Telecomunicaciones	Morgan Stanley	USD	399.562	19-may-2025	(8.003)
Venta en corto	Telecomunicaciones	Morgan Stanley	USD	166.806	18-may-2033	(10.433)
Venta en corto	Telecomunicaciones	Morgan Stanley	USD	307.176	18-may-2033	(3.269)
Venta en corto	Juguetes, juegos y aficiones	J.P. Morgan	JPY	248.018	08-may-2028	3821
Venta en corto	Juguetes, juegos y aficiones	Morgan Stanley	JPY	56.797	18-may-2033	(238)
Venta en corto	Juguetes, juegos y aficiones	Morgan Stanley	USD	264.073	18-may-2033	(3.776)
Venta en corto	Transporte	Goldman Sachs	DKK	120.520	24-may-2033	(6.098)
USD						(1.335.140)

Contratos por diferencias

Los contratos por diferencias («CFD», por sus siglas en inglés) se valoran tomando como base el precio del título subyacente convertido a la moneda base del contrato, a excepción de cualquier comisión financiera atribuible a cada contrato registrado por separado. Al suscribir un contrato por diferencias, es posible que los subfondos deban entregar en garantía una cantidad en efectivo y/u otros activos al agente de bolsa, que sea igual a cierto porcentaje del importe del contrato («margen inicial»). Posteriormente, los pagos conocidos como «márgenes de variación» son realizados o recibidos de forma periódica por los subfondos, según las fluctuaciones del valor del título subyacente. Las ganancias o las pérdidas materializadas al cierre del contrato son iguales a la diferencia entre el valor del contrato por diferencias en el momento en que se abrió (incluidos los cambios financieros) y el valor en el momento en que se cerró. Los dividendos (netos de impuestos de retención) atribuibles a contratos abiertos se consideran dividendos por cobrar al final del periodo. El resultado de estas revalorizaciones se muestra en el Balance en el epígrafe «Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos por diferencias».

A 31 de marzo de 2024, los siguientes subfondos tenían establecidos contratos por diferencias sobre índices financieros y contratos de futuros:

Contrato	Contraparte	Cantidad	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Asian Equity Long Short				
CFD sobre acciones australianas	UBS	360.010	5417	12.942
CFD sobre acciones chinas	Goldman Sachs	(8.241)	(4.862)	(16.930)
CFD sobre acciones chinas	UBS	430.886	133.199	131.064
CFD sobre acciones hongkonesas	UBS	158.600	(54.883)	(39.700)
CFD sobre acciones indonesias	UBS	(398.100)	6230	362
CFD sobre acciones macaenses	UBS	57.000	(728)	(12.454)
CFD sobre acciones neozelandesas	Goldman Sachs	(14.172)	6520	(3.079)
CFD sobre acciones neozelandesas	UBS	105.610	(17.036)	(22.394)
CFD sobre acciones singapurenses	J.P. Morgan	106.400	17.638	34.911

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos por diferencias (continuación)

Contrato	Contraparte	Cantidad	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Asian Equity Long Short (continuación)				
CFD sobre acciones surcoreanas	Goldman Sachs	(5.890)	(1.119)	(6.636)
CFD sobre acciones surcoreanas	UBS	(205)	4456	3071
CFD sobre acciones taiwanesas	Goldman Sachs	(121.000)	11.888	(25.004)
CFD sobre acciones taiwanesas	UBS	(207.000)	23.095	(16.445)
CFD sobre acciones estadounidenses	Goldman Sachs	(12.610)	(13.241)	(14.027)
CFD sobre acciones estadounidenses	UBS	119.669	37.435	79.505
CFD sobre el índice MSCI AC Pacific ex Japan Growth	UBS	(14.021)	(48.372)	(568.684)
			USD 105.637	(463.498)
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price	Bank of America	2158	1.686.238	45.609
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Banks Price	Bank of America	5437	1.115.482	91.388
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Basic Resources Price	Bank of America	(1.641)	(975.504)	(49.731)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Chemicals Price	Bank of America	1299	1.895.317	104.028
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price	Bank of America	1085	834.136	28.163
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Financial Services Price	Bank of America	884	718.310	29.326
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price	Bank of America	(4.285)	(3.313.351)	(36.048)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Health Care Price	Bank of America	2029	2.488.374	72.215
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price	Bank of America	1125	1.040.522	32.454
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Insurance Price	Bank of America	3513	1.458.202	61.512
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Media Price	Bank of America	1999	978.998	16.973
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price	Bank of America	5777	2.266.205	64.203
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods	Bank of America	1381	1.603.705	(1.564)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Retail Price	Bank of America	2987	1.439.470	175.982
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Technology Price	Bank of America	1164	1.075.363	4143
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Telecommunications Price	Bank of America	5953	1.291.415	8893
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Travel & Leisure	Bank of America	5161	1.457.410	(16.314)
CFD sobre el índice Stoxx Europe 600 Utilities Price	Bank of America	3336	1.337.081	49.230
CFD sobre el índice S&P 500 Consumer Discretionary Sector	Goldman Sachs	3029	4.499.540	551
CFD sobre el índice S&P 500 Consumer Staples Sector	Goldman Sachs	6560	5.341.341	164.189
CFD sobre el índice S&P 500 Energy Sector	Goldman Sachs	4764	3.435.998	315.476
CFD sobre el índice S&P 500 Financials Sector	Goldman Sachs	2432	1.705.622	76.060
CFD sobre el índice S&P 500 Health Care Sector	Goldman Sachs	2451	4.225.453	92.062
CFD sobre el índice S&P 500 Industrials Sector	Goldman Sachs	1501	1.601.139	66.276
CFD sobre el índice S&P 500 Information Technology Sector	Goldman Sachs	737	2.816.113	53.417
CFD sobre el índice S&P 500 Materials Sector	Goldman Sachs	5495	3.215.450	188.166
CFD sobre el índice S&P 500 Utilities Sector	Goldman Sachs	(1.565)	(521.909)	(30.953)
			USD 44.716.120	1.605.706
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
CFD sobre acciones australianas	Morgan Stanley	(26.700)	(138.670)	(138.670)
CFD sobre acciones británicas	Morgan Stanley	(43.606)	(522.871)	(522.871)
CFD sobre acciones francesas	Goldman Sachs	(37.410)	206.542	206.542
CFD sobre acciones francesas	Morgan Stanley	(33.853)	(75.601)	(75.601)
CFD sobre acciones alemanas	Morgan Stanley	231.627	346.543	346.543
CFD sobre acciones indias	Morgan Stanley	(17.574)	32.863	32.863
CFD sobre acciones israelíes	Goldman Sachs	(11.133)	(254.055)	(254.055)
CFD sobre acciones japonesas	Goldman Sachs	(170.500)	(49.374)	(49.374)
CFD sobre acciones noruegas	Morgan Stanley	386.662	32.766	32.766
CFD sobre acciones singapurenses	Morgan Stanley	(40.573)	65.323	65.323
CFD sobre acciones taiwanesas	Morgan Stanley	215.000	46.143	46.143
CFD sobre acciones estadounidenses	Goldman Sachs	(1.044.931)	(957.713)	(957.713)
CFD sobre acciones estadounidenses	Morgan Stanley	(1.809.889)	(1.965.911)	(1.965.911)
			USD (3.234.015)	(3.234.015)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos por diferencias (continuación)

Contrato	Contraparte	Cantidad	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Helix				
CFD sobre acciones australianas	Goldman Sachs	758.327	147.736	147.760
CFD sobre acciones australianas	J.P. Morgan	1.373.217	76.635	146.214
CFD sobre acciones austriacas	Goldman Sachs	9656	42.861	42.861
CFD sobre acciones austriacas	J.P. Morgan	27.735	69.792	72.764
CFD sobre acciones belgas	Goldman Sachs	(1.670)	(1.533)	(1.533)
CFD sobre acciones brasileñas	Goldman Sachs	(47.858)	(4.530)	(4.530)
CFD sobre acciones brasileñas	J.P. Morgan	254.500	40.345	223.329
CFD sobre acciones británicas	Goldman Sachs	6.523.430	83.782	83.782
CFD sobre acciones británicas	J.P. Morgan	627.778	194.857	184.817
CFD sobre acciones canadienses	Goldman Sachs	4652	6349	6354
CFD sobre acciones chilenas	Goldman Sachs	19.088	48.467	48.467
CFD sobre acciones chinas	Goldman Sachs	6.255.595	248.542	247.302
CFD sobre acciones chinas	J.P. Morgan	4.057.327	384.138	917.263
CFD sobre acciones checas	Goldman Sachs	(78.431)	(104.787)	(104.787)
CFD sobre acciones checas	J.P. Morgan	(14.095)	42.503	30.952
CFD sobre acciones danesas	Goldman Sachs	26.733	(32)	(32)
CFD sobre acciones danesas	J.P. Morgan	83.582	(79.364)	104.258
CFD sobre acciones neerlandesas	Goldman Sachs	56.958	5755	5753
CFD sobre acciones neerlandesas	J.P. Morgan	109.295	155.078	370.737
CFD sobre acciones finlandesas	Goldman Sachs	(6.481)	735	735
CFD sobre acciones francesas	Goldman Sachs	11.555	81.099	81.099
CFD sobre acciones francesas	J.P. Morgan	87.709	53.517	205.375
CFD sobre acciones georgianas	Goldman Sachs	(37.139)	(25.804)	(25.804)
CFD sobre acciones alemanas	Goldman Sachs	(7.583)	55.550	55.552
CFD sobre acciones alemanas	J.P. Morgan	93.310	316.941	553.883
CFD sobre acciones hongkonesas	Goldman Sachs	2.364.591	(245.223)	(244.441)
CFD sobre acciones hongkonesas	J.P. Morgan	950.700	(283.526)	(55.182)
CFD sobre acciones húngaras	Goldman Sachs	(3.176)	2953	2953
CFD sobre acciones indias	J.P. Morgan	24.110	(964)	3128
CFD sobre acciones indonesias	J.P. Morgan	(1.338.900)	14.868	(1.742)
CFD sobre acciones irlandesas	Goldman Sachs	(14.621)	5597	5597
CFD sobre acciones italianas	Goldman Sachs	116.075	36.154	36.154
CFD sobre acciones italianas	J.P. Morgan	67.914	31.686	25.465
CFD sobre acciones japonesas	Goldman Sachs	362.500	3109	4640
CFD sobre acciones japonesas	J.P. Morgan	7.692.200	477.719	2.621.165
CFD sobre acciones macaenses	Goldman Sachs	52.000	(6.312)	(6.312)
CFD sobre acciones macaenses	J.P. Morgan	177.000	(15.831)	(38.465)
CFD sobre acciones mexicanas	Goldman Sachs	(55.307)	(20.979)	(20.979)
CFD sobre acciones neozelandesas	Goldman Sachs	(43.067)	(31.170)	(31.170)
CFD sobre acciones neozelandesas	J.P. Morgan	338.331	(27.320)	(54.963)
CFD sobre acciones noruegas	Goldman Sachs	104.533	24.198	24.200
CFD sobre acciones noruegas	J.P. Morgan	131.723	32.570	25.020
CFD sobre acciones peruanas	Goldman Sachs	546	(808)	(808)
CFD sobre acciones polacas	Goldman Sachs	(112.234)	(60.151)	(60.151)
CFD sobre acciones polacas	J.P. Morgan	(120.122)	(20.378)	(40.612)
CFD sobre acciones portuguesas	J.P. Morgan	77.460	(4.601)	36.070
CFD sobre acciones saudíes	Goldman Sachs	(1.524)	1059	1059
CFD sobre acciones saudíes	J.P. Morgan	43.348	(79.807)	(37.125)
CFD sobre acciones singapurenses	Goldman Sachs	1.211.015	211.216	211.218
CFD sobre acciones singapurenses	J.P. Morgan	432.600	86.539	165.665
CFD sobre acciones sudafricanas	Goldman Sachs	64.426	142.214	142.214

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos por diferencias (continuación)

Contrato	Contraparte	Cantidad	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Helix (continuación)				
CFD sobre acciones surcoreanas	Goldman Sachs	(18.109)	19.202	19.202
CFD sobre acciones surcoreanas	J.P. Morgan	(1.036)	7233	1762
CFD sobre acciones españolas	Goldman Sachs	96.671	235.538	235.547
CFD sobre acciones españolas	J.P. Morgan	242.742	145.582	345.366
CFD sobre acciones suecas	Goldman Sachs	12.047	42.664	42.495
CFD sobre acciones suecas	J.P. Morgan	98.039	(110.943)	(90.163)
CFD sobre acciones suizas	Goldman Sachs	(313.944)	(40.845)	(40.845)
CFD sobre acciones suizas	J.P. Morgan	3414	208.178	325.438
CFD sobre acciones taiwanesas	Goldman Sachs	(1.160.624)	(36.596)	(36.596)
CFD sobre acciones turcas	Goldman Sachs	3.239.377	172.205	172.205
CFD sobre acciones estadounidenses	Goldman Sachs	155.448	412.570	412.922
CFD sobre acciones estadounidenses	J.P. Morgan	695.485	358.236	833.641
CFD sobre el índice FTSE 250	Goldman Sachs	(175)	(88.500)	(88.500)
CFD sobre el índice GSCBTUK3	Goldman Sachs	(23.719)	(90.488)	(90.488)
CFD sobre el índice GSHEJVL2	Goldman Sachs	23.386.915	524.337	524.337
CFD sobre el índice GSHEJVS2	Goldman Sachs	(23.129.188)	(145.280)	(145.280)
CFD sobre el índice GSXAMFSS Clone	Goldman Sachs	(4.492.085)	258.155	187.193
CFD sobre el índice HXE Chemicals Hedge	Goldman Sachs	(65.079)	(194.706)	(194.706)
CFD sobre el índice HXE Chemicals	Goldman Sachs	62.538	(20.883)	160.971
CFD sobre el índice HXE ER Long	J.P. Morgan	88.766	388.165	441.311
CFD sobre el índice HXE ER Short	J.P. Morgan	(87.442)	(288.183)	(323.134)
CFD sobre el índice HXE EU Banks	Goldman Sachs	67.436	370.056	503.394
CFD sobre el índice HXE EU Value Long	Goldman Sachs	52.788	352.328	352.328
CFD sobre el índice HXE EU Value Short	Goldman Sachs	(50.790)	(204.054)	(204.054)
CFD sobre el índice HXE Miners Hedge	Goldman Sachs	(27.216)	(63.794)	(63.794)
CFD sobre el índice HXE TSMC Hedge	Goldman Sachs	63.942	195.755	195.755
CFD sobre el índice HXE US MOM	J.P. Morgan	3486	18.411	(132.281)
CFD sobre el índice HXE US Value Long	Goldman Sachs	82.987	564.312	564.312
CFD sobre el índice HXE US Value Short	Goldman Sachs	(83.036)	(127.045)	(127.045)
CFD sobre el índice MSCI AC Pacific ex Japan Growth	Goldman Sachs	(48.268)	(1.221.976)	(1.221.976)
CFD sobre el índice MSCI EM Europe 10/40	Goldman Sachs	(276)	(16.138)	(16.138)
CFD sobre el índice MSCI EM Latin America 10/40 Gross Total Return	Goldman Sachs	(1.678)	(33.747)	(33.747)
			USD 3.701.193	8.614.601
Schroder GAIA SEG US Equity				
CFD sobre acciones australianas	Goldman Sachs	40.015	(296.841)	(285.732)
CFD sobre acciones canadienses	Goldman Sachs	57.521	(12.989)	(12.989)
CFD sobre acciones francesas	Goldman Sachs	6757	182.323	184.261
CFD sobre acciones indias	Goldman Sachs	(124.002)	(179.830)	(185.429)
CFD sobre acciones italianas	Goldman Sachs	113.453	2.805.481	2.836.989
CFD sobre acciones luxemburguesas	Goldman Sachs	(13.841)	(18.818)	(19.347)
CFD sobre acciones mexicanas	Goldman Sachs	(12.827)	(370.012)	(409.121)
CFD sobre acciones suizas	Goldman Sachs	463.207	926.890	1.531.071
CFD sobre acciones estadounidenses	Goldman Sachs	(704.779)	4.404.846	10.220.756
CFD sobre cesta de GS Commercial Real Estate	Goldman Sachs	(13.993)	(263.632)	(279.891)
CFD sobre el índice GS CORD	Goldman Sachs	(15.974)	(53.860)	(48.317)
CFD sobre cesta de GS CSDN	Goldman Sachs	(17.434)	(44.469)	(111.905)
CFD sobre cesta de GS Energy	Goldman Sachs	(24.821)	(226.519)	(268.951)
CFD sobre cesta de GS Flagship	Goldman Sachs	(84.712)	(424.586)	(852.311)
CFD sobre cesta de GS Healthcare	Goldman Sachs	(24.037)	(73.530)	(99.030)
CFD sobre cesta de GS Holt Defense	Goldman Sachs	(29.299)	(249.344)	(234.146)
CFD sobre cesta de GS Info Tech	Goldman Sachs	(16.079)	(4.498)	(29.698)
CFD sobre cesta de GS NRSI	Goldman Sachs	(12.240)	(327.602)	(362.153)
CFD sobre el índice GS OZVT	Goldman Sachs	(71.002)	(590.512)	(760.940)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos por diferencias (continuación)

Contrato	Contraparte	Cantidad	Valor de mercado	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA SEG US Equity				
CFD sobre cesta de GS PEVC	Goldman Sachs	(30.902)	(162.309)	(192.455)
CFD sobre cesta de GS PWRS	Goldman Sachs	(20.890)	(139.178)	(139.232)
CFD sobre el índice GS SHIF	Goldman Sachs	(15.922)	49.161	49.645
CFD sobre cesta de GS SPAC	Goldman Sachs	(26.836)	7.139	63.015
CFD sobre cesta de GS STHK	Goldman Sachs	(19.778)	18.354	48.841
CFD sobre cesta de GS Utilities	Goldman Sachs	(15.597)	72.458	65.916
			USD 5.028.123	10.708.847

Contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio

Los swaps de índices de incumplimiento crediticio permiten transmitir el riesgo de incumplimiento. Esto permite a un subfondo adquirir en la práctica un seguro para una obligación del valor de referencia que posee (cubrir la inversión) o comprar protección para una obligación del valor de referencia que no posee físicamente en previsión de que se produzca un deterioro de la calidad del crédito. Una de las partes, el comprador de protección, realiza pagos periódicos al vendedor de la protección, que a su vez debe realizar un pago al comprador si se produce un acontecimiento de crédito (una reducción de la calidad crediticia, que se definirá previamente en el acuerdo firmado por ambas partes). Si el acontecimiento de crédito no se produce, el comprador paga todas las primas fijadas y el swap se resuelve al vencimiento sin que se realicen nuevos pagos. Por lo tanto, el riesgo del comprador queda limitado al valor de las primas pagadas. Además, si se produce un acontecimiento de crédito y el subfondo no posee la obligación de referencia subyacente, se puede producir un riesgo de mercado, ya que el subfondo puede tardar un tiempo en obtener la obligación del índice de referencia y entregarla a la contraparte. Asimismo, si la contraparte se declara en suspensión de pagos, es posible que el subfondo no pueda recuperar todo el dinero que esta le adeude. En ocasiones, el mercado de índices de incumplimiento crediticio es menos líquido que los mercados de renta fija. La Sociedad reducirá este riesgo controlando de una forma adecuada el uso de este tipo de transacción.

Los índices de incumplimiento crediticio se valoraron a su valor intrínseco. El método de valoración empleado implica el uso del valor actual de la serie de tipos de interés y el valor actual del diferencial de crédito negociado en el mercado en la fecha de cierre. El resultado de estos reajustes, junto con todos los intereses por cobrar/pagar en relación con el índice de incumplimiento crediticio, se indica en el Balance, en el epígrafe «Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos de swaps de índices de incumplimiento crediticio».

A 31 de marzo de 2024, los siguientes subfondos estaban comprometidos con acuerdos de swaps de índices de incumplimiento crediticio sobre índices financieros:

Posición de protección	Descripción	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Interés (pagado)/ recibido en %	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend							
Venta	CDX iTraxx Europe Crossover Series 41 20/06/2029	J.P. Morgan	EUR	37.000.000	5,00	20-jun-2029	3.558.875
Venta	CDX iTraxx Europe Series 41 20/06/2029	J.P. Morgan	EUR	149.000.000	1,00	20-jun-2029	3.576.767
Compra	CDX North America High Yield Series 41 20/12/2028	J.P. Morgan	USD	50.490.000	5,00	20-dic-2028	(62.004)
Venta	CDX North America High Yield Series 41 20/12/2028	J.P. Morgan	USD	50.490.000	5,00	20-dic-2028	3.729.016
Venta	CDX North America High Yield Series 42 20/06/2029	J.P. Morgan	USD	51.000.000	5,00	20-jun-2029	105.847
Venta	CDX North America Investment Grade Series 42 20/06/2029	J.P. Morgan	USD	229.000.000	1,00	20-jun-2029	5.217.370
						USD	16.125.871
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Venta	CDX iTraxx Europe Series 41 20/06/2029	Citi Bank	EUR	66.000.000	1,00	20-jun-2029	32.981
Compra	CDX North America Investment Grade Series 42 20/06/2029	Citi Bank	USD	20.000.000	1,00	20-jun-2029	(13.109)
						USD	19.872
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Venta	CDX Emerging Markets Series 40 20/12/2028	Morgan Stanley	USD	5.457.000	1,00	20-dic-2028	53.023
Compra	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 40 20/12/2028	Morgan Stanley	EUR	4.957.000	1,00	20-dic-2028	(104.482)
Compra	CDX North America High Yield Series 42 20/06/2029	Morgan Stanley	USD	5.430.000	5,00	20-jun-2029	(17.821)
Compra	CDX North America Investment Grade Series 42 20/06/2029	Morgan Stanley	USD	13.470.000	1,00	20-jun-2029	(6.976)
						USD	(76.256)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de incumplimiento crediticio

Los swaps de incumplimiento crediticio permiten transmitir el riesgo de incumplimiento. Esto permite al subfondo adquirir en la práctica un seguro para una obligación de referencia que posee (cubrir la inversión) o comprar protección para una obligación de referencia que no posee físicamente en previsión de que se produzca un deterioro de la calidad del crédito. Una de las partes, el comprador de protección, realiza pagos periódicos al vendedor de la protección, que a su vez debe realizar un pago al comprador si se produce un acontecimiento de crédito (una reducción de la calidad crediticia, que se definirá previamente en el acuerdo firmado por ambas partes). Si el acontecimiento de crédito no se produce, el comprador paga todas las primas fijadas y el swap se resuelve al vencimiento sin que se realicen nuevos pagos. Por lo tanto, el riesgo del comprador queda limitado al valor de las primas pagadas. Además, si se produce un acontecimiento de crédito y el subfondo no posee la obligación de referencia subyacente, se puede producir un riesgo de mercado, ya que el subfondo puede tardar un tiempo en obtener la obligación de referencia y entregarla a la contraparte. Asimismo, si la contraparte se declara en suspensión de pagos, es posible que el subfondo no pueda recuperar todo el dinero que esta le adeude. En ocasiones, el mercado de los swaps de incumplimiento crediticio es menos líquido que los mercados de renta fija. La Sociedad reducirá este riesgo controlando de una forma adecuada el uso de este tipo de transacción.

Los swaps de incumplimiento crediticio se valoraron a su valor intrínseco. El método de valoración empleado implica el uso del valor actual de la serie de tipos de interés y el valor actual del diferencial de crédito negociado en el mercado en la fecha de cierre. El resultado de estos reajustes, junto con todos los intereses por cobrar/pagar en relación con los swaps de incumplimiento crediticio, se indica en el Balance, en el epígrafe «Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos de swaps de incumplimiento crediticio».

A 31 de marzo de 2024, el siguiente subfondo estaba comprometido con acuerdos de swaps de incumplimiento crediticio:

Posición de protección	País de riesgo	Industria	Contraparte	Divisa	Cantidad nominal	Fecha de vencimiento	Plusvalía/(minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Compra	Estados Unidos	Soberanía	Barclays Bank	EUR	1.280.000	20-jun-2024	(20.506)
							USD
							(20.506)

Contratos de swaps de divisas cruzadas

Los swaps de divisas cruzadas se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo. La plusvalía/(minusvalía) latente se muestra en el Balance en el epígrafe «Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos de swaps de divisas cruzadas». Un swap de divisas cruzadas es un contrato en virtud del cual dos partes se comprometen durante un periodo determinado a canjear pagos de intereses denominados en dos divisas diferentes.

A 31 de marzo de 2024, el siguiente subfondo tenía establecido contratos de swaps de divisas cruzadas:

Contraparte	Divisa de pago	Nominal	Divisa de recepción	Nominal	Vencimiento	Tipo de pago	Tipo de recepción	Plusvalía/(minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa								
Bank of America	USD	12.819.870	AUD	19.380.000	18-sep-2029	USD SOFR a 1 día	AUD BBR a 3 meses	5921
Morgan Stanley	USD	12.860.855	CAD	17.321.000	18-sep-2029	USD SOFR a 1 día	CAD CORRA OIS a 1 día	8836
Morgan Stanley	USD	12.786.466	NOK	133.593.000	18-sep-2029	USD SOFR a 1 día	NOK NIBOR a 3 meses	1705
Morgan Stanley	USD	12.541.274	NZD	20.346.000	18-sep-2029	USD SOFR a 1 día	NZD BBR a 3 meses	564
Morgan Stanley	USD	12.646.462	SEK	129.109.000	18-sep-2029	USD SOFR a 1 día	SEK STIBOR a 3 meses	554
							USD	17.580

Contratos de swaps de tasas de inflación

Los swaps de tasas de inflación permiten transmitir el riesgo de inflación. Una parte del contrato trata de reducir su riesgo (mediante cobertura), mientras que la otra aumenta la exposición al riesgo (mediante especulación). La parte que busca cubrir su riesgo de inflación paga el tipo variable vinculado a un índice de inflación mientras recibe flujos de efectivo fijos. Al permutar variable por fijo, se reduce la exposición de la parte que realiza la cobertura al riesgo de inflación y aumenta su certeza sobre los futuros flujos de efectivo. Los swaps de tasas de inflación se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo. La plusvalía/(minusvalía) latente se muestra en el Balance en el epígrafe «Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos de swaps de tasas de inflación».

A 31 de marzo de 2024, el siguiente subfondo estaba comprometido con acuerdos de swaps sobre tasas de inflación:

Cantidad nominal	Divisa	Contraparte	Descripción de los valores	Fecha de vencimiento	Plusvalía/(minusvalía) latente	
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
3.785.000	EUR	J.P. Morgan	Paga tipo fijo 2,45%, Recibe tipo variable HICPX a 10 años	15-feb-2033	(98.146)	
3.785.000	EUR	J.P. Morgan	Recibe tipo fijo 2,48%, Paga tipo variable HICPX a 5 años	15-feb-2028	64.484	
6.809.000	USD	J.P. Morgan	Paga tipo fijo 2,49%, Recibe tipo variable HICPX a 5 años	15-sep-2028	159.893	
7.072.000	USD	J.P. Morgan	Paga tipo fijo 2,63%, Recibe tipo variable HICPX a 10 años	15-sep-2033	(296.334)	
263.000	USD	J.P. Morgan	Recibe tipo fijo 2,60%, Paga tipo variable HICPX a 5 años	15-sep-2028	(6.046)	
6.463.000	EUR	Morgan Stanley	Paga tipo fijo 2,40%, Recibe tipo variable HICPX a 10 años	15-feb-2033	(130.603)	
6.463.000	EUR	Morgan Stanley	Recibe tipo fijo 2,40%, Paga tipo variable HICPX a 5 años	15-feb-2028	84.035	
					USD	(222.717)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés

Con el propósito de ofrecer cobertura frente a las fluctuaciones de los tipos de interés, la Sociedad puede emplear swaps de tipos de interés, siempre que:

- los compromisos derivados de ellos no superen el valor de los correspondientes activos que se pretende proteger; y
- el importe total de dichas transacciones no supere el nivel necesario para cubrir el riesgo de fluctuación del valor de los activos en cuestión.

Dichos contratos deben estar denominados en las divisas de denominación de los activos de los subfondos (o en divisas que probablemente vayan a fluctuar de manera similar) y deben cotizar en una bolsa o negociarse en un Mercado regulado.

Los swaps de tipos de interés se valoraron al último precio disponible el Día de cálculo del Valor liquidativo a su valor intrínseco. El método de valoración empleado implica el uso de un valor actual para cada serie de tipo de interés y de capital convertida a la divisa del subfondo en la fecha de cierre. El resultado de estos reajustes, junto con todos los intereses por cobrar/pagar en relación con los swaps de tipos de interés, se indica en el Balance, en el epígrafe «Plusvalía/(minusvalía) latente neta sobre contratos de swaps de tipos de interés».

A 31 de marzo de 2024, los siguientes subfondos estaban comprometidos con acuerdos de swaps sobre tipos de interés:

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend					
Recibe tipo fijo al 9,94%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	J. P. Morgan	21.489.377	BRL	04-ene-2027	(23.963)
Recibe tipo fijo al 9,51%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	J. P. Morgan	58.510.623	BRL	04-ene-2027	(153.458)
Paga tipo fijo al 9,57%					
Recibe tipo variable BRL CDI a 1 día	J. P. Morgan	14.881.278	BRL	02-ene-2026	8329
Recibe tipo fijo al 9,20%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	J. P. Morgan	104.881.278	BRL	02-ene-2026	(126.199)
Recibe tipo fijo al 2,48%					
Paga tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J. P. Morgan	20.000.000	SEK	19-jun-2034	(21.907)
Paga tipo fijo al 9,80%					
Recibe tipo variable BRL CDI a 1 día	J. P. Morgan	90.000.000	BRL	02-ene-2026	14.860
Paga tipo fijo al 10,21%					
Recibe tipo variable BRL CDI a 1 día	J. P. Morgan	40.000.000	BRL	04-ene-2027	7636
Paga tipo fijo al 3,85%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	J. P. Morgan	1.000.000	USD	20-jun-2044	(10.363)
Paga tipo fijo al 9,06%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	J. P. Morgan	170.000.000	MXN	17-jun-2026	67.098
Paga tipo fijo al 8,57%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	J. P. Morgan	50.000.000	MXN	07-jun-2034	19.284
Recibe tipo fijo al 8,22%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	J. P. Morgan	50.000.000	MXN	07-jun-2034	(89.865)
Paga tipo fijo al 9,37%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	J. P. Morgan	170.000.000	MXN	17-jun-2026	11.442
Paga tipo fijo al 8,50%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	J. P. Morgan	152.490.975	MXN	13-jun-2029	72.002
Recibe tipo fijo al 8,08%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	J. P. Morgan	72.490.975	MXN	13-jun-2029	(106.184)
Recibe tipo fijo al 2,40%					
Paga tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J. P. Morgan	20.000.000	SEK	19-jun-2034	(33.958)
Paga tipo fijo al 8,69%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	J. P. Morgan	80.000.000	MXN	13-jun-2029	602
Paga tipo fijo al 8,66%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	J. P. Morgan	25.000.000	MXN	07-jun-2034	878
Paga tipo fijo al 8,69%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	J. P. Morgan	25.000.000	MXN	07-jun-2034	(2.110)
Recibe tipo fijo al 4,38%					
Paga tipo variable NZD BBR a 3 meses	J. P. Morgan	3.000.000	NZD	19-jun-2034	6240

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend (continuación)					
Paga tipo fijo al 8,05%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	J. P. Morgan	150.000.000	ZAR	19-jun-2026	10.270
Paga tipo fijo al 8,61%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	J. P. Morgan	70.000.000	ZAR	19-jun-2029	9171
Recibe tipo fijo al 4,24%					
Paga tipo variable NZD BBR a 3 meses	J. P. Morgan	6.000.000	NZD	19-jun-2029	2437
Recibe tipo fijo al 2,03%					
Paga tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J. P. Morgan	45.461.307	SEK	19-jun-2029	(120.962)
Paga tipo fijo al 4,00%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	J. P. Morgan	40.000.000	USD	20-jun-2028	(45.534)
Recibe tipo fijo al 9,21%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	J. P. Morgan	69.680.350	ZAR	19-jun-2034	(154.941)
Paga tipo fijo al 4,00%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	J. P. Morgan	12.000.000	USD	20-jun-2028	(13.661)
Paga tipo fijo al 9,82%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	J. P. Morgan	69.680.350	ZAR	19-jun-2034	10.633
Paga tipo fijo al 8,14%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	J. P. Morgan	624.686.131	ZAR	19-jun-2026	(10.775)
Paga tipo fijo al 4,07%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	J. P. Morgan	10.000.000	USD	20-jun-2044	(407.641)
Paga tipo fijo al 2,83%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J. P. Morgan	9.461.307	SEK	19-jun-2029	(7.099)
Recibe tipo fijo al 7,11%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	J. P. Morgan	24.686.131	ZAR	19-jun-2026	(23.545)
Recibe tipo fijo al 1,20%					
Paga tipo variable CHF SARON a 1 día	J. P. Morgan	3.200.000	CHF	19-jun-2034	18.072
Recibe tipo fijo al 1,20%					
Paga tipo variable CHF SARON a 1 día	J. P. Morgan	14.400.000	CHF	19-jun-2034	81.328
Recibe tipo fijo al 7,99%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	J. P. Morgan	137.968.104	ZAR	19-jun-2029	(197.808)
Paga tipo fijo al 8,74%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	J. P. Morgan	67.968.104	ZAR	19-jun-2029	(9.251)
Paga tipo fijo al 2,96%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	J. P. Morgan	24.000.000	EUR	19-jun-2026	5684
Paga tipo fijo al 2,96%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	J. P. Morgan	32.000.000	EUR	19-jun-2026	7578
Paga tipo fijo al 1,72%					
Recibe tipo variable JPY TONA a 1 día	J. P. Morgan	805.854.899	JPY	19-jun-2044	(347.766)
Recibe tipo fijo al 1,21%					
Paga tipo variable JPY TONA a 1 día	J. P. Morgan	325.854.899	JPY	19-jun-2044	(53.885)
Paga tipo fijo al 3,98%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	J. P. Morgan	8.000.000	USD	20-jun-2031	(74.845)
Paga tipo fijo al 3,98%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	J. P. Morgan	20.000.000	USD	20-jun-2031	(187.115)
Paga tipo fijo al 4,22%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	J. P. Morgan	48.000.000	USD	20-jun-2026	119.322
Recibe tipo fijo al 1,05%					
Paga tipo variable CHF SARON a 1 día	J. P. Morgan	7.000.000	CHF	19-jun-2029	6508

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA BlueTrend (continuación)					
Recibe tipo fijo al 1,05%					
Paga tipo variable CHF SARON a 1 día	J. P. Morgan	14.000.000	CHF	19-jun-2029	13.015
Paga tipo fijo al 3,97%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	J. P. Morgan	9.000.000	USD	20-jun-2049	(418.425)
Paga tipo fijo al 4,22%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	J. P. Morgan	56.000.000	USD	20-jun-2026	139.210
Paga tipo fijo al 3,23%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	J. P. Morgan	430.000.000	SEK	19-jun-2026	(144.284)
				USD	(2.153.945)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Recibe tipo fijo al 11,12%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	6.608.245	BRL	02-ene-2026	14.977
Recibe tipo fijo al 4,02%					
Paga tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	37.949.000	CZK	14-dic-2033	16.744
Recibe tipo fijo al 10,36%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	3.657.155	BRL	01-jul-2026	(6.122)
Paga tipo fijo al 8,45%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	67.600.000	MXN	19-jul-2028	70.465
Recibe tipo fijo al 3,22%					
Paga tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	6.970.000	USD	20-dic-2033	12.452
Recibe tipo fijo al 11,32%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	290.430.000	MXN	01-may-2024	522
Paga tipo fijo al 3,82%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	22.167.000	PLN	19-mar-2026	51.064
Recibe tipo fijo al 9,22%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	3.279.830.000	COP	20-dic-2033	32.918
Recibe tipo fijo al 6,85%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.864.615.000	HUF	19-mar-2026	54.005
Recibe tipo fijo al 10,54%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	4.655.493	BRL	02-ene-2029	(7.894)
Recibe tipo fijo al 10,33%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	4.624.691	BRL	02-ene-2029	(17.614)
Recibe tipo fijo al 8,78%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	16.155.000	MXN	21-nov-2033	1714
Paga tipo fijo al 8,79%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	92.095.000	MXN	27-nov-2028	20.346
Recibe tipo fijo al 5,86%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.872.496.000	HUF	19-jun-2026	(47.654)
Recibe tipo fijo al 10,48%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	5.214.556	BRL	02-ene-2029	(11.549)
Recibe tipo fijo al 9,93%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	25.679.110	BRL	02-ene-2026	(18.474)
Recibe tipo fijo al 3,64%					
Paga tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	Bank of America	5.527.000	MYR	20-jun-2029	(1.828)
Paga tipo fijo al 7,17%					
Recibe tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	1.713.496.000	COP	17-jun-2029	1026
Paga tipo fijo al 4,84%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	952.869.000	CLP	21-jun-2034	26.780

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 7,65%					
Recibe tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	8.501.694.000	COP	20-jun-2026	725
Paga tipo fijo al 7,64%					
Recibe tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	8.388.514.000	COP	20-jun-2026	1115
Paga tipo fijo al 7,49%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	55.271.000	ZAR	18-jun-2026	11.270
Paga tipo fijo al 7,50%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	78.719.000	ZAR	18-jun-2026	16.622
Paga tipo fijo al 7,74%					
Recibe tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	20.684.015.000	COP	20-jun-2026	(7.303)
Paga tipo fijo al 7,76%					
Recibe tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	8.380.882.000	COP	20-jun-2026	(3.482)
Recibe tipo fijo al 10,21%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	3.482.262	BRL	02-ene-2029	(16.733)
Recibe tipo fijo al 10,22%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	3.479.662	BRL	02-ene-2029	(16.296)
Recibe tipo fijo al 10,04%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	4.128.609	BRL	02-ene-2029	(26.698)
Paga tipo fijo al 3,45%					
Recibe tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	Bank of America	6.876.000	MYR	20-jun-2026	2826
Paga tipo fijo al 3,86%					
Recibe tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	9.667.000	MYR	18-mar-2029	(7.159)
Recibe tipo fijo al 4,55%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	1.345.490.000	CLP	17-jun-2029	(14.810)
Recibe tipo fijo al 4,39%					
Paga tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	1.130.000	USD	21-ene-2025	(3.081)
Paga tipo fijo al 3,53%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	885.000	USD	25-ene-2030	6975
Recibe tipo fijo al 10,01%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	1.013.397	BRL	02-ene-2029	(6.281)
Recibe tipo fijo al 10,08%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	929.192	BRL	02-ene-2029	(5.090)
Paga tipo fijo al 8,36%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	16.390.000	ZAR	19-jun-2029	10.509
Paga tipo fijo al 3,36%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	1.671.339.000	KRW	20-jun-2034	(13.850)
Recibe tipo fijo al 4,66%					
Paga tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	6.425.000	USD	24-feb-2025	(5.938)
Recibe tipo fijo al 7,47%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	3.753.435.000	COP	20-jun-2034	(6.423)
Paga tipo fijo al 7,50%					
Recibe tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	19.622.717.000	COP	20-jun-2026	15.695
Recibe tipo fijo al 7,62%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	11.748.375.000	COP	20-jun-2026	(2.631)
Paga tipo fijo al 2,98%					
Recibe tipo variable SGD SORA a 1 día	Morgan Stanley	662.000	SGD	19-jun-2034	(1.610)
Paga tipo fijo al 3,00%					
Recibe tipo variable SGD SORA a 1 día	Morgan Stanley	972.000	SGD	19-jun-2034	(3.765)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Recibe tipo fijo al 3,03%					
Paga tipo variable SGD SORA a 1 día	Morgan Stanley	2.665.000	SGD	19-jun-2026	(817)
Recibe tipo fijo al 7,47%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	554.763.000	COP	20-jun-2034	(959)
Recibe tipo fijo al 8,07%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	2.719.488.000	COP	20-jun-2034	840
Paga tipo fijo al 8,05%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	9.028.000	ZAR	19-jun-2025	725
Paga tipo fijo al 3,64%					
Recibe tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	Standard Chartered Bank	4.915.000	MYR	20-jun-2026	(1.595)
Paga tipo fijo al 5,54%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.057.445.000	HUF	19-jun-2026	41.565
Recibe tipo fijo al 9,67%					
Paga tipo variable BRL CDI a 1 día	Morgan Stanley	14.940.192	BRL	02-ene-2026	(12.855)
Paga tipo fijo al 7,03%					
Recibe tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	10.787.900.000	COP	20-jun-2029	25.410
Recibe tipo fijo al 5,59%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	102.905.000	PLN	19-jun-2025	(8.827)
Recibe tipo fijo al 7,36%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	4.794.425.000	COP	20-jun-2034	(17.375)
Recibe tipo fijo al 7,39%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	23.930.250.000	COP	20-jun-2026	(31.391)
Recibe tipo fijo al 7,44%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	1.063.385.000	COP	20-jun-2034	(2.350)
Paga tipo fijo al 3,36%					
Recibe tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	58.931.000	CZK	18-sep-2034	55.133
Recibe tipo fijo al 3,72%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	12.911.000	ILS	18-sep-2029	(22.542)
Recibe tipo fijo al 4,74%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.516.000	PLN	18-sep-2029	(988)
Paga tipo fijo al 2,22%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	8.220.000	EUR	17-sep-2026	(4.714)
Paga tipo fijo al 3,31%					
Recibe tipo variable CAD BA a 6 meses	Morgan Stanley	12.148.000	CAD	18-sep-2029	(27.105)
Recibe tipo fijo al 2,87%					
Paga tipo variable SGD SORA a 1 día	Morgan Stanley	477.000	SGD	19-jun-2029	(1.437)
Paga tipo fijo al 3,24%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	1.994.022.000	KRW	20-jun-2034	345
Recibe tipo fijo al 7,93%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	3.401.850.000	COP	19-sep-2034	(8.265)
Recibe tipo fijo al 9,03%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	49.365.000	MXN	16-sep-2026	(2.188)
Paga tipo fijo al 7,32%					
Recibe tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	10.207.100.000	COP	20-jun-2029	(8.315)
Recibe tipo fijo al 7,67%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	3.091.455.000	COP	20-jun-2034	6065
Recibe tipo fijo al 7,74%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	11.230.285.000	COP	20-jun-2026	4019

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 3,29%					
Recibe tipo variable SGD SORA a 1 día	Morgan Stanley	5.537.000	SGD	19-jun-2025	(869)
Recibe tipo fijo al 7,75%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	2.736.876.000	COP	20-jun-2034	9039
Recibe tipo fijo al 8,21%					
Paga tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	5.456.049.000	COP	20-jun-2034	7089
Paga tipo fijo al 9,33%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	15.290.000	MXN	24-feb-2028	(10.191)
Recibe tipo fijo al 8,32%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	9.385.000	MXN	30-mar-2033	(15.152)
Paga tipo fijo al 8,76%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	39.665.000	MXN	11-abr-2028	17.299
Recibe tipo fijo al 2,72%					
Paga tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	30.828.000	SEK	17-dic-2028	(12.536)
Paga tipo fijo al 8,45%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	36.765.000	MXN	14-jun-2028	38.239
Recibe tipo fijo al 8,23%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	20.005.000	MXN	13-jul-2033	(40.056)
Recibe tipo fijo al 11,30%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	404.630.000	MXN	26-abr-2024	837
Paga tipo fijo al 3,94%					
Recibe tipo variable NOK NIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	69.016.000	NOK	18-mar-2029	(76.063)
Recibe tipo fijo al 9,02%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	2.680.000	MXN	26-ago-2033	2848
Recibe tipo fijo al 3,81%					
Paga tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	3.833.000	USD	19-mar-2026	5660
Paga tipo fijo al 1,31%					
Recibe tipo variable JPY TONA a 1 día	Morgan Stanley	37.478.000	JPY	21-mar-2034	(1.838)
Recibe tipo fijo al 3,63%					
Paga tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	608.979.000	KRW	18-mar-2029	5752
Paga tipo fijo al 3,09%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.973.000	EUR	21-mar-2034	(17.092)
Recibe tipo fijo al 4,04%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	6.695.000	ILS	21-mar-2034	(24.330)
Recibe tipo fijo al 5,32%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.068.000	PLN	21-mar-2034	5134
Recibe tipo fijo al 9,27%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	20.915.000	MXN	31-ago-2033	42.887
Paga tipo fijo al 9,38%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	52.500.000	MXN	06-sep-2028	(54.981)
Recibe tipo fijo al 9,02%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	20.725.000	MXN	01-sep-2033	21.785
Recibe tipo fijo al 4,63%					
Paga tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	1.471.000	NZD	20-dic-2033	20.038
Recibe tipo fijo al 9,60%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	42.185.000	MXN	16-sep-2033	140.314
Recibe tipo fijo al 5,61%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	7.706.000	PLN	20-dic-2033	40.384

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 4,01%					
Recibe tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	1.874.000	ILS	18-mar-2029	(1.692)
Recibe tipo fijo al 9,43%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	17.665.000	MXN	03-oct-2033	47.165
Paga tipo fijo al 11,76%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	7.843.000	ZAR	21-mar-2034	(335)
Recibe tipo fijo al 3,26%					
Paga tipo variable SGD SORA a 1 día	Morgan Stanley	2.431.000	SGD	18-mar-2029	19.318
Recibe tipo fijo al 9,31%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	8.700.000	MXN	24-oct-2033	19.443
Recibe tipo fijo al 9,55%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	14.340.000	MXN	10-nov-2026	2858
Paga tipo fijo al 9,97%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	7.245.000	MXN	12-nov-2025	623
Recibe tipo fijo al 9,41%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	43.390.000	MXN	11-nov-2026	(134)
Recibe tipo fijo al 11,00%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	124.850.000	MXN	13-nov-2024	1029
Paga tipo fijo al 9,98%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	20.071.500	MXN	13-nov-2025	1496
Recibe tipo fijo al 9,40%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	13.832.000	MXN	12-nov-2026	(82)
Recibe tipo fijo al 8,79%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	10.080.000	MXN	08-nov-2030	839
Paga tipo fijo al 9,83%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	117.055.000	MXN	27-nov-2025	22.270
Recibe tipo fijo al 10,88%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	95.505.000	MXN	28-nov-2024	(3.071)
Recibe tipo fijo al 9,24%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	40.220.000	MXN	26-nov-2026	(8.940)
Recibe tipo fijo al 3,67%					
Paga tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	40.444.000	CZK	19-jun-2029	8788
Paga tipo fijo al 3,81%					
Recibe tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	18.057.000	CZK	19-jun-2034	(9.788)
Recibe tipo fijo al 3,38%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	2.209.000	ILS	19-jun-2029	(12.886)
Paga tipo fijo al 3,53%					
Recibe tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	3.714.000	ILS	17-jun-2029	10.498
Paga tipo fijo al 3,06%					
Recibe tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	32.370.000	ILS	19-mar-2026	46.248
Recibe tipo fijo al 3,31%					
Paga tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	6.062.906.000	KRW	20-jun-2026	845
Recibe tipo fijo al 3,29%					
Paga tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	983.306.000	KRW	20-jun-2029	2598
Paga tipo fijo al 3,34%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	5.198.931.000	KRW	20-jun-2034	(38.195)
Paga tipo fijo al 6,40%					
Recibe tipo variable INR MIBOR a 1 día	Morgan Stanley	382.340.000	INR	20-jun-2026	(255)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 6,41%					
Recibe tipo variable INR MIBOR a 1 día	Morgan Stanley	475.699.000	INR	17-jun-2029	(15.597)
Recibe tipo fijo al 6,41%					
Paga tipo variable INR MIBOR a 1 día	Morgan Stanley	407.503.000	INR	20-jun-2029	16.928
Recibe tipo fijo al 2,64%					
Paga tipo variable CNY REPO RATE a 7 días	Morgan Stanley	9.947.000	CNY	17-jun-2029	(3.367)
Recibe tipo fijo al 4,40%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	7.956.185.000	CLP	19-mar-2026	(43.560)
Recibe tipo fijo al 4,60%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	1.025.289.000	CLP	17-jun-2029	(9.929)
Recibe tipo fijo al 3,47%					
Paga tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	7.984.000	USD	17-jun-2029	(33.727)
Recibe tipo fijo al 4,66%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	262.358.000	CLP	21-jun-2029	(5.497)
Recibe tipo fijo al 2,69%					
Paga tipo variable SGD SORA a 1 día	Morgan Stanley	1.895.000	SGD	19-jun-2026	(10.069)
Recibe tipo fijo al 8,48%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	70.738.000	MXN	07-jun-2034	(53.892)
Paga tipo fijo al 9,70%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	217.508.000	MXN	18-jun-2025	67.271
Recibe tipo fijo al 9,13%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	400.391.000	MXN	17-jun-2026	(138.523)
Recibe tipo fijo al 2,47%					
Paga tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	31.539.760	SEK	19-jun-2029	(8.014)
Paga tipo fijo al 2,59%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.936.000	EUR	19-jun-2034	(42.459)
Recibe tipo fijo al 2,50%					
Paga tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	9.555.000	EUR	19-jun-2029	(24.008)
Recibe tipo fijo al 4,22%					
Paga tipo variable GBP SONIA a 1 día	Morgan Stanley	4.271.000	GBP	19-jun-2026	1527
Paga tipo fijo al 2,72%					
Recibe tipo variable SGD SORA a 1 día	Morgan Stanley	400.000	SGD	19-jun-2034	6388
Paga tipo fijo al 4,41%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	10.255.000	PLN	19-jun-2034	105.085
Recibe tipo fijo al 4,22%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.630.000	PLN	19-jun-2026	(7.662)
Recibe tipo fijo al 4,11%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	5.571.000	PLN	19-jun-2029	(44.821)
Recibe tipo fijo al 9,38%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	82.784.000	ZAR	19-jun-2034	(134.840)
Recibe tipo fijo al 9,35%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	95.342.000	ZAR	19-jun-2034	(166.188)
Paga tipo fijo al 7,60%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	9.875.000	ZAR	19-jun-2026	4864
Paga tipo fijo al 8,22%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	95.790.000	ZAR	19-jun-2029	91.098
Recibe tipo fijo al 9,31%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	106.476.000	ZAR	19-jun-2034	(199.370)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 4,84%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	5.580.000	NZD	19-jun-2026	(9.575)
Recibe tipo fijo al 4,38%					
Paga tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	6.258.000	NZD	17-jun-2029	44.385
Recibe tipo fijo al 4,47%					
Paga tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	7.455.000	USD	20-dic-2024	(22.989)
Recibe tipo fijo al 8,51%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	7.605.000	MXN	08-dic-2033	(7.280)
Paga tipo fijo al 4,06%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	27.143.000	PLN	18-jun-2026	35.109
Paga tipo fijo al 4,09%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	12.087.000	PLN	18-jun-2026	14.762
Paga tipo fijo al 3,20%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	1.285.152.000	KRW	20-jun-2034	2322
Paga tipo fijo al 3,16%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	408.820.000	KRW	20-jun-2034	1752
Paga tipo fijo al 8,32%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	12.586.000	MXN	13-jun-2029	11.229
Recibe tipo fijo al 4,38%					
Paga tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	4.870.000	USD	10-ene-2025	(15.030)
Recibe tipo fijo al 3,02%					
Paga tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	1.286.189.000	KRW	20-jun-2029	(8.638)
Paga tipo fijo al 4,37%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	492.000	PLN	19-jun-2034	5367
Recibe tipo fijo al 4,20%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	5.793.000	PLN	19-jun-2029	(40.769)
Paga tipo fijo al 3,56%					
Recibe tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	5.771.000	ILS	17-jun-2029	15.310
Paga tipo fijo al 2,94%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	23.105.000	SEK	19-jun-2025	(2.172)
Recibe tipo fijo al 8,47%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	6.712.500	MXN	04-ene-2034	(7.549)
Paga tipo fijo al 4,53%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.670.000	PLN	19-jun-2034	21.304
Paga tipo fijo al 3,73%					
Recibe tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	5.348.000	ILS	17-jun-2029	7872
Paga tipo fijo al 6,17%					
Recibe tipo variable INR MIBOR a 1 día	Morgan Stanley	54.057.000	INR	20-jun-2026	2666
Paga tipo fijo al 8,14%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	116.133.000	MXN	17-jun-2026	23.279
Paga tipo fijo al 4,56%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.110.036	PLN	19-jun-2034	8175
Paga tipo fijo al 4,59%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.840.522	PLN	19-jun-2034	12.338
Recibe tipo fijo al 4,36%					
Paga tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	1.695.000	USD	21-ene-2025	(4.874)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Recibe tipo fijo al 9,12%					
Paga tipo variable MXN TIIIE a 28 días	Morgan Stanley	57.940.000	MXN	15-ene-2027	(18.177)
Paga tipo fijo al 3,28%					
Recibe tipo variable GBP SONIA a 1 día	Morgan Stanley	1.677.000	GBP	17-jun-2029	4011
Recibe tipo fijo al 4,34%					
Paga tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	2.820.000	USD	29-ene-2025	(8.320)
Paga tipo fijo al 4,09%					
Recibe tipo variable AUD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	6.124.000	AUD	19-jun-2025	(1.124)
Recibe tipo fijo al 2,86%					
Paga tipo variable SGD SORA a 1 día	Morgan Stanley	803.000	SGD	20-jun-2034	(2.600)
Recibe tipo fijo al 2,91%					
Paga tipo variable SGD SORA a 1 día	Morgan Stanley	580.000	SGD	20-jun-2034	(1.037)
Recibe tipo fijo al 5,02%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.465.000	PLN	20-jun-2034	(817)
Recibe tipo fijo al 4,36%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	248.283.000	CLP	21-jun-2029	(6.916)
Paga tipo fijo al 5,05%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	21.279.000	PLN	19-jun-2025	30.962
Paga tipo fijo al 5,07%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	31.918.000	PLN	19-jun-2025	44.731
Recibe tipo fijo al 3,21%					
Paga tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	34.152.000	CZK	17-jun-2029	(9.076)
Recibe tipo fijo al 3,46%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	8.979.000	ILS	19-jun-2025	(10.588)
Recibe tipo fijo al 5,35%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	231.805.000	CLP	21-jun-2034	127
Recibe tipo fijo al 8,57%					
Paga tipo variable MXN TIIIE a 28 días	Morgan Stanley	4.495.000	MXN	07-jun-2034	(1.814)
Recibe tipo fijo al 8,38%					
Paga tipo variable MXN TIIIE a 28 días	Morgan Stanley	8.992.000	MXN	07-jun-2034	(10.239)
Paga tipo fijo al 8,32%					
Recibe tipo variable MXN TIIIE a 28 días	Morgan Stanley	18.309.500	MXN	13-jun-2029	16.322
Paga tipo fijo al 8,55%					
Recibe tipo variable MXN TIIIE a 28 días	Morgan Stanley	9.154.500	MXN	13-jun-2029	3240
Paga tipo fijo al 8,52%					
Recibe tipo variable MXN TIIIE a 28 días	Morgan Stanley	7.324.000	MXN	13-jun-2029	3030
Recibe tipo fijo al 8,56%					
Paga tipo variable MXN TIIIE a 28 días	Morgan Stanley	3.597.000	MXN	07-jun-2034	(1.559)
Recibe tipo fijo al 3,26%					
Paga tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	18.873.000	CZK	19-jun-2029	(11.040)
Paga tipo fijo al 3,24%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	1.294.034.000	KRW	20-jun-2034	(1.153)
Paga tipo fijo al 2,47%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.170.000	EUR	17-jun-2029	(5.126)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 0,34%					
Recibe tipo variable JPY TONA a 1 día	Morgan Stanley	9.254.435.000	JPY	19-jun-2026	(10.407)
Paga tipo fijo al 3,94%					
Recibe tipo variable GBP SONIA a 1 día	Morgan Stanley	17.459.000	GBP	20-mar-2029	(181.344)
Recibe tipo fijo al 9,51%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	23.816.000	ZAR	19-jun-2034	(28.988)
Paga tipo fijo al 7,82%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	79.705.000	ZAR	19-jun-2026	23.068
Paga tipo fijo al 4,40%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	2.065.554.000	CLP	21-jun-2026	23.655
Recibe tipo fijo al 3,24%					
Paga tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	55.592.000	CZK	19-jun-2026	(22.043)
Paga tipo fijo al 8,28%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	14.131.080	ZAR	19-jun-2029	11.547
Paga tipo fijo al 8,34%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	16.754.000	ZAR	19-jun-2029	11.585
Paga tipo fijo al 8,31%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	16.731.000	ZAR	19-jun-2029	12.550
Paga tipo fijo al 3,35%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	2.170.819.000	KRW	20-jun-2034	(16.505)
Recibe tipo fijo al 3,32%					
Paga tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	2.035.368.000	KRW	20-jun-2029	6863
Recibe tipo fijo al 3,33%					
Paga tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	5.339.152.000	KRW	20-jun-2029	20.623
Paga tipo fijo al 8,32%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	13.307.920	ZAR	19-jun-2029	9759
Paga tipo fijo al 3,54%					
Recibe tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	Goldman Sachs	5.020.000	MYR	20-jun-2026	369
Paga tipo fijo al 7,83%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	38.178.000	ZAR	19-jun-2026	10.580
Paga tipo fijo al 4,96%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	22.800.000	PLN	19-jun-2026	30.308
Recibe tipo fijo al 5,37%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	44.080.000	PLN	19-jun-2025	(30.955)
Recibe tipo fijo al 9,66%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	49.506.000	ZAR	19-jun-2034	(34.471)
Paga tipo fijo al 8,51%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	80.864.000	ZAR	19-jun-2029	27.113
Paga tipo fijo al 8,02%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	65.137.000	ZAR	19-jun-2026	6171
Paga tipo fijo al 3,32%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	556.162.000	KRW	20-jun-2034	(3.252)
Recibe tipo fijo al 8,62%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	10.498.000	MXN	14-jun-2034	(419)
Recibe tipo fijo al 5,45%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	4.059.055.000	CLP	21-jun-2034	19.162
Recibe tipo fijo al 5,59%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.105.027.000	HUF	19-jun-2026	(48.103)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Recibe tipo fijo al 5,59%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	469.412.000	HUF	19-jun-2026	(20.434)
Paga tipo fijo al 7,95%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	82.754.000	ZAR	19-jun-2026	13.392
Paga tipo fijo al 3,62%					
Recibe tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	Goldman Sachs	2.629.000	MYR	20-jun-2026	(650)
Paga tipo fijo al 8,76%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	32.950.000	MXN	27-feb-2029	7576
Recibe tipo fijo al 2,69%					
Paga tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	71.251.000	SEK	18-jun-2026	1348
Paga tipo fijo al 8,05%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	9.105.000	ZAR	19-jun-2025	708
Paga tipo fijo al 8,07%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	10.849.000	ZAR	19-jun-2025	764
Recibe tipo fijo al 9,14%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	34.210.000	MXN	03-mar-2027	(7.287)
Paga tipo fijo al 4,66%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	2.156.350.000	CLP	21-jun-2029	31.289
Recibe tipo fijo al 2,97%					
Paga tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	8.960.000	EUR	19-jun-2026	5153
Paga tipo fijo al 2,63%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	7.335.000	EUR	19-jun-2029	(25.269)
Recibe tipo fijo al 2,59%					
Paga tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.675.000	EUR	19-jun-2031	14.010
Paga tipo fijo al 5,57%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	615.180.000	HUF	19-jun-2029	43.756
Recibe tipo fijo al 5,90%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	622.635.000	HUF	19-jun-2034	(66.818)
Recibe tipo fijo al 6,29%					
Paga tipo variable INR MIBOR a 1 día	Morgan Stanley	264.835.000	INR	20-jun-2026	(5.892)
Paga tipo fijo al 6,28%					
Recibe tipo variable INR MIBOR a 1 día	Morgan Stanley	220.050.000	INR	20-jun-2029	8752
Paga tipo fijo al 5,17%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	36.065.000	PLN	19-jun-2026	8960
Paga tipo fijo al 4,72%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	32.985.000	PLN	19-jun-2029	50.165
Recibe tipo fijo al 4,79%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	8.815.000	PLN	19-jun-2034	(27.620)
Recibe tipo fijo al 4,22%					
Paga tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	4.235.000	USD	20-jun-2026	(13.155)
Paga tipo fijo al 3,81%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	2.370.000	USD	20-jun-2029	13.497
Paga tipo fijo al 3,72%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	960.000	USD	20-jun-2034	7431
Recibe tipo fijo al 7,92%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	145.540.000	ZAR	19-jun-2026	(27.274)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 8,40%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	112.330.000	ZAR	19-jun-2029	65.924
Recibe tipo fijo al 8,92%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	13.915.000	ZAR	19-jun-2031	(12.471)
Recibe tipo fijo al 11,37%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	32.245.000	ZAR	20-jun-2034	(20.242)
Recibe tipo fijo al 3,60%					
Paga tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	J.P. Morgan	2.840.000	MYR	20-jun-2029	(2.083)
Paga tipo fijo al 1,95%					
Recibe tipo variable CNY REPO RATE a 7 días	Morgan Stanley	17.988.000	CNY	20-jun-2026	11.863
Paga tipo fijo al 9,74%					
Recibe tipo variable MXN TIIIE a 28 días	Morgan Stanley	146.150.000	MXN	11-mar-2026	12.475
Recibe tipo fijo al 10,69%					
Paga tipo variable MXN TIIIE a 28 días	Morgan Stanley	145.105.000	MXN	12-mar-2025	(897)
Recibe tipo fijo al 9,18%					
Paga tipo variable MXN TIIIE a 28 días	Morgan Stanley	50.135.000	MXN	10-mar-2027	(7.368)
Recibe tipo fijo al 6,34%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	516.886.000	HUF	20-jun-2034	(13.854)
Paga tipo fijo al 4,78%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	2.000.763.000	CLP	21-jun-2026	8478
Recibe tipo fijo al 3,00%					
Paga tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	62.957.000	CZK	18-sep-2026	(24.354)
Recibe tipo fijo al 3,01%					
Paga tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	9.642.000	CZK	18-sep-2029	(8.596)
Paga tipo fijo al 5,91%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	133.170.000	HUF	18-sep-2034	12.805
Recibe tipo fijo al 5,63%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	245.373.000	HUF	18-sep-2026	(7.672)
Paga tipo fijo al 5,43%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	25.873.000	PLN	18-sep-2025	(1.141)
Recibe tipo fijo al 5,11%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	78.656.000	PLN	18-sep-2026	13.462
Recibe tipo fijo al 5,60%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	443.064.000	HUF	18-sep-2029	(29.855)
Paga tipo fijo al 4,96%					
Recibe tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.584.000	PLN	18-sep-2034	(1.050)
Recibe tipo fijo al 4,25%					
Paga tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	9.147.000	AUD	18-sep-2034	36.563
Paga tipo fijo al 3,78%					
Recibe tipo variable AUD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	12.608.000	AUD	18-sep-2026	(6.229)
Paga tipo fijo al 3,84%					
Recibe tipo variable AUD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	7.646.000	AUD	16-sep-2029	(10.693)
Paga tipo fijo al 4,59%					
Recibe tipo variable AUD BBR a 6 meses	Morgan Stanley	7.560.000	AUD	19-sep-2034	(15.183)
Paga tipo fijo al 3,56%					
Recibe tipo variable GBP SONIA a 1 día	Morgan Stanley	2.300.000	GBP	18-sep-2034	(6.114)
Recibe tipo fijo al 3,69%					
Paga tipo variable GBP SONIA a 1 día	Morgan Stanley	812.000	GBP	17-sep-2026	779

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Recibe tipo fijo al 3,50%					
Paga tipo variable GBP SONIA a 1 día	Morgan Stanley	2.642.000	GBP	19-sep-2034	2272
Recibe tipo fijo al 3,47%					
Paga tipo variable NOK NIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	10.406.000	NOK	18-sep-2034	(7.018)
Recibe tipo fijo al 3,44%					
Paga tipo variable NOK NIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	10.592.000	NOK	17-sep-2026	552
Paga tipo fijo al 3,20%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	1.065.475.000	KRW	19-sep-2034	125
Recibe tipo fijo al 3,56%					
Paga tipo variable NOK NIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	50.628.000	NOK	18-sep-2029	(20.188)
Paga tipo fijo al 3,38%					
Recibe tipo variable NOK NIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	18.011.000	NOK	19-sep-2034	5213
Recibe tipo fijo al 3,11%					
Paga tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	6.980.023.000	KRW	17-sep-2026	(1.176)
Recibe tipo fijo al 3,22%					
Paga tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	5.655.472.000	KRW	19-sep-2026	(2.499)
Paga tipo fijo al 3,76%					
Recibe tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	Standard Chartered Bank	1.065.000	MYR	17-sep-2029	201
Recibe tipo fijo al 3,65%					
Paga tipo variable MYR KLIBOR a 3 meses	Standard Chartered Bank	14.308.000	MYR	18-sep-2029	(5.340)
Paga tipo fijo al 4,19%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	15.127.000	NZD	18-sep-2029	(27.413)
Paga tipo fijo al 7,85%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	211.371.000	ZAR	18-sep-2026	47.581
Paga tipo fijo al 2,44%					
Recibe tipo variable SEK STIBOR a 3 meses	Morgan Stanley	54.877.000	SEK	18-sep-2034	27.453
Recibe tipo fijo al 3,54%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	11.464.000	ILS	18-sep-2026	(9.437)
Recibe tipo fijo al 0,94%					
Paga tipo variable JPY TONA a 1 día	Morgan Stanley	31.906.000	JPY	18-sep-2034	1055
Paga tipo fijo al 2,92%					
Recibe tipo variable SGD SORA a 1 día	Morgan Stanley	3.846.000	SGD	18-sep-2034	9261
Recibe tipo fijo al 2,94%					
Paga tipo variable SGD SORA a 1 día	Morgan Stanley	15.361.000	SGD	18-sep-2026	(9.140)
Recibe tipo fijo al 2,83%					
Paga tipo variable SGD SORA a 1 día	Morgan Stanley	1.231.000	SGD	16-sep-2029	(1.580)
Paga tipo fijo al 3,32%					
Recibe tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	61.255.000	CZK	19-jun-2026	20.294
Recibe tipo fijo al 4,88%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	38.260.000	CLP	16-sep-2029	(93)
Recibe tipo fijo al 4,80%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	6.305.227.000	CLP	23-sep-2029	(46.412)
Recibe tipo fijo al 5,36%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	253.841.000	CLP	20-sep-2034	557
Paga tipo fijo al 5,07%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	3.828.674.000	CLP	23-sep-2034	24.698

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Recibe tipo fijo al 6,28%					
Paga tipo variable INR MIBOR a 1 día	Morgan Stanley	115.954.000	INR	18-sep-2029	(3.151)
Paga tipo fijo al 9,47%					
Recibe tipo variable COP IBR a 1 día	Morgan Stanley	10.660.413.000	COP	20-jun-2025	(18.131)
Paga tipo fijo al 10,22%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	62.932.000	MXN	18-jun-2025	716
Paga tipo fijo al 8,45%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	207.119.000	MXN	12-sep-2029	44.680
Recibe tipo fijo al 8,51%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	59.751.000	MXN	06-sep-2034	(19.307)
Paga tipo fijo al 4,13%					
Recibe tipo variable CAD CORRA a 1 día	Morgan Stanley	6.014.000	CAD	18-sep-2025	(1.892)
Paga tipo fijo al 3,00%					
Recibe tipo variable CAD CORRA a 1 día	Morgan Stanley	2.678.000	CAD	16-sep-2029	(3.956)
Paga tipo fijo al 3,41%					
Recibe tipo variable CAD CORRA a 1 día	Morgan Stanley	2.054.000	CAD	19-sep-2034	(3.159)
Recibe tipo fijo al 3,34%					
Paga tipo variable CAD CORRA a 1 día	Morgan Stanley	6.434.000	CAD	18-sep-2034	29.010
Paga tipo fijo al 2,75%					
Recibe tipo variable EUR EURIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.020.000	EUR	18-sep-2026	(1.323)
Recibe tipo fijo al 5,07%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.222.000	PLN	20-jun-2034	184
Paga tipo fijo al 4,19%					
Recibe tipo variable NZD BBR a 3 meses	Morgan Stanley	11.976.000	NZD	17-sep-2026	(8.879)
Paga tipo fijo al 8,36%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	281.032.000	MXN	16-sep-2026	(5.173)
Paga tipo fijo al 3,81%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	2.610.000	USD	18-sep-2034	(19.121)
Recibe tipo fijo al 4,53%					
Paga tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	4.191.000	USD	18-sep-2025	518
Paga tipo fijo al 4,22%					
Recibe tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	22.454.000	USD	18-sep-2026	(30.694)
Recibe tipo fijo al 3,91%					
Paga tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	6.554.000	USD	18-sep-2029	26.981
Paga tipo fijo al 8,01%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	21.677.000	ZAR	19-jun-2026	2279
Recibe tipo fijo al 4,75%					
Paga tipo variable USD SOFR a 1 día	Morgan Stanley	5.545.000	USD	20-mar-2025	92
Paga tipo fijo al 6,08%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	1.032.510.000	HUF	19-jun-2026	20.017
Paga tipo fijo al 8,64%					
Recibe tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	47.630.000	ZAR	19-jun-2029	3297
Recibe tipo fijo al 8,08%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	53.240.000	ZAR	19-jun-2026	(2.075)
Recibe tipo fijo al 9,78%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	2.655.000	ZAR	19-jun-2034	(778)

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Paga tipo fijo al 6,62%					
Recibe tipo variable HUF BUBOR a 3 meses	Morgan Stanley	1.834.690.000	HUF	19-jun-2025	(789)
Recibe tipo fijo al 6,58%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	579.465.000	HUF	20-jun-2034	(3.481)
Recibe tipo fijo al 3,38%					
Paga tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	51.770.000	CZK	19-jun-2029	(18.127)
Paga tipo fijo al 3,52%					
Recibe tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	124.370.000	CZK	19-jun-2026	20.418
Recibe tipo fijo al 6,23%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	247.035.000	HUF	19-jun-2034	(10.078)
Recibe tipo fijo al 8,07%					
Paga tipo variable ZAR JIBAR a 3 meses	Morgan Stanley	52.775.000	ZAR	19-jun-2026	(2.805)
Recibe tipo fijo al 4,84%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	1.312.460.000	CLP	21-jun-2027	(4.443)
Recibe tipo fijo al 4,87%					
Paga tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	1.312.465.000	CLP	21-jun-2027	(3.431)
Recibe tipo fijo al 3,76%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	15.126.000	ILS	19-jun-2026	(1.104)
Paga tipo fijo al 3,87%					
Recibe tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	20.748.000	ILS	19-jun-2025	2360
Paga tipo fijo al 3,89%					
Recibe tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	20.816.000	ILS	19-jun-2025	1291
Recibe tipo fijo al 3,76%					
Paga tipo variable ILS TELBOR a 3 meses	Morgan Stanley	15.169.000	ILS	19-jun-2026	(1.300)
Paga tipo fijo al 6,44%					
Recibe tipo variable INR MIBOR a 1 día	Morgan Stanley	97.573.000	INR	20-jun-2026	(1.055)
Paga tipo fijo al 3,26%					
Recibe tipo variable KRW CD a 3 meses	Morgan Stanley	2.467.277.000	KRW	20-jun-2034	(1.627)
Paga tipo fijo al 4,92%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	2.621.975.000	CLP	21-jun-2031	14.306
Paga tipo fijo al 4,94%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	310.095.000	CLP	21-jun-2031	1393
Paga tipo fijo al 3,60%					
Recibe tipo variable CZK PRIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	62.535.000	CZK	19-jun-2026	6290
Paga tipo fijo al 9,80%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	145.240.000	MXN	25-mar-2026	(1.605)
Recibe tipo fijo al 10,65%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	144.570.000	MXN	26-mar-2025	(577)
Recibe tipo fijo al 9,27%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	49.795.000	MXN	24-mar-2027	1234
Paga tipo fijo al 4,96%					
Recibe tipo variable CLP ICP a 1 día	Morgan Stanley	2.919.325.000	CLP	21-jun-2026	1904
Recibe tipo fijo al 5,00%					
Paga tipo variable PLN WIBOR a 6 meses	Morgan Stanley	2.455.000	PLN	19-jun-2034	2334

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Contratos de swaps de tipos de interés (continuación)

Descripción	Contraparte	Nominal	Divisa	Fecha de vencimiento	Plusvalía/ (minusvalía) latente
Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)					
Recibe tipo fijo al 6,54%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	128.778.120	HUF	19-jun-2034	2545
Recibe tipo fijo al 6,54%					
Paga tipo variable HUF BUBOR a 6 meses	Morgan Stanley	244.871.880	HUF	19-jun-2034	4840
Recibe tipo fijo al 10,25%					
Paga tipo variable BRL CDI	Morgan Stanley	13.201.444	BRL	02-ene-2026	5814
Paga tipo fijo al 9,83%					
Recibe tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	101.425.000	MXN	28-mar-2024	772
Recibe tipo fijo al 10,80%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	100.760.000	MXN	25-feb-2025	3992
Recibe tipo fijo al 9,26%					
Paga tipo variable MXN TIIE a 28 días	Morgan Stanley	34.845.000	MXN	23-feb-2027	(1.030)
Paga tipo fijo al 3,43%					
Recibe tipo variable CAD CORRA a 1 día	Morgan Stanley	7.943.000	CAD	17-sep-2026	(2.898)
				USD	(358.791)

Garantía por cobrar por la contraparte

A 31 de marzo de 2024, la exposición de la garantía por cobrar por la contraparte en relación con los acuerdos derivados era la siguiente:

Subfondos	Contraparte	Tipo de garantía	Divisa	Total Garantía recibida
Schroder GAIA Asian Equity Long Short				
	UBS	Efectivo	HKD	33.425
	UBS	Efectivo	NZD	2
	UBS	Efectivo	USD	4533
			USD	8805
Schroder GAIA BlueTrend				
	J.P. Morgan	Efectivo	CHF	60.068
	J.P. Morgan	Efectivo	EUR	6.556.818
	J.P. Morgan	Efectivo	USD	31.224.607
			USD	38.365.035
Schroder GAIA Egerton Equity				
	HSBC	Efectivo	EUR	80.000
	Morgan Stanley	Efectivo	CAD	3
	Morgan Stanley	Efectivo	EUR	6.959.927
			EUR	7.039.928
Schroder GAIA Helix				
	Goldman Sachs	Efectivo	EUR	54.615
	Goldman Sachs	Efectivo	GBP	1.246.517
	Goldman Sachs	Efectivo	USD	5.163.588
	Goldman Sachs	Efectivo	ZAR	427.995
	J.P. Morgan	Efectivo	AUD	686.901
	J.P. Morgan	Efectivo	CAD	13.892
	J.P. Morgan	Efectivo	CHF	41
	J.P. Morgan	Efectivo	EUR	9.124.552
	J.P. Morgan	Efectivo	GBP	170.500
	J.P. Morgan	Efectivo	HKD	2.762.503
	J.P. Morgan	Efectivo	JPY	781.486.097
	J.P. Morgan	Efectivo	USD	21.252.410
			USD	44.103.311

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Garantía por cobrar por la contraparte (continuación)

Subfondos	Contraparte	Tipo de garantía	Divisa	Total Garantía recibida	
Schroder GAIA Sirios US Equity	Merrill Lynch	Efectivo	USD	1.330.000	
	Morgan Stanley	Efectivo	USD	100.000	
			USD	1.430.000	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	Efectivo	EUR	2.957.194	
	Morgan Stanley	Efectivo	AUD	586.000	
	Morgan Stanley	Efectivo	CAD	910.607	
	Morgan Stanley	Efectivo	EUR	17.576.581	
	Morgan Stanley	Efectivo	JPY	121.459.431	
	Morgan Stanley	Efectivo	SGD	310.597	
	Morgan Stanley	Efectivo	USD	3.374.182	
	Morgan Stanley	Efectivo	ZAR	1.493.747	
	Societe Generale	Efectivo	CAD	54	
	Societe Generale	Efectivo	CHF	15	
	Societe Generale	Efectivo	CZK	2	
	Societe Generale	Efectivo	EUR	47	
	Societe Generale	Efectivo	JPY	4844	
	Societe Generale	Efectivo	MXN	1	
	Societe Generale	Efectivo	PLN	24.867	
	Societe Generale	Efectivo	SEK	2.125.095	
	Societe Generale	Efectivo	TWD	2.130.409	
	Societe Generale	Efectivo	USD	16.474.345	
	Societe Generale	Efectivo	ZAR	1	
				USD	44.438.225
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Barclays Bank	Efectivo	USD	130.000	
	BNP Paribas	Efectivo	USD	130.000	
	Deutsche Bank	Efectivo	USD	780.000	
	Goldman Sachs	Efectivo	USD	373.336	
	J.P. Morgan	Efectivo	USD	81.000	
	Morgan Stanley	Efectivo	CAD	7916	
	Morgan Stanley	Efectivo	CZK	530	
	Morgan Stanley	Efectivo	GBP	7	
	Morgan Stanley	Efectivo	HKD	66.251	
	Morgan Stanley	Efectivo	ILS	11	
	Morgan Stanley	Efectivo	JPY	230.028	
	Morgan Stanley	Efectivo	MXN	729.996	
	Morgan Stanley	Efectivo	NZD	24	
	Morgan Stanley	Efectivo	PLN	548	
	Morgan Stanley	Efectivo	SEK	625	
	Morgan Stanley	Efectivo	SGD	11	
	Morgan Stanley	Efectivo	USD	410.000	
	UBS	Efectivo	USD	790.000	
				USD	2.754.327

Información sobre los costes de transacción

Los costes de transacción son los impuestos y las comisiones de agentes relacionados con la compra y la venta de valores mobiliarios. Los subfondos de renta fija generalmente muestran la cifra cero, dado que las comisiones de los agentes se incluyen en el diferencial, el cual se excluye del cálculo en virtud del Anexo I, Apéndice B, Capítulo V de la Directiva 2009/65/CE del Parlamento Europeo. La parte de los costes de transacción del coste de adquisición o del precio de venta de los activos relacionados y los costes de transacción del Depositario no se incluyen en esta tabla. Los costes de los productos estructurados se incluyen en el valor de mercado.

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Información sobre los costes de operación (continuación)

Los costes de operación correspondientes al periodo analizado fueron los siguientes:

Subfondos	Divisa	Comisiones
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	USD	7675
Schroder GAIA BlueTrend	USD	77.320
Schroder GAIA Cat Bond	USD	20.010
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	129.083
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	97.362
Schroder GAIA Helix	USD	393.194
Schroder GAIA Oaktree Credit	USD	2865
Schroder GAIA SEG US Equity	USD	45.065
Schroder GAIA Sirios US Equity	USD	97.506
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	66.388
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	396.032

Dividendos

Durante el periodo analizado, se abonaron las distribuciones de dividendos de los siguientes subfondos:

Fecha de registro	Fecha sin dividendos	Fecha de pago	Subfondo	Dividendo bruto	Divisa	Dividendo por Participación
13-oct-2023	20-oct-2023	27-oct-2023	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	1.050,67	USD	4,040275
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	1.550,34	SGD	5,345083
10-nov-2023	17-nov-2023	24-nov-2023	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	2.229,41	USD	8,572672
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	3.599,90	SGD	11,250747
08-dic-2023	15-dic-2023	22-dic-2023	Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	2.095,20	USD	8,056288
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	3.868,74	SGD	10,579876
			Schroder GAIA Cat Bond Clase IF Dist.	303.962,29	USD	25,794514
28-dic-2023	29-dic-2023	04-ene-2024	Schroder GAIA Oaktree Credit Clase A2 Dist. CHF Cubierta	137,99	CHF	1,289272
			Schroder GAIA Oaktree Credit Clase E Dist.	26,23	USD	1,614408
28-dic-2023	29-dic-2023	08-ene-2024	Schroder GAIA Oaktree Credit Clase A2 Dist.	23,82	USD	1,479462
			Schroder GAIA Oaktree Credit Clase A2 Dist. EUR Cubierta	151,87	EUR	1,428726
			Schroder GAIA Oaktree Credit Clase A2 Dist. GBP Cubierta	148,10	GBP	1,383172
			Schroder GAIA Oaktree Credit Clase C Dist.	26,09	USD	1,609750
			Schroder GAIA Oaktree Credit Clase C Dist. CHF Cubierta	150,73	CHF	1,398655
			Schroder GAIA Oaktree Credit Clase C Dist. EUR Cubierta	165,93	EUR	1,551357
			Schroder GAIA Oaktree Credit Clase C Dist. GBP Cubierta	161,97	GBP	1,501928
			Schroder GAIA Oaktree Credit Clase E Dist. CHF Cubierta	154,79	CHF	1,433196
			Schroder GAIA Oaktree Credit Clase E Dist. EUR Cubierta	170,07	EUR	1,58725
			Schroder GAIA Oaktree Credit Clase E Dist. GBP Cubierta	28.026,76	GBP	1,536468
12-ene-2024	19-ene-2024	26-ene-2024	Schroder GAIA Cat Bond Clase A Dist.	12,09	USD	8,060000
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	2.638,74	USD	9,516507
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	4.576,63	SGD	12,509577
09-feb-2024	16-feb-2024	23-feb-2024	Schroder GAIA Cat Bond Clase A Dist.	1.314,81	USD	6,569136
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	2.148,09	USD	7,746725
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	3.901,15	SGD	10,222345
08-mar-2024	15-mar-2024	22-mar-2024	Schroder GAIA Cat Bond Clase A Dist.	1.267,99	USD	6,334874
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist.	2.139,26	USD	7,484116
			Schroder GAIA Cat Bond Clase F Dist. SGD Cubierta	3.708,88	SGD	9,713934
			Schroder GAIA Cat Bond Clase IF Dist.	442.610,60	USD	31,065015

Tipo de cambio

El tipo de cambio utilizado para el cálculo del total combinado en EUR de los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 es:

1 euro = 1,07885 dólares estadounidenses

Hechos posteriores

A la fecha de aprobación de los Estados financieros, no se produjeron hechos posteriores significativos.

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones

Subfondos y clases de participaciones	Comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones en la divisa del Fondo	Porcentaje de las comisiones de rentabilidad basado en el Valor liquidativo medio	Subfondos y clases de participaciones	Comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones en la divisa del Fondo	Porcentaje de las comisiones de rentabilidad basado en el Valor liquidativo medio
Schroder GAIA Asian Equity Long Short			Schroder GAIA Cat Bond (continuación)		
Clase A Acum.	19	1,25%	Clase IF Acum. EUR Cubierta	n/a#	n/a#
Clase C Acum.	1582	2,89%	Clase IF Acum. SEK Cubierta	n/a#	n/a#
Clase E Acum.	7169	0,43%	Clase IF Dist.	n/a#	n/a#
Clase E Acum. EUR	8	0,49%	Clase PI Acum. CHF Cubierta	103.872	0,43%
Clase I Acum.	n/a#	n/a#	Clase PI Acum. EUR Cubierta	231.151	0,56%
Clase IZ Acum.	22	1,38%	Clase PI Dist.	290.301	0,64%
Clase IZ Acum. EUR	8	0,48%	Clase PI Dist. GBP Cubierta	176.159	0,62%
Clase X1 Acum.	2333	0,44%	Clase Y Acum.	n/a#	n/a#
Clase X1 Acum. EUR	26	0,44%	Clase Y Acum. CHF Cubierta	n/a#	n/a#
Clase X1 Acum. GBP	385	0,43%	Clase Y Acum. EUR Cubierta	n/a#	n/a#
Clase X1 Acum. GBP Cubierta	16.462	0,45%	Clase Y1 Acum.	n/a#	n/a#
Schroder GAIA BlueTrend			Clase Y1 Acum. CHF Cubierta	n/a#	n/a#
Clase A Acum.	0	0,00%	Clase Y1 Acum. EUR Cubierta	n/a#	n/a#
Clase A Acum. CHF Cubierta	0	0,00%	Clase Y2 Acum.	n/a#	n/a#
Clase A Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase Y2 Acum. CHF Cubierta	n/a#	n/a#
Clase C Acum.	0	0,00%	Clase Y2 Acum. EUR Cubierta	n/a#	n/a#
Clase C Acum. BRL Cubierta	32.578	0,09%	Clase Y2 Acum. GBP Cubierta	n/a#	n/a#
Clase C Acum. CHF Cubierta	0	0,00%	Clase Y3 Acum.	n/a#	n/a#
Clase C Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase Y3 Acum. CHF Cubierta	n/a#	n/a#
Clase C Acum. GBP Cubierta	0	0,00%	Clase Y3 Acum. EUR Cubierta	n/a#	n/a#
Clase C Dist. GBP Cubierta	0	0,00%	Schroder GAIA Contour Tech Equity		
Clase E Acum.	0	0,00%	Clase A Acum.	309.247	1,89%
Clase E Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase A Acum. CHF Cubierta	1309	0,34%
Clase E Dist. GBP Cubierta	0	0,00%	Clase A Acum. EUR Cubierta	30.237	0,85%
Clase N Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase A Acum. SGD Cubierta	8562	1,48%
Clase N Acum. GBP Cubierta	0	0,00%	Clase A1 Acum.	16.772	1,69%
Clase N Acum. SEK Cubierta	0	0,00%	Clase C Acum.	1.684.461	2,31%
Schroder GAIA Cat Bond			Clase C Acum. CHF Cubierta	14.441	0,57%
Clase A Acum.	n/a#	n/a#	Clase C Acum. EUR Cubierta	506.422	1,25%
Clase A Acum. EUR Cubierta	n/a#	n/a#	Clase C Acum. GBP Cubierta	522.282	1,76%
Clase A Acum. SEK Cubierta	n/a#	n/a#	Clase C Acum. SEK Cubierta	82.215	1,33%
Clase A Dist.	n/a#	n/a#	Clase E Acum.	13.509	2,48%
Clase C Acum.	n/a#	n/a#	Clase E Acum. CHF Cubierta	262	0,29%
Clase C Acum. CHF Cubierta	n/a#	n/a#	Clase E Acum. EUR Cubierta	39.987	1,40%
Clase C Acum. EUR Cubierta	n/a#	n/a#	Clase E Acum. SEK Cubierta	298	1,52%
Clase C Acum. GBP Cubierta	n/a#	n/a#	Schroder GAIA Egerton Equity		
Clase F Acum.	n/a#	n/a#	Clase A Acum.	1.058.990	2,02%
Clase F Acum. CHF Cubierta	n/a#	n/a#	Clase A Acum. GBP Cubierta	41.474	2,05%
Clase F Acum. EUR Cubierta	n/a#	n/a#	Clase A Acum. USD Cubierta	1.471.919	2,33%
Clase F Dist.	n/a#	n/a#	Clase A Dist. GBP	4737	1,81%
Clase F Dist. SGD Cubierta	n/a#	n/a#	Clase A1 Acum.	30.013	1,78%
Clase I Acum.	n/a#	n/a#	Clase A1 Acum. USD Cubierta	382.571	2,11%
Clase I Acum. CHF Cubierta	n/a#	n/a#	Clase C Acum.	3.374.432	2,31%
Clase I Acum. EUR Cubierta	n/a#	n/a#	Clase C Acum. GBP Cubierta	513.300	2,33%
Clase I Acum. JPY Cubierta	n/a#	n/a#	Clase C Acum. USD Cubierta	2.811.782	2,61%
Clase IF Acum.	n/a#	n/a#	Clase C Dist.	30.000	2,36%
Clase IF Acum. CHF Cubierta	n/a#	n/a#	Clase C Dist. GBP	18.464	2,31%

Comisión de rentabilidad no cobrada a la Clase de Participaciones.

Notas a los Estados financieros a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones (continuación)

Subfondos y clases de participaciones	Comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones en la divisa del Fondo	Porcentaje de las comisiones de rentabilidad basado en el Valor liquidativo medio	Subfondos y clases de participaciones	Comisiones de rentabilidad cobradas por clase de participaciones en la divisa del Fondo	Porcentaje de las comisiones de rentabilidad basado en el Valor liquidativo medio
Schroder GAIA Egerton Equity (continuación)			Schroder GAIA SEG US Equity (continuación)		
Clase E Acum.	60	1,44%	Clase R3 Acum.	1.243.004	1,43%
Clase X Acum.	45	0,00%	Clase R3 Acum. CHF Cubierta	0	0,00%
Schroder GAIA Helix			Clase R3 Acum. EUR Cubierta	231.159	0,34%
Clase A Acum.	0	0,00%	Clase R3 Acum. GBP Cubierta	91.436	1,16%
Clase A Acum. CHF Cubierta	0	0,00%	Clase R4 Acum. GBP Cubierta	2703	0,76%
Clase A Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase R5 Acum. EUR Cubierta	25.727	0,57%
Clase A Acum. SEK Cubierta	0	0,00%	Schroder GAIA Sirios US Equity		
Clase A Acum. SGD Cubierta	0	0,00%	Clase A Acum.	2.011.130	2,27%
Clase C Acum.	0	0,00%	Clase A Acum. CHF Cubierta	9662	1,96%
Clase C Acum. CHF Cubierta	0	0,00%	Clase A Acum. EUR Cubierta	212.898	2,15%
Clase C Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase C Acum.	1.295.125	2,35%
Clase C Acum. GBP Cubierta	0	0,00%	Clase C Acum. CHF Cubierta	66.800	2,29%
Clase C Acum. SEK Cubierta	0	0,00%	Clase C Acum. EUR Cubierta	318.351	2,32%
Clase C Acum. SGD Cubierta	0	0,00%	Clase C Acum. GBP Cubierta	112.489	2,30%
Clase C1 Acum.	0	0,00%	Clase C Dist. GBP Cubierta	1965	2,36%
Clase E Acum.	0	0,00%	Clase E Acum.	602	1,80%
Clase E Acum. CHF Cubierta	0	0,00%	Clase E Acum. EUR Cubierta	18.161	1,78%
Clase E Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase X Acum.	43	2,39%
Clase E Acum. GBP Cubierta	0	0,00%	Clase X Acum. EUR Cubierta	283	2,34%
Clase I Acum.	n/a [#]	n/a [#]	Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
Clase I Acum. JPY Cubierta	n/a [#]	n/a [#]	Clase C Acum.	4.366.589	2,63%
Clase IZ Acum. GBP Cubierta	0	0,00%	Clase C Acum. CHF Cubierta	45.881	1,60%
Clase S Dist.	0	0,00%	Clase C Acum. EUR Cubierta	1.620.205	2,39%
Clase S Dist. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase C Acum. GBP Cubierta	2.076.923	2,72%
Clase S Dist. GBP Cubierta	0	0,00%	Clase K Acum.	1.350.726	2,63%
Clase X Acum. EUR Cubierta	0	0,00%	Clase K Acum. CHF Cubierta	923	1,17%
Schroder GAIA SEG US Equity			Clase K Acum. EUR Cubierta	107.819	1,89%
Clase C Acum.	33.323	5,91%	Schroder GAIA Wellington Pagosa		
Clase C Acum. CHF Cubierta	2986	4,14%	Clase A Acum.	0	0,00%
Clase C Acum. EUR Cubierta	38.922	5,29%	Clase A Acum. CHF Cubierta	0	0,00%
Clase C Acum. GBP Cubierta	178.543	5,74%	Clase A Acum. EUR Cubierta	0	0,00%
Clase IZ Acum.	280.572	5,07%	Clase A Acum. SGD Cubierta	0	0,00%
Clase IZ Acum. CHF Cubierta	3906	4,32%	Clase C Acum.	0	0,00%
Clase IZ Acum. EUR Cubierta	202.187	4,67%	Clase C Acum. BRL Cubierta	0	0,00%
Clase IZ Acum. GBP Cubierta	574	4,43%	Clase C Acum. CHF Cubierta	0	0,00%
Clase K Acum.	68	4,42%	Clase C Acum. EUR Cubierta	0	0,00%
Clase K Acum. CHF Cubierta	419	3,64%	Clase C Acum. GBP Cubierta	0	0,00%
Clase K Acum. EUR Cubierta	450	4,07%	Clase C1 Acum. CHF Cubierta	0	0,00%
Clase K Acum. GBP Cubierta	557	4,31%	Clase C1 Acum. EUR Cubierta	0	0,00%
Clase R1 Acum.	112.927	1,39%	Clase E Acum.	0	0,00%
Clase R1 Acum. EUR Cubierta	19.754	0,25%	Clase E Acum. CHF Cubierta	0	0,00%
Clase R2 Acum.	697.164	1,66%	Clase E Acum. EUR Cubierta	0	0,00%
Clase R2 Acum. CHF Cubierta	0	0,00%	Clase E Acum. GBP Cubierta	0	0,00%
Clase R2 Acum. EUR Cubierta	556.188	0,55%			
Clase R2 Acum. GBP Cubierta	18.964	0,63%			

En el caso de Schroder GAIA Oaktree Credit no se cobra ninguna comisión de rentabilidad.

Comisión de rentabilidad no cobrada a la Clase de Participaciones.

Ratio de gastos totales («TER»)

del periodo cerrado a 31 de marzo de 2024

Subfondos y clases de participaciones	TER	Subfondos y clases de participaciones	TER
Schroder GAIA Asian Equity Long Short		Schroder GAIA Cat Bond (continuación)	
Clase A Acum.	2,31%	Clase IF Acum. SEK Cubierta	1,32%
Clase C Acum.	1,47%	Clase IF Dist.	1,32%
Clase E Acum.	1,14%	Clase PI Acum. CHF Cubierta	0,62%
Clase E Acum. EUR	0,98%	Clase PI Acum. EUR Cubierta	0,62%
Clase I Acum.	0,15%	Clase PI Dist.	0,60%
Clase IZ Acum.	1,19%	Clase PI Dist. GBP Cubierta	0,62%
Clase IZ Acum. EUR	1,00%	Clase Y Acum.	1,07%
Clase X1 Acum.	1,00%	Clase Y Acum. CHF Cubierta	1,10%
Clase X1 Acum. EUR	1,00%	Clase Y Acum. EUR Cubierta	1,11%
Clase X1 Acum. GBP	1,01%	Clase Y1 Acum.	1,48%
Clase X1 Acum. GBP Cubierta	1,01%	Clase Y1 Acum. CHF Cubierta	1,53%
Schroder GAIA BlueTrend		Clase Y1 Acum. EUR Cubierta	1,52%
Clase A Acum.	2,01%	Clase Y2 Acum.	0,50%
Clase A Acum. CHF Cubierta	2,03%	Clase Y2 Acum. CHF Cubierta	0,53%
Clase A Acum. EUR Cubierta	2,03%	Clase Y2 Acum. EUR Cubierta	0,53%
Clase C Acum.	1,40%	Clase Y2 Acum. GBP Cubierta	0,53%
Clase C Acum. BRL Cubierta	1,43%	Clase Y3 Acum.	0,88%
Clase C Acum. CHF Cubierta	1,43%	Clase Y3 Acum. CHF Cubierta	0,91%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1,43%	Clase Y3 Acum. EUR Cubierta	0,91%
Clase C Acum. GBP Cubierta	1,43%	Schroder GAIA Contour Tech Equity	
Clase C Dist. GBP Cubierta	1,43%	Clase A Acum.	2,43%
Clase E Acum.	1,40%	Clase A Acum. CHF Cubierta	2,46%
Clase E Acum. EUR Cubierta	1,43%	Clase A Acum. EUR Cubierta	2,46%
Clase E Dist. GBP Cubierta	1,43%	Clase A Acum. SGD Cubierta	2,46%
Clase N Acum. EUR Cubierta	1,43%	Clase A1 Acum.	2,92%
Clase N Acum. GBP Cubierta	1,43%	Clase C Acum.	1,68%
Clase N Acum. SEK Cubierta	1,45%	Clase C Acum. CHF Cubierta	1,72%
Schroder GAIA Cat Bond		Clase C Acum. EUR Cubierta	1,71%
Clase A Acum.	1,77%	Clase C Acum. GBP Cubierta	1,71%
Clase A Acum. EUR Cubierta	1,82%	Clase C Acum. SEK Cubierta	1,71%
Clase A Acum. SEK Cubierta	1,82%	Clase E Acum.	1,43%
Clase A Dist.	1,82%	Clase E Acum. CHF Cubierta	1,46%
Clase C Acum.	1,38%	Clase E Acum. EUR Cubierta	1,46%
Clase C Acum. CHF Cubierta	1,41%	Clase E Acum. SEK Cubierta	1,42%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1,41%	Schroder GAIA Egerton Equity	
Clase C Acum. GBP Cubierta	1,40%	Clase A Acum.	2,43%
Clase F Acum.	1,73%	Clase A Acum. GBP Cubierta	2,46%
Clase F Acum. CHF Cubierta	1,74%	Clase A Acum. USD Cubierta	2,46%
Clase F Acum. EUR Cubierta	1,74%	Clase A Dist. GBP	2,45%
Clase F Dist.	1,73%	Clase A1 Acum.	2,93%
Clase F Dist. SGD Cubierta	1,74%	Clase A1 Acum. USD Cubierta	2,96%
Clase I Acum.	0,14%	Clase C Acum.	1,68%
Clase I Acum. CHF Cubierta	0,15%	Clase C Acum. GBP Cubierta	1,71%
Clase I Acum. EUR Cubierta	0,16%	Clase C Acum. USD Cubierta	1,71%
Clase I Acum. JPY Cubierta	0,17%	Clase C Dist.	1,68%
Clase IF Acum.	1,33%	Clase C Dist. GBP	1,68%
Clase IF Acum. CHF Cubierta	1,32%	Clase E Acum.	1,69%
Clase IF Acum. EUR Cubierta	1,34%	Clase X Acum.	1,56%

Tenga en cuenta que los costes de transacciones, según se detalla en las notas de los estados financieros y las comisiones de transacción relacionadas con la cartera subyacente de productos estructurados, no se incluyen en el TER anterior.

Ratio de gastos totales («TER») del periodo cerrado a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Subfondos y clases de participaciones	TER	Subfondos y clases de participaciones	TER
Schroder GAIA Helix		Schroder GAIA SEG US Equity	
Clase A Acum.	2,44%	Clase C Acum.	1,42%
Clase A Acum. CHF Cubierta	2,47%	Clase C Acum. CHF Cubierta	1,42%
Clase A Acum. EUR Cubierta	2,47%	Clase C Acum. EUR Cubierta	1,42%
Clase A Acum. SEK Cubierta	2,48%	Clase C Acum. GBP Cubierta	1,42%
Clase A Acum. SGD Cubierta	2,47%	Clase IZ Acum.	1,41%
Clase C Acum.	1,39%	Clase IZ Acum. CHF Cubierta	1,17%
Clase C Acum. CHF Cubierta	1,43%	Clase IZ Acum. EUR Cubierta	1,43%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1,42%	Clase IZ Acum. GBP Cubierta	1,42%
Clase C Acum. GBP Cubierta	1,42%	Clase K Acum.	2,04%
Clase C Acum. SEK Cubierta	1,07%	Clase K Acum. CHF Cubierta	1,92%
Clase C Acum. SGD Cubierta	1,40%	Clase K Acum. EUR Cubierta	1,92%
Clase C1 Acum.	1,35%	Clase K Acum. GBP Cubierta	1,92%
Clase E Acum.	1,00%	Clase R1 Acum.	1,77%
Clase E Acum. CHF Cubierta	0,98%	Clase R1 Acum. EUR Cubierta	1,77%
Clase E Acum. EUR Cubierta	0,98%	Clase R2 Acum.	1,17%
Clase E Acum. GBP Cubierta	1,00%	Clase R2 Acum. CHF Cubierta	1,17%
Clase I Acum.	0,15%	Clase R2 Acum. EUR Cubierta	1,17%
Clase I Acum. JPY Cubierta	0,13%	Clase R2 Acum. GBP Cubierta	1,17%
Clase IZ Acum. GBP Cubierta	1,16%	Clase R3 Acum.	1,61%
Clase S Dist.	0,57%	Clase R3 Acum. CHF Cubierta	1,42%
Clase S Dist. EUR Cubierta	0,63%	Clase R3 Acum. EUR Cubierta	1,42%
Clase S Dist. GBP Cubierta	0,60%	Clase R3 Acum. GBP Cubierta	1,42%
Clase X Acum. EUR Cubierta	0,78%	Clase R4 Acum. GBP Cubierta	2,33%
Schroder GAIA Oaktree Credit		Clase R5 Acum. EUR Cubierta	1,17%
Clase A2 Acum.	1,57%	Schroder GAIA Sirios US Equity	
Clase A2 Acum. CHF Cubierta	1,59%	Clase A Acum.	2,43%
Clase A2 Acum. EUR Cubierta	1,59%	Clase A Acum. CHF Cubierta	2,46%
Clase A2 Dist.	1,50%	Clase A Acum. EUR Cubierta	2,46%
Clase A2 Dist. CHF Cubierta	1,59%	Clase C Acum.	1,68%
Clase A2 Dist. EUR Cubierta	1,59%	Clase C Acum. CHF Cubierta	1,71%
Clase A2 Dist. GBP Cubierta	1,57%	Clase C Acum. EUR Cubierta	1,71%
Clase C Acum.	1,05%	Clase C Acum. GBP Cubierta	1,71%
Clase C Acum. CHF Cubierta	1,08%	Clase C Dist. GBP Cubierta	1,72%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1,08%	Clase E Acum.	1,36%
Clase C Acum. GBP Cubierta	1,07%	Clase E Acum. EUR Cubierta	1,41%
Clase C Dist.	0,97%	Clase X Acum.	1,52%
Clase C Dist. CHF Cubierta	1,09%	Clase X Acum. EUR Cubierta	1,60%
Clase C Dist. EUR Cubierta	1,08%	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	
Clase C Dist. GBP Cubierta	1,07%	Clase C Acum.	1,81%
Clase E Acum.	0,90%	Clase C Acum. CHF Cubierta	1,85%
Clase E Acum. CHF Cubierta	0,94%	Clase C Acum. EUR Cubierta	1,84%
Clase E Acum. EUR Cubierta	0,93%	Clase C Acum. GBP Cubierta	1,83%
Clase E Acum. GBP Cubierta	0,96%	Clase K Acum.	2,33%
Clase E Dist.	0,95%	Clase K Acum. CHF Cubierta	2,36%
Clase E Dist. CHF Cubierta	0,94%	Clase K Acum. EUR Cubierta	2,34%
Clase E Dist. EUR Cubierta	0,93%		
Clase E Dist. GBP Cubierta	0,93%		
Clase I Acum.	0,14%		

Tenga en cuenta que los costes de transacciones, según se detalla en las notas de los estados financieros y las comisiones de transacción relacionadas con la cartera subyacente de productos estructurados, no se incluyen en el TER anterior.

Ratio de gastos totales («TER») del periodo cerrado a 31 de marzo de 2024 (continuación)

Subfondos y clases de participaciones	TER
Schroder GAIA Wellington Pagosa	
Clase A Acum.	2,43%
Clase A Acum. CHF Cubierta	2,46%
Clase A Acum. EUR Cubierta	2,46%
Clase A Acum. SGD Cubierta	2,46%
Clase C Acum.	1,68%
Clase C Acum. BRL Cubierta	1,71%
Clase C Acum. CHF Cubierta	1,71%
Clase C Acum. EUR Cubierta	1,71%
Clase C Acum. GBP Cubierta	1,71%
Clase C1 Acum. CHF Cubierta	1,71%
Clase C1 Acum. EUR Cubierta	1,71%
Clase E Acum.	1,18%
Clase E Acum. CHF Cubierta	1,21%
Clase E Acum. EUR Cubierta	1,21%
Clase E Acum. GBP Cubierta	1,21%

Tenga en cuenta que los costes de transacciones, según se detalla en las notas de los estados financieros y las comisiones de transacción relacionadas con la cartera subyacente de productos estructurados, no se incluyen en el TER anterior.

Anexo I – Operaciones de financiación de valores

Los subfondos participan en Operaciones de financiación de valores (SFT, por sus siglas en inglés) (tal como se definen en el Artículo 3 del Reglamento (UE) 2015/2365, son operaciones que incluyen operaciones de recompra, préstamo de valores o materias primas, operaciones de compraventa y operaciones de préstamo de márgenes). De conformidad con el Artículo 13 del Reglamento, a continuación, se detalla la participación del subfondo en relación con su exposición a swaps de rentabilidad total durante el periodo cerrado a 31 de marzo de 2024:

Schroder GAIA Egerton Equity

Datos globales

Cantidad de activos implicados en swaps de rentabilidad total

Cantidad de activos - Posiciones largas EUR	% de AUM
11.922.590	2,59%
Cantidad de activos - Posiciones cortas EUR	% de AUM
7.338.605	1,60%
Cantidad de activos - Total EUR	% de AUM
19.261.195	4,19%

Datos de concentración

Los diez mayores emisores de garantías (en todas las SFT y swaps de rentabilidad total)

A 31 de marzo de 2024, no se habían recibido valores de garantías ni materias primas en relación con swaps de rentabilidad total.

Diez mayores contrapartes

Contraparte	Volumen bruto de operaciones pendientes EUR
Morgan Stanley	7.692.740
J.P. Morgan	7.275.777
Goldman Sachs	2.836.062
Merrill Lynch	1.456.616
	19.261.195

El subfondo trata con todas las contrapartes mencionadas en relación con sus swaps de rentabilidad total.

Datos generales de operaciones

Tipo y calidad de las garantías

A continuación, se indican los datos totales de las operaciones de garantías recibidas en relación con los swaps de rentabilidad total:

Tipo	Valor de mercado en EUR
Efectivo	6.959.927
	6.959.927

Plazo de vencimiento de las garantías

Vencimiento	Valor de mercado en EUR
menos de 1 día	6.959.927
1 a 7 días	-
1 a 4 semanas	-
1 a 3 meses	-
3 a 12 meses	-
más de 1 año	-
vencimiento abierto	-
	6.959.927

Anexo I – Operaciones de financiación de valores (continuación)

Schroder GAIA Egerton Equity (continuación)

Divisa de las garantías

Divisa	Valor de mercado en EUR
EUR	6.959.927
	6.959.927

Plazo de vencimiento de los swaps de rentabilidad total

Vencimiento	Posiciones largas EUR	Posiciones cortas EUR	Total EUR
menos de 1 día	-	-	-
1 a 7 días	-	-	-
1 a 4 semanas	-	-	-
1 a 3 meses	-	310.460	310.460
3 a 12 meses	10.263.332	4.330.485	14.593.817
más de 1 año	1.659.258	2.697.660	4.356.918
vencimiento abierto	-	-	-
	11.922.590	7.338.605	19.261.195

Países en los que se encuentran las contrapartes de los swaps de rentabilidad total

Contraparte	País
Morgan Stanley	Estados Unidos de América
J.P. Morgan	Reino Unido
Goldman Sachs	Estados Unidos de América
Merrill Lynch	Estados Unidos de América

Liquidación y compensación

El subfondo utiliza una liquidación y una compensación bilaterales con su contraparte para los swaps de rentabilidad total.

Reutilización de las garantías

El subfondo no reutiliza ni reinvierte las garantías recibidas, si las hubiese, en swaps de rentabilidad total.

Custodia de las garantías

Garantías recibidas

El depósito de las garantías recibidas con respecto a los swaps de rentabilidad total es el siguiente:

Depositario	Valor de mercado en EUR
Morgan Stanley	6.959.927
	6.959.927

Garantías otorgadas

El porcentaje de garantías mantenidas en cuentas separadas o conjuntas, o cualquier otro tipo de cuenta respecto de los swaps de rentabilidad total, es el siguiente:

Tipo de cuenta	Valor de mercado en EUR
Separada	25.407.336
Conjunto	-
Otras	-
	25.407.336

Las operaciones con derivados OTC realizadas por el subfondo, de conformidad con un acuerdo marco de la ISDA, se obtienen juntas de forma neta con fines de garantías.

Por tanto, las anteriores disposiciones sobre las garantías están relacionadas con todas las operaciones con derivados OTC y no únicamente con los swaps de rentabilidad total.

Anexo I - Operaciones de financiación de valores (continuación)

Schroder GAIA Egerton Equity (continuación)

Rentabilidad y coste

La rentabilidad sobre swaps de rentabilidad total mencionados a continuación se incluye como parte de los «Intereses netos sobre swaps», las «Ganancias/ (pérdidas) netas materializadas sobre contratos de swaps de rentabilidad total» y en la «Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) sobre contratos de swaps de rentabilidad total» en la Cuenta de pérdidas y ganancias y en el Estado de variación patrimonial. Todos los rendimientos de los swaps de rentabilidad total son atribuibles al Subfondo y no están sujetos a ningún acuerdo de reparto de rendimientos.

	Swaps de rentabilidad total absolutos (en la divisa del Subfondo)
Con respecto al Subfondo	5.901.362

Coste

Los costes atribuidos a los swaps de rentabilidad total vienen incluidos en el diferencial.

Schroder GAIA Helix

Datos globales

Cantidad de activos implicados en swaps de rentabilidad total

Cantidad de activos - Posiciones largas USD	% de AUM
-	-
Cantidad de activos - Posiciones cortas USD	% de AUM
6.502.975	2,30%
Cantidad de activos - Total USD	% de AUM
6.502.975	2,30%

Datos de concentración

Los diez mayores emisores de garantías (en todas las SFT y swaps de rentabilidad total)

A 31 de marzo de 2024, no se habían recibido valores de garantías ni materias primas en relación con swaps de rentabilidad total.

Diez mayores contrapartes

Contraparte	Volumen bruto de operaciones pendientes USD
Goldman Sachs	2.582.217
J.P. Morgan	2.181.596
Morgan Stanley	1.652.070
Barclays Bank	87.092
	6.502.975

El subfondo trata con todas las contrapartes mencionadas en relación con sus swaps de rentabilidad total.

Datos generales de operaciones

Tipo y calidad de las garantías

A continuación, se indican los datos totales de las operaciones de garantías recibidas en relación con los swaps de rentabilidad total:

Tipo	Valor de mercado en USD
Efectivo	1.320.000
	1.320.000

Anexo I - Operaciones de financiación de valores (continuación)

Schroder GAIA Helix (continuación)

Plazo de vencimiento de las garantías

Vencimiento	Valor de mercado en USD
menos de 1 día	1.320.000
1 a 7 días	-
1 a 4 semanas	-
1 a 3 meses	-
3 a 12 meses	-
más de 1 año	-
vencimiento abierto	-
	1.320.000

Divisa de las garantías

Divisa	Valor de mercado en USD
USD	1.320.000
	1.320.000

Plazo de vencimiento de los swaps de rentabilidad total

Vencimiento	Posiciones largas USD	Posiciones cortas USD	Total USD
menos de 1 día	-	-	-
1 a 7 días	-	-	-
1 a 4 semanas	-	-	-
1 a 3 meses	-	-	-
3 a 12 meses	-	6.502.975	6.502.975
más de 1 año	-	-	-
vencimiento abierto	-	-	-
	-	6.502.975	6.502.975

Países en los que se encuentran las contrapartes de los swaps de rentabilidad total

Contraparte	País
Goldman Sachs	Estados Unidos de América
J.P. Morgan	Reino Unido
Morgan Stanley	Estados Unidos de América
Barclays Bank	Reino Unido

Liquidación y compensación

El subfondo utiliza una liquidación y una compensación bilaterales con su contraparte para los swaps de rentabilidad total.

Reutilización de las garantías

El subfondo no reutiliza ni reinvierte las garantías recibidas, si las hubiese, en swaps de rentabilidad total.

Custodia de las garantías

Garantías recibidas

El depósito de las garantías recibidas con respecto a los swaps de rentabilidad total es el siguiente:

Depositario	Valor de mercado en USD
J.P. Morgan	1.320.000
	1.320.000

Anexo I - Operaciones de financiación de valores (continuación)

Schroder GAIA Helix (continuación)

Garantías otorgadas

El porcentaje de garantías mantenidas en cuentas separadas o conjuntas, o cualquier otro tipo de cuenta respecto de los swaps de rentabilidad total, es el siguiente:

Tipo de cuenta	Valor de mercado en USD
Separada	2.380.000
Conjunto	-
Otras	-
	2.380.000

Las operaciones con derivados OTC realizadas por el subfondo, de conformidad con un acuerdo marco de la ISDA, se obtienen juntas de forma neta con fines de garantías.

Por tanto, las anteriores disposiciones sobre las garantías están relacionadas con todas las operaciones con derivados OTC y no únicamente con los swaps de rentabilidad total.

Rentabilidad y coste

La rentabilidad sobre swaps de rentabilidad total mencionados a continuación se incluye como parte de los «Intereses netos sobre swaps», las «Ganancias/ (pérdidas) netas materializadas sobre contratos de swaps de rentabilidad total» y en la «Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) sobre contratos de swaps de rentabilidad total» en la Cuenta de pérdidas y ganancias y en el Estado de variación patrimonial. Todos los rendimientos de los swaps de rentabilidad total son atribuibles al Subfondo y no están sujetos a ningún acuerdo de reparto de rendimientos.

	Swaps de rentabilidad total absolutos (en la divisa del Subfondo)
Con respecto al Subfondo	60.973.782

Coste

Los costes atribuidos a los swaps de rentabilidad total vienen incluidos en el diferencial.

Schroder GAIA Sirios US Equity

Datos globales

Cantidad de activos implicados en swaps de rentabilidad total

Cantidad de activos - Posiciones largas USD	% de AUM
1.874.291	1,00%
Cantidad de activos - Posiciones cortas USD	% de AUM
3.728.740	1,97%
Cantidad de activos - Total USD	% de AUM
5.603.031	2,97%

Datos de concentración

Los diez mayores emisores de garantías (en todas las SFT y swaps de rentabilidad total)

A 31 de marzo de 2024, no se habían recibido valores de garantías ni materias primas en relación con swaps de rentabilidad total.

Diez mayores contrapartes

Contraparte	Volumen bruto de operaciones pendientes USD
Merrill Lynch	3.615.661
Goldman Sachs	1.437.620
Morgan Stanley	549.750
	5.603.031

El subfondo trata con todas las contrapartes mencionadas en relación con sus swaps de rentabilidad total.

Anexo I – Operaciones de financiación de valores (continuación)

Schroder GAIA Sirios US Equity (continuación)

Datos generales de operaciones

Tipo y calidad de las garantías

A continuación, se indican los datos totales de las operaciones de garantías recibidas en relación con los swaps de rentabilidad total:

Tipo	Valor de mercado en USD
Efectivo	100.000
	100.000

Plazo de vencimiento de las garantías

Vencimiento	Valor de mercado en USD
menos de 1 día	100.000
1 a 7 días	-
1 a 4 semanas	-
1 a 3 meses	-
3 a 12 meses	-
más de 1 año	-
vencimiento abierto	-
	100.000

Divisa de las garantías

Divisa	Valor de mercado en USD
USD	100.000
	100.000

Plazo de vencimiento de los swaps de rentabilidad total

Vencimiento	Posiciones largas USD	Posiciones cortas USD	Total USD
menos de 1 día	-	-	-
1 a 7 días	-	-	-
1 a 4 semanas	-	26.132	26.132
1 a 3 meses	1.463.983	1.153.480	2.617.463
3 a 12 meses	190.552	1.819.835	2.010.387
más de 1 año	219.756	729.293	949.049
vencimiento abierto	-	-	-
	1.874.291	3.728.740	5.603.031

Países en los que se encuentran las contrapartes de los swaps de rentabilidad total

Contraparte	País
Merrill Lynch	Estados Unidos de América
Goldman Sachs	Estados Unidos de América
Morgan Stanley	Estados Unidos de América

Liquidación y compensación

El subfondo utiliza una liquidación y una compensación bilaterales con su contraparte para los swaps de rentabilidad total.

Reutilización de las garantías

El subfondo no reutiliza ni reinvierte las garantías recibidas, si las hubiese, en swaps de rentabilidad total.

Anexo I - Operaciones de financiación de valores (continuación)

Schroder GAIA Sirios US Equity (continuación)

Custodia de las garantías

Garantías recibidas

El depósito de las garantías recibidas con respecto a los swaps de rentabilidad total es el siguiente:

Depositorio	Valor de mercado en USD
Morgan Stanley	100.000
	100.000

Garantías otorgadas

A 31 de marzo de 2024, no se otorgaron garantías en relación con swaps de rentabilidad total.

Las operaciones con derivados OTC realizadas por el subfondo, de conformidad con un acuerdo marco de la ISDA, se obtienen juntas de forma neta con fines de garantías.

Por tanto, las anteriores disposiciones sobre las garantías están relacionadas con todas las operaciones con derivados OTC y no únicamente con los swaps de rentabilidad total.

Rentabilidad y coste

La rentabilidad sobre swaps de rentabilidad total mencionados a continuación se incluye como parte de los «Intereses netos sobre swaps», las «Ganancias/ (pérdidas) netas materializadas sobre contratos de swaps de rentabilidad total» y en la «Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) sobre contratos de swaps de rentabilidad total» en la Cuenta de pérdidas y ganancias y en el Estado de variación patrimonial. Todos los rendimientos de los swaps de rentabilidad total son atribuibles al Subfondo y no están sujetos a ningún acuerdo de reparto de rendimientos.

	Swaps de rentabilidad total absolutos (en la divisa del Subfondo)
Con respecto al Subfondo	5.443.133

Coste

Los costes atribuidos a los swaps de rentabilidad total vienen incluidos en el diferencial.

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Datos globales

Cantidad de activos implicados en swaps de rentabilidad total

Cantidad de activos - Posiciones largas USD	% de AUM
4.972.678	1,29%
Cantidad de activos - Posiciones cortas USD	% de AUM
-	-
Cantidad de activos - Total USD	% de AUM
4.972.678	1,29%

Datos de concentración

Los diez mayores emisores de garantías (en todas las SFT y swaps de rentabilidad total)

A 31 de marzo de 2024, no se habían recibido valores de garantías ni materias primas en relación con swaps de rentabilidad total.

Diez mayores contrapartes

Contraparte	Volumen bruto de operaciones pendientes USD
Morgan Stanley	4.972.678
	4.972.678

El subfondo trata únicamente con Morgan Stanley para sus swaps de rentabilidad total.

Anexo I - Operaciones de financiación de valores (continuación)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (continuación)

Datos generales de operaciones

Tipo y calidad de las garantías

A continuación, se indican los datos totales de las operaciones de garantías recibidas en relación con los swaps de rentabilidad total:

Tipo	Valor de mercado en USD
Efectivo	3.359.187
	3.359.187

Plazo de vencimiento de las garantías

Vencimiento	Valor de mercado en USD
menos de 1 día	3.359.187
1 a 7 días	-
1 a 4 semanas	-
1 a 3 meses	-
3 a 12 meses	-
más de 1 año	-
vencimiento abierto	-
	3.359.187

Divisa de las garantías

Divisa	Valor de mercado en USD
USD	3.359.187
	3.359.187

Plazo de vencimiento de los swaps de rentabilidad total

Vencimiento	Posiciones largas USD	Posiciones cortas USD	Total USD
menos de 1 día	-	-	-
1 a 7 días	-	-	-
1 a 4 semanas	-	-	-
1 a 3 meses	-	-	-
3 a 12 meses	4.972.678	-	4.972.678
más de 1 año	-	-	-
vencimiento abierto	-	-	-
	4.972.678	-	4.972.678

Países en los que se encuentran las contrapartes de los swaps de rentabilidad total

Contraparte	País
Morgan Stanley	Estados Unidos de América

Liquidación y compensación

El subfondo utiliza una liquidación y una compensación bilaterales con su contraparte para los swaps de rentabilidad total.

Reutilización de las garantías

El subfondo no reutiliza ni reinvierte las garantías recibidas, si las hubiese, en swaps de rentabilidad total.

Anexo I - Operaciones de financiación de valores (continuación)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (continuación)

Custodia de las garantías

Garantías recibidas

El depósito de las garantías recibidas con respecto a los swaps de rentabilidad total es el siguiente:

Depositorio	Valor de mercado en USD
Morgan Stanley	3.359.187
	3.359.187

Garantías otorgadas

A 31 de marzo de 2024, no se otorgaron garantías en relación con swaps de rentabilidad total.

Las operaciones con derivados OTC realizadas por el subfondo, de conformidad con un acuerdo marco de la ISDA, se obtienen juntas de forma neta con fines de garantías.

Por tanto, las anteriores disposiciones sobre las garantías están relacionadas con todas las operaciones con derivados OTC y no únicamente con los swaps de rentabilidad total.

Rentabilidad y coste

La rentabilidad sobre swaps de rentabilidad total mencionados a continuación se incluye como parte de los «Intereses netos sobre swaps», las «Ganancias/(pérdidas) netas materializadas sobre contratos de swaps de rentabilidad total» y en la «Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) sobre contratos de swaps de rentabilidad total» en la Cuenta de pérdidas y ganancias y en el Estado de variación patrimonial. Todos los rendimientos de los swaps de rentabilidad total son atribuibles al Subfondo y no están sujetos a ningún acuerdo de reparto de rendimientos.

	Swaps de rentabilidad total absolutos (en la divisa del Subfondo)
Con respecto al Subfondo	46.623.282

Coste

Los costes atribuidos a los swaps de rentabilidad total vienen incluidos en el diferencial.

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Datos globales

Cantidad de activos implicados en swaps de rentabilidad total

Cantidad de activos - Posiciones largas USD	% de AUM
2.769.006	0,87%
Cantidad de activos - Posiciones cortas USD	% de AUM
5.323.195	1,67%
Cantidad de activos - Total USD	% de AUM
8.092.201	2,54%

Datos de concentración

Los diez mayores emisores de garantías (en todas las SFT y swaps de rentabilidad total)

A 31 de marzo de 2024, no se habían recibido valores de garantías ni materias primas en relación con swaps de rentabilidad total.

Diez mayores contrapartes

Contraparte	Volumen bruto de operaciones pendientes USD
Morgan Stanley	4.406.913
J.P. Morgan	2.469.637
Goldman Sachs	1.215.651
	8.092.201

El subfondo trata con todas las contrapartes mencionadas en relación con sus swaps de rentabilidad total.

Anexo I - Operaciones de financiación de valores (continuación)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (continuación)

Datos generales de operaciones

Tipo y calidad de las garantías

A 31 de marzo de 2024, no se habían recibido los datos totales de las operaciones de garantías recibidas en relación con swaps de rentabilidad total.

Plazo de vencimiento de los swaps de rentabilidad total

Vencimiento	Posiciones largas USD	Posiciones cortas USD	Total USD
menos de 1 día	-	-	-
1 a 7 días	11.561	9227	20.788
1 a 4 semanas	5864	-	5864
1 a 3 meses	-	187.734	187.734
3 a 12 meses	22.702	32.315	55.017
más de 1 año	2.728.879	5.093.919	7.822.798
vencimiento abierto	-	-	-
	2.769.006	5.323.195	8.092.201

Países en los que se encuentran las contrapartes de los swaps de rentabilidad total

Contraparte	País
Morgan Stanley	Estados Unidos de América
J.P. Morgan	Reino Unido
Goldman Sachs	Estados Unidos de América

Liquidación y compensación

El subfondo utiliza una liquidación y una compensación bilaterales con su contraparte para los swaps de rentabilidad total.

Reutilización de las garantías

El subfondo no reutiliza ni reinvierte las garantías recibidas, si las hubiese, en swaps de rentabilidad total.

Custodia de las garantías

Garantías recibidas

A 31 de marzo de 2024, no se recibieron garantías en relación con swaps de rentabilidad total.

Garantías otorgadas

A 31 de marzo de 2024, no se otorgaron garantías en relación con swaps de rentabilidad total.

Las operaciones con derivados OTC realizadas por el subfondo, de conformidad con un acuerdo marco de la ISDA, se obtienen juntas de forma neta con fines de garantías.

Por tanto, las anteriores disposiciones sobre las garantías están relacionadas con todas las operaciones con derivados OTC y no únicamente con los swaps de rentabilidad total.

Rentabilidad y coste

La rentabilidad sobre swaps de rentabilidad total mencionados a continuación se incluye como parte de los «Intereses netos sobre swaps», las «Ganancias/ (pérdidas) netas materializadas sobre contratos de swaps de rentabilidad total» y en la «Variación neta de la plusvalía/(minusvalía) sobre contratos de swaps de rentabilidad total» en la Cuenta de pérdidas y ganancias y en el Estado de variación patrimonial. Todos los rendimientos de los swaps de rentabilidad total son atribuibles al Subfondo y no están sujetos a ningún acuerdo de reparto de rendimientos.

	Swaps de rentabilidad total absolutos (en la divisa del Subfondo)
Con respecto al Subfondo	11.313.977

Coste

Los costes atribuidos a los swaps de rentabilidad total vienen incluidos en el diferencial.



EST. 1804

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof,
L-1736 Senningerberg
Gran Ducado de Luxemburgo
Tel.: (+352) 341 342 212
Fax: (+352) 341 342 342

GAIA 31 de marzo de 2024 ESES