

Schroders

Schroder GAIA
Geprüfter Jahresbericht
30. September 2024
Deutschland



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Geprüfter Jahresbericht

30. September 2024

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

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

Dieses Material darf nicht in Ländern ausgegeben werden, in denen dies gesetzlich verboten ist, und es darf nicht in einer Weise verwendet werden, die gegen lokale Gesetze oder Vorschriften verstößt.

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

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

Schroders

Inhalt

Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland	5
Verwaltungsrat	6
Verwaltung	7
Bericht des Verwaltungsrats	8
Bericht des Anlageverwalters	10
Prüfbericht	12
Statistische Informationen	15
Kombinierte Nettovermögensaufstellung	31
Kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung	33
Kombinierte Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens	35
Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen	37
Anlageportfolio	41
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	41
Schroder GAIA BlueTrend	42
Schroder GAIA Cat Bond	43
Schroder GAIA Contour Tech Equity	49
Schroder GAIA Egerton Equity	50
Schroder GAIA Helix	51
Schroder GAIA Oaktree Credit	55
Schroder GAIA SEG US Equity	62
Schroder GAIA Sirios US Equity	63
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	65
Schroder GAIA Wellington Pagosa	66
Anmerkungen zum Abschluss	72
Gesamtkostenquote („TER“)	149
Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)	152
Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)	154
Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft)	162

Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland

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

HSBC Continental Europe, Luxembourg

18, Boulevard de Kockelscheuer

L-1821 Luxemburg

Email: simeudealing@schroders.com

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

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

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

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

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

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

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

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsvorsitzender

- **Eric Bertrand**
Non-Executive Director

Vaults 13-16
Valletta Waterfront
1914 FRN
Malta

Weitere Verwaltungsratsmitglieder

- **Carla Bergareche Garcia-Minaur**
Global Head of Wealth, Client Group
Schroder Investment Management (Europe) S.A., Spanish Branch
C/ Pinar, 7 – 4^a planta, 28006 Madrid
Spanien

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini¹**
Independent Director
12, rue de la Sapinière
L-8150 Bridel
Großherzogtum Luxemburg

- **Bernard Herman**
Independent Director
BH Consulting S.à.r.l.
26, rue Glesener
L-1630 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

- **Hugh Mullan**
Independent Director
5, rue Höhenhof
L-1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

- **Ross Leach**
Specialist Solutions
Schroder Investment Management Limited
One London Wall Place
London EC2Y 5AU
Vereinigtes Königreich

- **Tim Boole**
Head of Product Management Private Equity
Schroders Capital Management (Switzerland) AG
Talstrasse 11
CH-8001 Zürich
Schweiz

- **Yves Francis²**
Independent Director
Rue du Pannebourg 67
6700 Arlon
Belgien

- **Wim Nagler³**
Head of Insurance, EMEA
Schroder Investment Management (Europe) S.A., French Branch
1, rue Euler
75008 Paris
Frankreich

¹ Marie-Jeanne Chevremont-Lorenzini trat am 27. Juni 2024 aus dem Verwaltungsrat zurück.

² Yves Francis wurde am 28. März 2024 in den Verwaltungsrat berufen.

³ Wim Nagler wurde am 27. Juni 2024 in den Verwaltungsrat berufen.

Verwaltung

Eingetragener Sitz

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft, Register- und Domizilstelle

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptbuchstelle, Registerführer und Transferstelle

HSBC Continental Europe, Luxembourg

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

Verwahrstelle und Verwaltungsstelle

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

80, route d'Esch, L-1470 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptrechtsberater

Arendt & Medernach S.A.

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

Unabhängiger Abschlussprüfer

KPMG Audit S.à r.l.

39, Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter

Contour Asset Management, LLC

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

Egerton Capital (UK) LLP

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

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

- Egerton Capital (US), LP.

Oaktree Capital Management, LP

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

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

- Oaktree Capital Management (UK) LLP

Schroder Investment Management Limited

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

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

- Premier Fund Managers Ltd*;
- Schroder Investment Management (Singapore) Ltd;
- Schroder Investment Management (Japan) Ltd.

Schroder Investment Management (Singapore) Ltd

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

Schroder Investment Management (Singapore) Ltd hat den folgenden Unteranlageverwalter für Schroder GAIA Asian Equity Long Short bestellt:

- Schroder Investment Management Limited

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

Talstrasse 11, CH-8001 Zürich, Schweiz
Schroder GAIA Cat Bond

Select Equity Group LP

380 Lafayette Street, New York, NY 10003, USA
Schroder GAIA SEG US Equity

Sirios Capital Management LP

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

Systematica Investments Limited

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

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

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

Two Sigma Advisers LP

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

Wellington Management International Limited

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

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

- Wellington Management Company LLP.

* Der Unteranlageverwalter von Schroder GAIA Helix wurde mit Wirkung zum 15. Juni 2024 von Tellworth Investments LLP zu Premier Fund Managers Ltd geändert.

Bericht des Verwaltungsrats

Die Gesellschaft

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

Schroders ist eine FATCA-konforme Organisation. Die FATCA-Klassifizierung dieser Gesellschaft und ihre GIIN lauten wie folgt: FATCA-Klassifizierung dieser Gesellschaft: FFI; Sponsoring-Gesellschaft: Schroder Investment Management (Europe) S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“); GIIN der Sponsoring-Gesellschaft: 4RIMT7.00000.SP.442.

Abschluss

Der Verwaltungsrat (der „Verwaltungsrat“) der Gesellschaft legt hiermit seinen Bericht und den geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024 vor.

Zum Zeitpunkt dieses Berichts standen elf Teifonds innerhalb der Gesellschaft für Investitionen zur Verfügung (die „Teifonds“). Die Anlageziele der Teifonds sowie Angaben zu Anlagebeschränkungen finden Sie im aktuellen Verkaufsprospekt. Den Bericht des Anlageverwalters für den jeweiligen Teifonds finden Sie in den vierteljährlichen Anlageberichten, die am Sitz der Gesellschaft und auf der Website der Verwaltungsgesellschaft erhältlich sind (<http://www.schroders.lu>).

Dieser Bericht betrifft das Geschäftsjahr vom 1. Oktober 2023 bis zum 30. September 2024. Der letzte Termin, an dem die Anteilkurse berechnet wurden, war der 30. September 2024, der letzte Arbeitstag im Berichtsjahr. Der Abschluss wurde im Einklang mit den Luxemburger Verordnungen in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) erstellt.

Zum 30. September 2024 belief sich das Nettovermögen der Gesellschaft insgesamt auf 5.760.793.489 EUR, was im Vergleich zu 4.928.621.911 EUR zum 30. September 2023 einem Anstieg von 16,88 % entspricht.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats

Die Verantwortung des Verwaltungsrats richtet sich nach luxemburgischem Recht. In Bezug auf den Abschluss der Gesellschaft ist der Verwaltungsrat verpflichtet, für jedes Geschäftsjahr einen Abschluss zu erstellen, der ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Vermögens-, Finanz- und Ertragslage der Gesellschaft und jedes ihrer Teifonds zum Ende des Geschäftsjahrs sowie des Ergebnisses der Gesellschaft und jedes ihrer Teifonds für das Geschäftsjahr vermittelt.

Der Verwaltungsrat hat folgende Pflichten:

- Auswahl zweckdienlicher Rechnungslegungsmethoden und deren einheitliche Anwendung;
- Vornahme angemessener und umsichtiger Beurteilungen und Schätzungen;
- Angabe, ob diese in Übereinstimmung mit den anwendbaren Rechnungslegungsstandards erstellt wurden, Identifizierung dieser Standards und Erläuterung der Auswirkung und der Gründe für etwaige wesentliche Abweichungen von diesen Standards; und
- Erstellung des Abschlusses auf der Grundlage der Unternehmensfortführung, es sei denn, es ist unangemessen anzunehmen, dass die Teifonds ihre Geschäftstätigkeit fortsetzen werden.

Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, sicherzustellen, dass angemessene Buchhaltungsunterlagen geführt werden. In diesem Zusammenhang hat er die Vermögenswerte der Fonds Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. (die „Verwahrstelle“) zur Verwahrung anvertraut. Der Verwaltungsrat ist dafür verantwortlich, Maßnahmen zu ergreifen, die ihm vernünftigerweise zur Verfügung stehen, um Betrug und andere Unregelmäßigkeiten zu verhindern und aufzudecken.

Verwaltungsratssitzungen

Während des Geschäftsjahrs zum 30. September 2024 fanden sieben Verwaltungsratssitzungen statt.

Corporate Governance

Die Gesellschaft unterliegt der Corporate Governance beruhend auf:

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

Interne Kontroll- und Risikomanagementsysteme

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

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

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

Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

Informationen zu den ökologischen oder sozialen Merkmalen und dem nachhaltigen Investitionsziel, soweit zutreffend, finden Sie in Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor.

Bericht des Verwaltungsrats (Forts.)

Aktivitäten während des Geschäftsjahres

1. Neue Anteilsklassen

Während des Berichtszeitjahres wurden die folgenden Anteilsklassen aufgelegt:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Asian Equity Long Short			
Klasse E Thes.	USD	USD	6. Dezember 2023
Klasse E Thes. EUR	EUR	USD	6. Dezember 2023
Klasse IZ Thes. EUR	EUR	USD	6. Dezember 2023
Klasse X1 Thes.	USD	USD	6. Dezember 2023
Klasse X1 Thes. EUR	EUR	USD	6. Dezember 2023
Klasse X1 Thes. GBP	GBP	USD	6. Dezember 2023
Klasse X1 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	6. Dezember 2023
Schroder GAIA Cat Bond			
Klasse A Aussch.	USD	USD	8. Dezember 2023
Klasse X Thes.	USD	USD	22. Dezember 2023
Klasse X Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	22. Dezember 2023
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	22. Dezember 2023
Schroder GAIA Contour Tech Equity			
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	USD	USD	20. August 2024
Schroder GAIA Two Sigma Diversified			
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	USD	USD	12. Juni 2024

Die am 22. Dezember 2023 aufgelegten Anteilsklassen Y3 Acc des Schroder GAIA Cat Bond wurden am 13. September 2024 in X Acc umbenannt. Die X-Anteilsklasse behält dieselben Merkmale und Zulassungskriterien wie die Y3-Anteilsklasse bei und die Gebührenstruktur und die ISIN-Codes blieben unverändert.

2. Auflösungen von Anteilsklassen

Die folgende Anteilsklasse wurde während des Berichtszeitjahres aufgelöst:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflösungsdatum
Schroder GAIA SEG US Equity			
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	17. Juli 2024

Der Verwaltungsrat

Schroder GAIA

30. September 2024

Bericht des Anlageverwalters

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

Wirtschaftlicher Rückblick

Prägend für den Zwölfmonatszeitraum war der Wechsel der Erwartungen bezüglich des Zeitpunkts, an dem die großen Zentralbanken in der Lage sein würden, die Zinssätze zu senken.

Die US-Inflationsdaten von Ende 2023, die niedriger ausfielen als erwartet, stärkten die Ansicht am Markt, dass die Federal Reserve (Fed) das Ende ihrer Zinserhöhungen erreicht habe und Anfang 2024 zu Zinssenkungen übergehen würde. Im weiteren Verlauf des Jahres 2024 erwies sich die Inflation jedoch als hartnäckiger als erwartet, und die Märkte mussten ihre Einschätzung sowohl des Zeitpunktes als auch des Ausmaßes der Zinssenkungen in den USA korrigieren.

Während sie zur Jahreswende sechs oder sieben Zinssenkungen eingepreist hatten, ließ der „Dot-Plot“ vom März, aus dem die Erwartungen der politischen Entscheidungsträger in Bezug auf Zinssenkungen genauer abzulesen sind, in diesem Jahr nur auf drei Senkungen schließen.

Allerdings führten einige schwächere Beschäftigungszahlen im Frühsommer zu Befürchtungen, dass die Fed mit den Zinssenkungen möglicherweise zu lange gewartet hat, was Anlass zur Sorge über die Aussicht auf eine Konjunkturabschwächung oder sogar eine Rezession gab. Die Fed reagierte im September mit einer Zinssenkung um 50 Basispunkte (Bp.), die größer war als die typische Bewegung um 25 Basispunkte.

In der Eurozone und in Großbritannien war die Situation ähnlich: Mit einer höher als erwarteten Inflation wurden die Aussichten auf eine Lockerung der Geldpolitik zurückgeschraubt. Beide Zentralbanken senkten die Zinssätze in diesem Zeitraum.

Einen wichtigen Kontrast bildete jedoch Japan. Im März 2024 überarbeitete die Bank of Japan (BoJ) ihre geldpolitischen Maßnahmen, wobei sie nicht nur den negativen Zinsen ein Ende setzte, sondern auch einen kurzfristigen Zinssatz von 0,0 % bis 0,1 % festlegte. Außerdem gab die BoJ ihre Politik der Renditekurvenkontrolle auf. Diesen Maßnahmen waren höhere Inflationszahlen und Anzeichen höherer Lohnvereinbarungen in Japan vorausgegangen. Im Juli erhöhte die BoJ die Zinsen weiter auf 0,25 %.

Bei den Schwellenländern ließen die gemischten Wirtschaftsdaten aus China nach wie vor darauf schließen, dass sich die Konjunktur von der pandemiebedingten Abkühlung der Vorjahre nur schleppend erholte. Die laufende Immobilienkrise belastete weiterhin die Stimmung. Die chinesischen Behörden reagierten im September 2024 mit einem Paket von Konjunkturmaßnahmen. Dazu gehörten Zinssenkungen, die Finanzierung des Aktienmarktes und die Unterstützung des Immobiliensektors.

Auch geopolitische Risiken waren in diesem Berichtszeitraum beachtlich. Der Krieg zwischen Russland und der Ukraine setzte sich fort, während im Oktober 2023 ein erneuter Konflikt im Nahen Osten begann. Im Berichtszeitraum fanden weltweit zahlreiche Wahlen statt, doch konzentrierte sich die Aufmerksamkeit der Anleger weitgehend auf die im November 2024 stattfindenden Präsidentschaftswahlen in den USA.

Überblick über die Entwicklung am Aktienmarkt

Die globalen Aktienmärkte verzeichneten im Zwölfmonatszeitraum starke Gewinne. Dies geschah trotz gelegentlich ausgeprägter Volatilität, insbesondere Ende Juli/Anfang August.

Insgesamt wurden Aktien ebenso durch die Hoffnung auf eine weiche Landung der US-Wirtschaft wie durch die Erwartung weiterer Zinssenkungen gestützt. Auch die robusten Unternehmensgewinne in mehreren Sektoren und die Begeisterung für neue Technologien und künstliche Intelligenz (KI) unterstützten die Aktien. Allerdings trugen einige Zweifel an den wahrscheinlichen Renditen umfangreicher KI-Investitionen zur Volatilität auf den Märkten bei.

Der MSCI World Index erzielte in US-Dollar gemessen im Berichtszeitraum eine Rendite von 32,4 %. Die US-Aktien lagen bei den Gewinnen an der Spitze, unterstützt durch starke Zuwächse bei einigen KI-Unternehmen. Der MSCI World Growth Index übertraf sein Substanzwerte-Pendant, obwohl einige niedriger bewertete Sektoren im Zuge der bevorstehenden Zinssenkungen eine bessere Performance zeigten.

Die Volatilität Ende Juli und Anfang August entsprang mehreren Quellen. Die Bank of Japan erhöhte die Zinssätze, während einige schwache US-Arbeitsmarktdaten die Erwartung steiler Zinssenkungen in den USA auslösten. Dies wirkte sich auf die Währungen aus und führte insbesondere zu einem kurzen, steilen Rückgang japanischer Aktien, wenngleich sie für den Berichtszeitraum insgesamt Gewinne verzeichneten.

Die Schwellenländer entwickelten sich etwas schlechter als die Industrieländer. Der MSCI EM Index erzielte in US-Dollar gemessen eine Rendite von 26,0 %. Der Optimismus über die Aussichten für technologiebezogene Titel trug dazu bei, dass taiwanesische Aktien eine starke Performance erzielten. Auch Aktien in Indien verzeichneten einen beachtlichen Anstieg. China war während eines großen Teils des Berichtszeitraums ein großer Nachzügler angesichts der Sorgen um seinen Immobiliensektor. Die Hoffnungen auf zusätzliche Konjunkturimpulse verliehen Aktien am Ende des Berichtszeitraums jedoch Auftrieb.

Rückblick auf die Märkte für festverzinsliche Wertpapiere

Während des vierten Quartals 2023 überzeugte der nachlassende Inflationsdruck in den wichtigsten Volkswirtschaften die Anleger davon, dass die Zinssätze ihren Höchststand erreicht hatten, und löste bis zum Jahresende eine starke Rallye an den Anleihemärkten aus. Im ersten Halbjahr 2024 korrigierten die Marktteilnehmer jedoch ihre Erwartungen von Zinssenkungen nach unten, und die Renditen stiegen entsprechend bis zum dritten Quartal, als die Lockerung des Inflationsdrucks insbesondere in den USA erneut die Hoffnung auf Zinssenkungen schürte. Zur Erinnerung: Die Renditen bewegen sich tendenziell umgekehrt zu den Preisen.

Im Zwölfmonatszeitraum fiel die Rendite 10-jähriger US-Staatsanleihen von 4,57 % auf 3,79 %. Schwächere US-Arbeitsmarktzahlen veranlassten die Federal Reserve, auf ihrer Septembersitzung eine Zinssenkung um 0,5 Prozentpunkte zu sanktionieren.

Die Renditen japanischer Staatsanleihen stiegen, als die Bank of Japan ihre Negativzinspolitik aufgab und die Kosten für die Geldaufnahme im Juli auf 0,25 % erhöhte. Die Rendite der 10-jährigen Staatsanleihen stieg im Laufe des Berichtszeitraums von 0,77 % auf 0,86 %.

Im Gegensatz dazu sank die Rendite 10-jähriger deutscher Bundesanleihen von 2,84 % auf 2,13 %, da die Anleger damit zu rechnen begannen, dass die Europäische Zentralbank als erste große Zentralbank die Zinssätze senken würde. Dies geschah dann auch Anfang Juni, gefolgt von einer weiteren Senkung im September. Die Rendite für zehnjährige britische Gilts fiel von 4,44 % auf 4,01 %, als die Wirtschaft in der zweiten Jahreshälfte 2023 in eine technische Rezession abrutschte.

Die Kreditspreads haben sich im Laufe des Zwölfmonatszeitraums deutlich verschärft, wobei sowohl der Investment-Grade- als auch der High-Yield-Markt von der starken Nachfrage der Anleger nach Neuemissionen und auf dem Sekundärmarkt profitierten. Am deutlichsten war die Spreadverengung an den US-amerikanischen und europäischen Märkten für hochrentierliche Unternehmensanleihen.

Der US-Dollar verzeichnete im Juni gegenüber dem Yen ein 38-jähriges Hoch, bevor er einen starken Rückgang erlebte, da die Anleger mit einem schrumpfenden Zinsunterschied zwischen den USA und Japan rechneten. Insgesamt schwächte sich der US-Dollar-Index ab und ging im dritten Quartal drastisch zurück, da sich die Erwartungen im September entschieden auf eine Senkung der US-Zinsen verlagerten.

Bericht des Anlageverwalters (Forts.)

Ausblick

Eine sanfte Landung der US-Wirtschaft scheint nach wie vor das wahrscheinlichste Ergebnis zu sein. Die steigende Arbeitslosigkeit war nicht auf Entlassungen zurückzuführen, sondern vielmehr auf eine höhere Nettozuwanderung, die die Normalisierung bei der Schaffung von Arbeitsplätzen übersteigt. Generell sind die Arbeitsmarktbedingungen ausgewogener geworden, was dazu führen sollte, dass Einstellungen und Lohnzuwachs wieder zu einem normaleren Tempo zurückkehren. Neben der weiteren Desinflation und der Verbesserung der Kreditverfügbarkeit sollte dies dazu beitragen, soliden private Konsumausgaben und damit auch die Wirtschaftstätigkeit im Allgemeinen aufrechtzuerhalten. Die Inflation hat sich weiter in die richtige Richtung bewegt, was eine stimulierende Haltung der Federal Reserve ermöglicht. Dies ist ein positiver Hintergrund für US-Aktien.

In der Eurozone hinkt die Betriebsleistung trotz des Aufschwungs im globalen Warenkreislauf weiterhin weit hinter den verbraucherorientierten Sektoren zurück. Da es den Herstellern anderswo besser geht, könnte dies auf einen strukturellen Verlust an Wettbewerbsfähigkeit hindeuten.

Chinesische Aktien erzielten am Ende des Zeitraums starke Gewinne, da einige geldpolitische Konjunkturmaßnahmen angekündigt wurden und noch weitere erwartet werden. Es müssen weitere fiskalpolitische Anreizmaßnahmen angekündigt werden, um die Erwartungen an das chinesische Wachstum wirklich zu ändern.

Die Anlageverwalter

Schroder GAIA

Prüfbericht



KPMG Audit S.à r.l.
39, avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg

Tel.: +352 22 51 51 1
Fax: +352 22 51 71
E-Mail: info@kpmg.lu
Internet: www.kpmg.lu

An die Anteilsinhaber von
Schroder GAIA
5, rue Höhenhof,
1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

BERICHT DES REVISEUR D'ENTREPRISES AGREE

Bericht über die Prüfung des Abschlusses

Bestätigungsvermerk

Wir haben den Jahresabschluss von Schroder GAIA und die Jahresabschlüsse aller seiner Teilfonds („der Fonds“) geprüft. Diese beinhalten die kombinierte Nettovermögensaufstellung und die Aufstellung der Anlagebestände zum 30. September 2024 sowie die kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und die kombinierte Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr und die Anmerkungen zum Abschluss, einschließlich einer Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden.

Unseres Erachtens zeigt der beiliegende Jahresabschluss ein wahrheitsgetreues und angemessenes Bild der Finanzlage von Schroder GAIA und seiner jeweiligen Teilfonds zum 30. September 2024 sowie ihrer Betriebsergebnisse und Veränderungen des Nettovermögens für das abgelaufene Geschäftsjahr im Einklang mit den in Luxemburg geltenden rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Anforderungen in Bezug auf die Erstellung und Darstellung des Jahresabschlusses.

Grundlage des Bestätigungsvermerks

Wir haben unsere Prüfung im Einklang mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über das Prüfungswesen („Gesetz vom 23. Juli 2016“) und den internationalen Prüfungsstandards (International Standards on Auditing, „ISAs“), die von der Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“) für Luxemburg übernommen wurden, durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten im Rahmen des Gesetzes vom 23. Juli 2016 und der von der CSSF für Luxemburg übernommenen ISAs sind im Abschnitt „Verantwortung des ‚Réviseur d'entreprises agréé‘ für die Prüfung des Abschlusses“ unseres Berichts näher ausgeführt. Wir sind auch im Einklang mit dem von der CSSF für Luxemburg übernommenen International Code of Ethics for Professional Accountants, einschließlich der International Independence Standards des International Ethics Standards Board for Accountants („IESBA Code“), zusammen mit den ethischen Anforderungen, die für unsere Prüfung des Abschlusses gelten, unabhängig vom Fonds und haben unsere sonstigen ethischen Verantwortlichkeiten im Rahmen dieser ethischen Anforderungen erfüllt. Unseres Erachtens sind die Ergebnisse aus unserer Prüfung ausreichend und geeignet, um als Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk zu dienen.

Prüfbericht (Forts.)



Sonstige Angaben

Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Angaben umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Angaben, jedoch nicht den Jahresabschluss und unseren Bericht des „réviseur d'entreprises agréé“ zu diesem Jahresabschluss.

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

Im Zusammenhang mit unserer Prüfung des Abschlusses besteht unsere Zuständigkeit darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei abzuwägen, ob die sonstigen Informationen in wesentlicher Hinsicht mit dem Abschluss oder den Kenntnissen unvereinbar sind, die wir bei der Prüfung erlangt haben, oder ob auf sonstige Weise erhebliche Falschaussagen vorzuliegen scheinen. Wenn wir auf der Grundlage unserer durchgeführten Arbeit feststellen, dass diese sonstigen Angaben wesentliche Falschaussagen enthalten, sind wir verpflichtet, dies zu berichten. Wir haben in dieser Hinsicht nichts zu berichten.

Verantwortung des Verwaltungsrats des Fonds für den Abschluss

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

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

Verantwortung des „réviseur d'entreprises agréé“ für die Prüfung des Abschlusses

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

Prüfbericht (Forts.)



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

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher Falschaussagen im Abschluss aufgrund von Betrug oder Irrtum, wir konzipieren auf diese Risiken ausgerichtete Prüfungsverfahren und führend diese durch und wir verschaffen uns Prüfungs nachweise, die als Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk ausreichend und geeignet sind. Das Risiko, dass eine auf Betrug zurückzuführende wesentliche Falschaussage nicht aufgedeckt wird, ist höher als im Fall von Irrtümern, da im Betrugsfall Absprachen, Fälschungen, absichtliche Auslassungen, Falschdarstellungen oder das Ausschalten interner Kontrollmaßnahmen vorliegen können;
- verschaffen wir uns ein Verständnis der für die Prüfung relevanten internen Kontrollmaßnahmen, um Prüfverfahren zu konzipieren, die für die jeweilige Situation geeignet sind, jedoch nicht zum Zweck der Äußerung einer Ansicht darüber, ob die internen Kontrollmaßnahmen des Fonds wirksam sind oder nicht;
- beurteilen wir die Eignung der verwendeten Rechnungslegungsmethoden und die Angemessenheit der rechnungslegungsbezogenen Schätzungen und der diesbezüglichen Angaben des Verwaltungsrats des Fonds;
- äußern wir uns zur Angemessenheit der Anwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung durch den Verwaltungsrat des Fonds und dazu, ob auf der Grundlage der Ergebnisse der Prüfung eine erhebliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen besteht, die die Fortführung des Fonds oder eines seiner Teilfonds erheblich in Zweifel stellen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine erhebliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Bericht des „réviseur d'entreprises agréé“ auf die entsprechenden Angaben im Abschluss aufmerksam zu machen oder unseren Bestätigungsvermerk zu ändern, wenn diese Angaben unzulänglich sind. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den Ergebnissen aus unserer Prüfung bis zum Datum unseres Berichts des „réviseur d'entreprises agréé“. Zukünftige Ereignisse oder Bedingungen können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder einer seiner Teilfonds nicht fortgeführt wird;
- beurteilen wir die allgemeine Darstellung, die Struktur und den Inhalt des Abschlusses einschließlich der Offenlegungen, und wir beurteilen, ob der Abschluss die zugrunde liegenden Transaktionen und Ereignisse angemessen darstellt.

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

Luxemburg, den 22. Januar 2025

KPMG Audit S.à r.l.
Cabinet de révision agréé

Ravi Beegun
Partner

Statistische Informationen

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert						
zum 30. September 2024	141.469.896	295.934.599	3.586.577.697	246.803.199	491.445.702	306.961.160
zum 30. September 2023	10.603.804	400.977.339	2.479.858.286	153.926.693	410.569.595	296.663.280
zum 30. September 2022	-	371.451.166	1.976.853.711	219.535.032	588.597.772	490.363.715
Im Umlauf befindliche Anteile*						
zum 30. September 2024						
Klasse A Thes.	15	72.395	7.360	71.537	218.387	6.590
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	1.752	-	2.957	-	100
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	268.393	52.308	21.747	-	147.311
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	8.060	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	100	-	-	65
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	4.291	-	140
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	346.562	-
Klasse A Aussch.	-	-	4.668	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	2.369	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	2.512	6.783	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	80.949	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	19.965	310.075	11.803	422.947	590.029	30.008
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	171.383	-	213.145	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	11.243	1.566	17.974	-	9.012
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	225.034	25.804	219.686	-	34.678
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	770.165	12.635	436.344	77.093	102.488
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	62.188	-	11
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	140
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	419.926	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	4.924	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	2.476	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	24.805	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	1
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	143.697	26.916	-	3.648	6	237.828
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	1.411	-	100
Klasse E Thes. EUR	629.115	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	5.000	-	20.102	-	1.120.627
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	139.266
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	193	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	119.483	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	7.562	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	999	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	5.307	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	286	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	468	-	-	-
Klasse I Thes.	100.015	-	239.905	-	-	101.341
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	28.062	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	110.641	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	120	-	-	103
Klasse IF Thes.	-	-	152.730	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	50.099	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Im Umlauf befindliche Anteile* (Forts.)						
zum 30. September 2024						
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	481.939	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	8.099.239	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	13.573	-	-	-
Klasse IZ Thes.	15	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes. EUR	15	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	92
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	244.400	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	32.061	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	44.878	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	21.428	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	39.258	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	51.695	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	319.778	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-	15
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	104
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	691
Klasse X Thes.	-	-	73.552	-	17.477	-
Klasse X Thes., in CHF abgesichert	-	-	4.399	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	7.397	-	-	576.733
Klasse X1 Thes.	12.505	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. EUR	163	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. GBP	3.805	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes., in GBP abgesichert	291.411	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	13.376	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	787	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.001	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	31	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	29	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	10	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	22.453	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	63.649	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	41.607	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	920	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	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
Nettoinventarwert					
zum 30. September 2024	83.892.307	332.176.697	209.834.166	363.240.779	298.683.883
zum 30. September 2023	69.593.042	331.125.967	171.437.016	378.919.128	483.606.159
zum 30. September 2022	47.516.413	-	188.469.066	694.846.015	615.538.573
Im Umlauf befindliche Anteile*					
zum 30. September 2024					
Klasse A Thes.	-	-	560.792	-	88.368
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	-	2.721	-	6.151
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	-	65.912	-	111.390
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	16.695
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	10.706	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	100	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	100	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	17	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	112	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	111	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	112	-	-	-	-
Klasse C Thes.	26.737	35.371	288.949	1.282.155	964.351
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	69.096	70.642
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	3.778	625	9.488	16.316	75.361
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	100	29.601	83.004	568.312	412.734
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	100	54.038	20.280	131.946	445.218
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	17	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	113	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	112	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	113	-	68	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	82
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	98
Klasse E Thes.	302.984	-	170	-	30.233
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	300	-	-	-	7.879
Klasse E Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	134.187	-	5.229	-	85.973
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	5.502	-	-	-	35.524
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	1.523	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	113	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	112	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	14.562	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	200.015	-	-	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	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
Im Umlauf befindliche Anteile* (Forts.)					
zum 30. September 2024					
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes.	-	26.332	-	-	-
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	1.056	-	-	-
Klasse IZ Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	3.270	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	100	-	-	-
Klasse K Thes.	-	15	-	362.412	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	100	-	383	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	100	-	42.733	-
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	100	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	30.135	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	37.863	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	266.502	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	15.762	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	493.633	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	9.165	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	240.952	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	222.493	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	37.030	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	2.386	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	7.224	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	15	-	-
Klasse X Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	68	-	-
Klasse X1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. GBP	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-

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

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil*						
zum 30. September 2024						
Klasse A Thes.	110,44	110,88	1.811,96	167,30	266,56	108,89
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	89,95	-	142,00	-	93,56
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	96,16	1.169,97	149,91	-	98,08
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	258,56	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	1.078,62	-	-	816,58
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	222,88	-	104,95
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	279,99	-
Klasse A Aussch.	-	-	1.026,63	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	246,55	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	165,07	246,96	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	266,45	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	111,12	115,77	1.845,11	176,28	292,40	115,33
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	136,36	-	103,92	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	94,29	1.313,25	151,88	-	99,49
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	99,86	1.445,51	157,29	-	104,05
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	110,26	129,70	134,78	281,23	111,02
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	1.310,62	-	858,48
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	110,90
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	307,35	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	290,87	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	270,74	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	106,17	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	5.742,87
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	103,93	118,91	-	178,67	290,29	118,84
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	154,71	-	102,26
Klasse E Thes. EUR	100,56	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	102,29	-	159,49	-	107,46
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	114,44
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	1.316,58	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	1.813,72	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.294,29	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.421,31	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	1.182,72	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	1.534,89	-	-	-
Klasse I Thes.	116,44	-	2.156,19	-	-	127,20
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.652,77	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.823,81	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	12.217,19	-	-	11.605,14
Klasse IF Thes.	-	-	1.895,12	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.452,59	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.601,57	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	1.104,98	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	1.409,32	-	-	-
Klasse IZ Thes.	112,19	-	-	-	-	-

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse ausgewiesen.

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil* (Forts.)						
zum 30. September 2024						
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	–	–	–	–	–	–
Klasse IZ Thes. EUR	100,77	–	–	–	–	–
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–	–
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	–	–	–	–	–	112,02
Klasse K Thes.	–	–	–	–	–	–
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	–	–	–	–	–	–
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–	–
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	–	–	–	–	–	–
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	–	99,12	–	–	–	–
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	–	113,15	–	–	–	–
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	–	770,00	–	–	–	–
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	–	–	1.145,30	–	–	–
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	–	–	1.192,66	–	–	–
Klasse PI Aussch.	–	–	1.042,98	–	–	–
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	–	–	103,85	–	–	–
Klasse R1 Thes.	–	–	–	–	–	–
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–	–
Klasse R2 Thes.	–	–	–	–	–	–
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	–	–	–	–	–	–
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–	–
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	–	–	–	–	–	–
Klasse R3 Thes.	–	–	–	–	–	–
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–	–
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	–	–	–	–	–	–
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	–	–	–	–	–	–
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–	–
Klasse S Aussch.	–	–	–	–	–	99,57
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–	89,58
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	–	–	–	–	–	95,65
Klasse X Thes.	–	–	1.106,05	–	289,59	–
Klasse X Thes., in CHF abgesichert	–	–	1.071,28	–	–	–
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	–	–	1.092,81	–	–	107,50
Klasse X1 Thes.	104,14	–	–	–	–	–
Klasse X1 Thes. EUR	100,71	–	–	–	–	–
Klasse X1 Thes. GBP	97,72	–	–	–	–	–
Klasse X1 Thes., in GBP abgesichert	103,76	–	–	–	–	–
Klasse Y Thes.	–	–	1.259,52	–	–	–
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	–	–	1.150,43	–	–	–
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	–	–	1.202,99	–	–	–
Klasse Y1 Thes.	–	–	1.248,84	–	–	–
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	–	–	1.139,52	–	–	–
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	–	–	1.191,30	–	–	–
Klasse Y2 Thes.	–	–	1.326,33	–	–	–
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	–	–	1.227,73	–	–	–
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	–	–	1.278,34	–	–	–
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	–	–	131,30	–	–	–

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse ausgewiesen.

Statistische Informationen (Forts.)

	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
Nettoinventarwert je Anteil*					
zum 30. September 2024					
Klasse A Thes.	-	-	197,60	-	120,90
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	-	214,34	-	101,38
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	-	167,48	-	106,71
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	161,56
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	115,15	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	102,97	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	107,57	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	106,22	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	96,87	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	107,30	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	104,59	-	-	-	-
Klasse C Thes.	116,44	116,95	209,97	147,43	126,04
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	98,25	156,47
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	104,66	112,20	224,98	123,89	105,99
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	109,18	114,59	177,97	130,43	111,29
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	114,34	116,41	191,97	139,79	95,62
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	106,17	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	96,89	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	107,36	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	104,64	-	191,72	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5.287,86
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5.583,34
Klasse E Thes.	116,88	-	229,03	-	130,81
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	105,21	-	-	-	109,66
Klasse E Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	110,01	-	194,15	-	115,37
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	114,91	-	-	-	99,10
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	106,21	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	96,90	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	107,35	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	104,67	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	119,93	-	-	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes.	-	117,83	-	-	-

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse ausgewiesen.

Statistische Informationen (Forts.)

	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
Nettoinventarwert je Anteil* (Forts.)					
zum 30. September 2024					
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	112,30	-	-	-
Klasse IZ Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	115,08	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	116,42	-	-	-
Klasse K Thes.	-	116,52	-	142,95	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	111,52	-	119,75	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	114,16	-	126,17	-
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	115,53	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	178,08	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	150,41	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	174,87	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	133,68	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	179,12	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	144,53	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	279,03	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	241,77	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	184,88	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	127,11	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	1.788,65	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	139,41	-	-
Klasse X Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	188,75	-	-
Klasse X1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. EUR	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes. GBP	-	-	-	-	-
Klasse X1 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse ausgewiesen.

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil*						
zum 30. September 2023						
Klasse A Thes.	103,42	119,50	1.603,53	128,56	213,37	108,15
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	110,05	-	111,54	-	96,67
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	111,25	1.052,51	115,71	-	99,01
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	204,70	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	970,81	-	-	822,56
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	173,74	-	106,07
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	221,32	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	205,50	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	127,11	198,09	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	211,16	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	103,91	124,02	1.626,39	134,79	233,29	113,34
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	152,99	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	114,62	1.204,97	118,45	-	101,84
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	114,89	1.295,31	121,00	-	103,92
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	144,59	114,81	102,38	222,04	109,45
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	1.010,09	-	845,57
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	110,91
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	242,23	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	232,04	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	224,88	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	142,20	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	5.612,20
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	-	127,37	-	136,88	231,50	116,33
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	119,50	-	104,06
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	117,65	-	122,68	-	106,93
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	112,36
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	1.015,76	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	146,01	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	1.604,26	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.192,37	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.277,91	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	1.141,02	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	1.507,64	-	-	-
Klasse I Thes.	105,98	-	1.877,29	-	-	123,47
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.498,81	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.613,95	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	11.257,04	-	-	11.882,66
Klasse IF Thes.	-	-	1.669,58	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.332,56	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.434,17	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	989,64	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	1.359,16	-	-	-
Klasse IZ Thes.	104,07	-	-	-	-	-

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse ausgewiesen.

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil* (Forts.)						
zum 30. September 2023						
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	110,07
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	114,00	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	148,34	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	76,69	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.053,34	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.072,86	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	1.005,10	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	99,98	-	-	-
Klasse R1 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-	104,97
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	95,76
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	100,68
Klasse X Thes.	-	-	-	-	232,34	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	106,69
Klasse Y Thes.	-	-	1.106,78	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.053,14	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.074,49	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	1.101,70	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.047,77	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.068,64	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	1.158,82	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.117,51	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	1.135,43	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	115,10	-	-	-

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse ausgewiesen.

Statistische Informationen (Forts.)

	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
Nettoinventarwert je Anteil*					
zum 30. September 2023					
Klasse A Thes.	–	–	163,29	–	115,02
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	–	–	183,69	–	100,39
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	–	–	140,61	–	103,17
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	–	–	–	–	156,51
Klasse A Thes., in USD abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse A Aussch. GBP	–	–	–	–	–
Klasse A1 Thes.	–	–	–	–	–
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse A2 Thes.	100,32	–	–	–	–
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	93,61	–	–	–	–
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	95,41	–	–	–	–
Klasse A2 Aussch.	97,92	–	–	–	–
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	93,07	–	–	–	–
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	100,58	–	–	–	–
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	96,76	–	–	–	–
Klasse C Thes.	101,02	95,45	172,50	133,25	119,01
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	–	–	–	–	154,49
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	94,69	94,37	192,37	114,57	104,18
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	96,54	94,97	148,62	119,12	106,80
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	99,59	95,33	158,68	126,47	90,62
Klasse C Aussch.	–	–	–	–	–
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	97,91	–	–	–	–
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	93,09	–	–	–	–
Klasse C Aussch. GBP	100,63	–	–	–	–
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	96,78	–	158,63	–	–
Klasse C1 Thes.	–	–	–	–	–
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	–	–	–	–	5.197,72
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	5.358,13
Klasse E Thes.	–	101,24	–	186,03	–
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	–	95,04	–	–	107,25
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	–	96,93	–	160,39	–
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	–	99,94	–	–	110,14
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	–	–	–	–	93,45
Klasse E Aussch.	–	97,95	–	–	–
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	–	93,09	–	–	–
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	–	100,62	–	–	–
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	–	96,81	–	–	–
Klasse F Thes.	–	–	–	–	–
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse F Aussch.	–	–	–	–	–
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse I Thes.	–	103,10	–	–	–
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse IF Thes.	–	–	–	–	–
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse IF Aussch.	–	–	–	–	–
Klasse IZ Thes.	–	95,49	–	–	–

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse ausgewiesen.

Statistische Informationen (Forts.)

	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
Nettoinventarwert je Anteil* (Forts.)					
zum 30. September 2023					
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	–	94,43	–	–	–
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	–	94,98	–	–	–
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	–	95,37	–	–	–
Klasse K Thes.	–	95,34	–	129,35	–
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	–	94,27	–	110,78	–
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	–	94,82	–	115,04	–
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	–	95,18	–	–	–
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse PI Aussch.	–	–	–	–	–
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse R1 Thes.	–	141,59	–	–	–
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	–	120,85	–	–	–
Klasse R2 Thes.	–	138,62	–	–	–
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	–	109,29	–	–	–
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	–	143,16	–	–	–
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	–	114,81	–	–	–
Klasse R3 Thes.	–	221,10	–	–	–
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	–	82,65	–	–	–
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	–	193,41	–	–	–
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	–	147,04	–	–	–
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	–	101,64	–	–	–
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	–	1.427,75	–	–	–
Klasse S Aussch.	–	–	–	–	–
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse X Thes.	–	–	114,39	–	–
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	–	–	157,58	–	–
Klasse Y Thes.	–	–	–	–	–
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse Y1 Thes.	–	–	–	–	–
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse Y2 Thes.	–	–	–	–	–
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	–	–	–	–	–
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	–	–	–	–	–

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse ausgewiesen.

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil*					
zum 30. September 2022					
Klasse A Thes.	136,68	1.345,81	106,59	186,47	104,38
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	119,31	-	96,44	-	97,10
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	122,62	904,45	98,41	-	97,81
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	176,34	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	831,74	-	-	809,88
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	145,99	-	103,53
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	188,49	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	181,92	-
Klasse A1 Thes.	-	-	105,91	173,99	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	180,74	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	140,99	1.359,56	110,92	202,35	108,26
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	153,00	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	123,52	1.050,27	101,64	-	101,24
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	125,89	1.108,69	102,15	-	101,65
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	134,97	96,60	85,13	189,75	105,29
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	851,28	-	819,62
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	107,12
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	204,77	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	201,28	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	197,59	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	133,88	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5.347,70
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	144,80	-	112,34	200,89	110,69
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	102,28	-	102,97
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	128,89	-	103,33	-	104,09
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	107,65
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	853,79	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	137,42	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	1.345,70	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	1.042,57	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	1.097,83	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	1.036,53	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	1.385,00	-	-	-
Klasse I Thes.	-	1.550,19	-	-	116,49
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	1.290,22	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	1.364,30	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	9.771,53	-	-	11.782,70
Klasse IF Thes.	-	1.394,92	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	1.160,68	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	1.227,01	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	843,83	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	1.233,72	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	105,58

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse ausgewiesen.

Statistische Informationen (Forts.)

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

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse ausgewiesen.

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil*					
<u>zum 30. September 2022</u>					
Klasse A Thes.	-	144,25	-	-	114,68
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	168,47	-	-	104,17
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	126,87	-	-	105,30
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	157,82
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	89,68	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	87,46	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	87,63	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	92,55	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	91,62	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	97,33	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	92,17	-	-	-	-
Klasse C Thes.	90,12	151,65	126,72	112,77	117,77
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	134,17
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	88,03	175,63	112,05	139,93	107,30
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	88,24	133,59	114,57	125,50	108,20
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	89,59	140,66	120,55	-	90,30
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	150,77	-
Klasse C Aussch.	92,55	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	91,61	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	97,33	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	92,15	140,47	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5.352,35
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5.426,56
Klasse E Thes.	90,17	162,79	-	-	121,01
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	88,22	-	-	-	109,90
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	88,45	143,73	-	-	111,01
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	89,78	-	-	-	92,66
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	92,54	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	91,60	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	97,33	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	92,15	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	91,14	-	-	121,56	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse ausgewiesen.

Statistische Informationen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil* (Forts.)					
<u>zum 30. September 2022</u>					
Klasse K Thes.	-	-	123,20	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	108,88	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	111,19	121,97	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	147,12	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	112,71	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	125,53	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	150,74	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	100,54	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	141,45	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse ausgewiesen.

Kombinierte Nettovermögensaufstellung zum 30. September 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
VERMÖGENSWERTE						
Anlagen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	129.391.424	226.468.950	3.345.563.466	183.864.229	340.538.087	246.476.217
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	2.984.719	(23.252.194)	29.653.672	35.445.972	88.273.622	24.578.563
Wertpapiere zum Marktwert	132.376.143	203.216.756	3.375.217.138	219.310.201	428.811.709	271.054.780
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	1.122.254	4.951.287	11.731.396	1.324.293	1.686.158	6.327.155
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	2.737.273	-	-	-	264.784
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	14.934.941	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	(2.435.723)	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	2.364.423	(23.190.871)
aus Differenzkontrakten	(3.646.720)	654.764	-	(5.129.464)	-	9.140.132
	(2.524.466)	20.842.542	11.731.396	(3.805.171)	4.050.581	(7.458.800)
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	2.212.427	361	5.852.451	881.597	14.219.673
Bankguthaben	15.479.219	28.619.765	163.115.288	30.155.362	32.473.043	26.429.990
Termineinlagen	-	-	-	-	-	-
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	9.929.116	-	-	-	2.150.629
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	3.085.239	32.310.835	-	9.041.973	43.975.067	7.529.398
Forderungen aus Zeichnungen	33.992.478	209.769	9.319.355	1.275.337	2.677.265	373.634
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	126.968	-	139.345
Dividenden und Zinsforderungen	560.187	1.231.063	51.350.181	349.412	692.167	3.873.725
Erstattungsforderung des Fonds	-	223.673	33.336	-	-	17.919
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	100.000	-
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	50.000	250.000	3.850.000	580.184	-	70.000
Sonstige Forderungen*	905.483	-	-	630.184	1.240.450	46.946
SUMME VERMÖGENSWERTE	183.924.283	299.045.946	3.614.617.055	263.516.901	514.901.879	318.447.239
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	41.201.886	449.056	257.506	1.709.227	8.985.312	8.237.771
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	1.036.261	1.444.279	8.070.701	2.303.290	103.309	1.884.330
Fällige Managementgebühren	66.943	273.534	2.221.300	264.181	619.840	201.163
Fällige Performancegebühren	7.669	5.461	1.960.336	11.404.180	12.881.888	-
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	40.005	64.584	-	310.366	66.088	458.288
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	-	-	-
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	6.080.000	-	-	-
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	50.000	250.000	3.850.000	580.184	-	70.000
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	100.000	-
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen**	51.623	624.433	5.599.515	142.274	699.740	634.527
SUMME VERBINDLICHKEITEN	42.454.387	3.111.347	28.039.358	16.713.702	23.456.177	11.486.079
SUMME NETTOVERMÖGEN	141.469.896	295.934.599	3.586.577.697	246.803.199	491.445.702	306.961.160

* Die sonstigen Forderungen umfassen Forderungen aus Devisenkassageschäften und verschiedene andere Forderungen.

** Die sonstigen Verbindlichkeiten und Rückstellungen beinhalten Verbindlichkeiten aus Devisenkassageschäften sowie Verbindlichkeiten aus Verwaltungs-, Depot- und sonstigen Gebühren.

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Kombinierte Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2024 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	Schroder GAIA Srios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
VERMÖGENSWERTE						
Anlagen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	78.369.050	263.925.541	142.359.623	5.164.828	257.325.809	4.723.513.630
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	3.134.096	32.791.053	40.887.563	(45.651)	9.198.344	227.856.015
Wertpapiere zum Marktwert	81.503.146	296.716.594	183.247.186	5.119.177	266.524.153	4.951.369.645
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Devisenterminkontrakten	(723.698)	753.763	(55.669)	951.651	797.139	26.102.966
aus Kassageschäften	-	-	-	714	-	641
aus Terminkontrakten	76.928	-	-	(202.693)	(3.843)	2.580.467
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	(28.112)	(56.709)	13.340.628
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	12.991	11.671
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	(183.756)	(165.077)
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	1.092.413	(1.206.765)
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	(2.843.200)	(5.568.297)	(1.341.744)	(27.230.971)
aus Differenzkontrakten	-	4.192.841	-	-	-	4.681.806
	(646.770)	4.946.604	(2.898.869)	(4.846.737)	316.491	18.115.366
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	192.163	50.927	2.257.684	222.890.679	8.030.936	230.596.645
Bankguthaben	1.794.259	25.476.930	31.645.063	116.892.540	31.852.720	456.010.881
Termineinlagen	-	-	-	234.000.000	-	210.214.261
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	14.683.006	3.270.498	26.980.415
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	142.120	7.918.060	3.610.000	9.720.386	3.046.638	112.613.301
Forderungen aus Zeichnungen	217.700	595.935	224.934	10.612.881	996.972	54.619.048
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	4.649.678	450.840	-	1.250.136	5.944.360
Dividenden und Zinsforderungen	1.347.094	821.225	254.128	130.767	790.943	55.229.950
Erstattungsforderung des Fonds	-	50.251	-	-	-	292.125
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	-	100.000
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	10.000	-	20.000	160.000	190.000	4.653.626
Sonstige Forderungen**	-	-	-	-	366.993	2.991.882
SUMME VERMÖGENSWERTE	84.559.712	341.226.204	218.810.966	609.362.699	316.636.480	6.129.731.505
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	464.003	5.072.111	929.462	234.039.656	15.682.176	285.716.085
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	43.213	270.467	619.283	484.483	824.390	15.357.944
Fällige Managementgebühren	30.939	349.646	295.194	449.371	321.804	4.639.132
Fällige Performancegebühren	-	2.347.790	6.611.211	10.012.840	-	41.943.100
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	-	301.675	312.165	623.215	759.772	2.644.420
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	12	-	-	-	-	11
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	-	-	-	5.461.977
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	10.000	-	20.000	160.000	190.000	4.653.626
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	-	100.000
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen***	119.238	707.818	189.485	352.355	174.455	8.421.721
SUMME VERBINDLICHKEITEN	667.405	9.049.507	8.976.800	246.121.920	17.952.597	368.938.016
SUMME NETTOVERMÖGEN	83.892.307	332.176.697	209.834.166	363.240.779	298.683.883	5.760.793.489

* Für die in Euro angegebene Summe der Nettovermögensaufstellung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 30. September 2024 umgerechnet: 1 Euro = 1,11315 US-Dollar.

** Die sonstigen Forderungen umfassen Forderungen aus Devisenkassageschäften und verschiedene andere Forderungen.

*** Die sonstigen Verbindlichkeiten und Rückstellungen beinhalten Verbindlichkeiten aus Devisenkassageschäften sowie Verbindlichkeiten aus Verwaltungs-, Depot- und sonstigen Gebühren.

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 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
ERTRÄGE						
Nettoddividenden^	1.234.373	340.435	–	–	3.629.154	14.738.369
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	–	2.405.558	319.734.670	–	–	694.520
Nettoertrag aus Swaps	957.602	5.279.890	–	7.491.829	1.128.293	6.714.494
Bankzinsen	157.424	4.212.658	12.390.559	1.706.863	2.417.285	1.944.681
Sonstige Erträge	–	83	–	–	161	871
SUMME ERTRÄGE	2.349.399	12.238.624	332.125.229	9.198.692	7.174.893	24.092.935
AUFWAND						
Performancegebühren	7.669	5.461	1.960.336	11.404.181	13.271.831	–
Managementgebühren	271.644	3.612.017	24.891.810	2.652.882	6.688.444	2.214.273
Nettoddividendaufwand^	–	–	–	2.025.423	–	–
Nettoaufwand aus Swaps	–	–	–	–	–	–
Verwahrstellengebühren	12.478	267.447	805.330	53.988	150.040	104.696
Verwaltungsgebühren	62.597	1.071.042	4.469.234	640.639	1.412.552	367.969
Taxe d'abonnement	15.037	162.465	457.553	106.095	228.039	106.926
Vertriebsgebühren	–	–	–	3.513	103.353	–
Bank- und Zinskosten	3.003	3.545	5.512	67	1.895	10.381
Sonstige Aufwendungen	14.480	259.594	1.028.238	109.155	1.435.191	174.238
SUMME AUFWAND	386.908	5.381.571	33.618.013	16.995.943	23.291.345	2.978.483
Abzüglich: Kostenzuschüsse	–	223.673	33.336	–	–	17.919
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	1.962.491	7.080.726	298.540.552	(7.797.251)	(16.116.452)	21.132.371

^ Einschließlich erhaltene/gezahlte Dividenden im Zusammenhang mit Derivaten mit zugrunde liegenden Anteilswerten.

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024 (Forts.)

	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	Summe* EUR
ERTRÄGE						
Nettoddividenden^	24.610	43.392	581.602	259.650	-	19.100.952
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	5.457.924	-	78.248	12.491.728	801.026	306.934.088
Nettoertrag aus Swaps	-	646.106	1.003.354	-	493.253	21.418.935
Bankzinsen	146.787	1.807.414	1.131.725	6.882.835	2.108.418	31.604.155
Sonstige Erträge	49.999	60.827	129	-	566	101.203
SUMME ERTRÄGE	5.679.320	2.557.739	2.795.058	19.634.213	3.403.263	379.159.333
AUFWAND						
Performancegebühren	-	2.347.790	6.611.211	10.012.840	-	42.333.043
Managementgebühren	369.716	4.268.714	3.147.167	5.687.111	4.434.162	52.998.013
Nettoddividendaufwand^	-	-	-	-	64.608	1.877.583
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	-	20.094.038	-	18.051.510
Verwahrstellengebühren	64.087	84.920	50.920	105.015	152.898	1.678.836
Verwaltungsgebühren	121.140	475.018	596.562	1.195.164	1.102.933	10.487.967
Taxe d'abonnement	30.116	104.752	96.767	185.506	160.442	1.508.782
Vertriebsgebühren	-	-	-	-	-	106.509
Bank- und Zinskosten	65.443	785	3.485	-	8.788	92.637
Sonstige Aufwendungen	31.186	144.149	81.886	109.063	309.299	3.466.622
SUMME AUFWAND	681.688	7.426.128	10.587.998	37.388.737	6.233.130	132.601.502
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	37.955	-	-	-	281.079
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	4.997.632	(4.830.434)	(7.792.940)	(17.754.524)	(2.829.867)	246.838.910

* Für die in Euro angegebene Summe der Ertrags- und Aufwandsrechnung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit dem folgenden Wechselkurs vom 30. September 2024 umgerechnet: 1 Euro = 1,11315 US-Dollar.

^ Einschließlich erhaltene/gezahlte Dividenden im Zusammenhang mit Derivaten mit zugrunde liegenden Anteilswerten.

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Kombinierte Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 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
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)*	1.962.491	7.080.726	298.540.552	(7.797.251)	(16.116.452)	21.132.371
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	1.304.918	(2.672.890)	598.067	48.706.148	53.724.349	21.981.499
aus Devisenterminkontrakten	2.051.458	(8.764.642)	77.240.882	6.703.651	2.882.050	5.328.689
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	(8.690.748)	-	-	-	(15.265.959)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	(7.332.270)	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	8.295.014	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	8.269.112	(64.854.043)
aus Differenzkontrakten	(2.027.349)	-	-	(2.733.362)	-	28.125.364
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	4.373.120	-	1.245.153	-	(144.216)
aus Devisengeschäften	(54.414)	(281.303)	(998.702)	82.693	(1.771.572)	(3.989.140)
REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST)	1.274.613	(15.073.719)	76.840.247	54.004.283	63.103.939	(28.817.806)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)						
aus Anlagen	2.882.616	830.491	103.887.242	25.055.670	46.173.534	31.691.165
aus Devisenterminkontrakten	1.248.265	6.418.093	5.311.049	1.630.734	4.385.815	9.316.478
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	(4.798.223)	-	-	-	(2.089.822)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	9.174.256	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	(11.656.188)	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	(6.635.921)	(32.278.607)
aus Differenzkontrakten	(3.822.279)	504.583	-	(7.332.058)	-	16.308.709
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	(9.970)	-	(255.617)	-	(81.976)
aus Devisengeschäften	(85.836)	749.830	8.041	(2.473)	(12.481)	1.496.077
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	222.766	1.212.872	109.206.332	19.096.256	43.910.947	24.362.024
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	3.459.870	(6.780.121)	484.587.131	65.303.288	90.898.434	16.676.589
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	132.952.734	50.445.029	1.238.109.427	138.984.210	139.137.043	91.386.413
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(5.546.512)	(148.257.707)	(605.791.359)	(111.410.992)	(149.159.370)	(97.757.458)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	(449.941)	(10.185.788)	-	-	(7.664)
ZUWACHS/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS WÄHREND DES GESCHÄFTSJAHRES	130.866.092	(105.042.740)	1.106.719.411	92.876.506	80.876.107	10.297.880
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahrs	10.603.804	400.977.339	2.479.858.286	153.926.693	410.569.595	296.663.280
Nennwährungsanpassung**	-	-	-	-	-	-
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	141.469.896	295.934.599	3.586.577.697	246.803.199	491.445.702	306.961.160

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

** Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2023 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 30. September 2024.

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Kombinierte Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA SEG US Equity USD	GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe* EUR
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)**	4.997.632	(4.830.434)	(7.792.940)	(17.754.524)	(2.829.867)	246.838.910
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	751.668	20.030.431	24.047.299	(310)	37.647.845	190.628.343
aus Devisenterminkontrakten	1.711.351	5.247.721	(347.576)	6.331.299	8.524.424	96.335.097
aus Kassageschäften	-	-	-	(94.008)	-	(84.452)
aus Terminkontrakten	101.511	-	-	7.834.650	40.585	(14.355.623)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	(1.343.845)	(1.207.245)
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	846.660	(526.109)	(6.298.989)
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	8.018	7.203
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	(102.575)	(92.148)
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	(2.744.015)	4.986.749
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	(2.304.543)	58.938.737	(8.450.137)	(6.706.396)
aus Differenzkontrakten	-	11.693.112	-	-	-	31.494.197
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	3.254.198	(129.344)	-	(960.891)	6.861.627
aus Devisengeschäften	106.676	(222)	(3.978)	33.778	(1.871.375)	(8.038.461)
REALISIERTER NETTOGEWINN/(-VERLUST)	2.671.206	40.225.240	21.261.858	73.890.806	30.221.925	293.529.902
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)						
aus Anlagen	6.022.022	43.601.898	29.227.917	13.993	1.677.958	266.171.717
aus Devisenterminkontrakten	(1.974.406)	2.195.464	(185.513)	1.322.213	132.742	27.217.524
aus Kassageschäften	-	-	-	(16.773)	-	(15.068)
aus Terminkontrakten	76.928	-	-	(3.417.267)	(392.647)	(9.541.421)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	854.319	767.479
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	79.516	196.175	8.489.375
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	(6.453)	(5.797)
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	(374.515)	(336.445)
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	1.706.843	(8.938.009)
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	(5.046.520)	(10.415.064)	(2.699.688)	(51.948.662)
aus Differenzkontrakten	-	2.425.320	-	-	-	7.262.522
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	1.536.178	10.812	-	(478.018)	648.077
aus Devisengeschäften	(950)	64	1.258	126.534	405.139	2.410.987
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	4.123.594	49.758.924	24.007.954	(12.306.848)	1.021.855	242.182.279
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	11.792.432	85.153.730	37.476.872	43.829.434	28.413.913	782.551.091
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	14.378.762	86.358.782	24.482.637	151.072.930	61.274.558	1.926.358.458
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(11.726.541)	(170.461.782)	(23.562.359)	(210.580.713)	(274.610.747)	(1.640.158.966)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	(145.388)	-	-	-	-	(9.692.118)
ZUWACHS/(ABNAHME) DES NETTOVERMÖGENS WÄHREND DES GESCHÄFTSJAHRES	14.299.265	1.050.730	38.397.150	(15.678.349)	(184.922.276)	1.059.058.465
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahrs	69.593.042	331.125.967	171.437.016	378.919.128	483.606.159	4.928.621.911
Nennwährungsanpassung ***	-	-	-	-	-	(226.886.887)
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	83.892.307	332.176.697	209.834.166	363.240.779	298.683.883	5.760.793.489

* Für die in Euro angegebene Summe der Veränderung des Nettovermögens wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit dem folgenden Wechselkurs vom 30. September 2024 umgerechnet: 1 Euro = 1,11315 US-Dollar.

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

*** Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2023 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 30. September 2024.

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short %	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	52,28	68,67	91,45	-	-	22,21
Sonstige Wertpapiere						
Werbung	-	-	-	-	-	-
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	-	-	7,20	0,02
Bekleidung	3,15	-	-	-	-	2,06
Automobilhersteller	-	-	-	-	-	0,50
Autoteile und -zubehör	-	-	-	-	-	1,35
Banken	4,14	-	-	-	4,64	11,22
Getränke	-	-	-	-	-	1,02
Biotechnologie	-	-	-	-	0,39	-
Baustoffe	-	-	-	-	3,51	0,07
Chemie	-	-	-	-	-	0,54
Kohle	-	-	-	-	-	-
Gewerbliche Dienstleistungen	2,98	-	-	6,31	-	1,01
Computer	-	-	-	5,43	0,32	0,67
Kosmetik und Körperpflege	-	-	-	-	-	0,31
Vertrieb und Großhandel	-	-	-	-	-	-
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	-	0,93	7,46	1,50
Elektrik	-	-	-	-	-	0,70
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	-	0,26
Elektronik	2,39	-	-	8,22	-	2,59
Energie – Alternative Energiequellen	-	-	-	-	0,59	0,06
Bau- und Ingenieurswesen	-	-	-	-	-	0,57
Unterhaltung	-	-	-	-	2,92	-
Umweltschutz	-	-	-	-	-	-
Lebensmittel	-	-	-	-	0,96	2,68
Gastronomie	-	-	-	-	0,31	-
Gas	-	-	-	-	-	0,09
Gesundheitswesen – Produkte	-	-	-	-	3,63	0,02
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	1,50	-	-	-	-	0,47
Holdinggesellschaften – Diversifiziert	-	-	-	-	-	0,23
Wohngebäude-Bauträger	-	-	-	-	-	-
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	0,13	0,59
Haushaltswaren	1,05	-	-	-	-	0,34
Versicherung	0,82	-	2,66	-	17,67	1,72
Internet	-	-	-	11,61	15,30	0,68
Investmentgesellschaften	-	-	-	-	-	8,54
Eisen und Stahl	-	-	-	-	-	0,09
Freizeit	0,32	-	-	-	-	0,12
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	0,65	-
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	1,00	1,56	0,23
Maschinen – Diversifiziert	-	-	-	-	-	-
Medien	-	-	-	4,01	-	0,07
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	-	-
Bergbau	-	-	-	-	-	0,66
Diverse Fertigungsbetriebe	-	-	-	-	-	0,08
Öl und Gas	-	-	-	-	-	2,31

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short %	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)						
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	-	-
Pharmazeutika	-	-	-	-	3,05	1,54
Pipelines	-	-	-	-	-	-
Immobilien	1,01	-	-	-	-	1,52
Einzelhandel	0,77	-	-	3,87	-	1,77
Halbleiter	23,16	-	-	9,88	-	16,74
Software	-	-	-	29,38	12,36	0,08
Telekommunikation	-	-	-	8,22	-	1,07
Transport	-	-	-	-	4,61	-
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	93,57	68,67	94,11	88,86	87,26	88,30
Termineinlagen	-	-	-	-	-	-
Sonstiges Nettovermögen	6,43	31,33	5,89	11,14	12,74	11,70
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA SEG US Equity %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	97,15	5,03	15,03	0,03	55,96
Sonstige Wertpapiere					
Werbung	-	-	-	-	0,09
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	4,20	-	0,26
Bekleidung	-	-	0,03	-	0,22
Automobilhersteller	-	-	1,02	-	-
Autoteile und -zubehör	-	-	-	-	-
Banken	-	-	1,66	-	5,31
Getränke	-	-	0,43	-	-
Biotechnologie	-	-	-	-	2,11
Baustoffe	-	4,80	-	-	0,10
Chemie	-	-	0,16	-	-
Kohle	-	-	-	-	0,03
Gewerbliche Dienstleistungen	-	4,19	2,17	-	0,37
Computer	-	-	0,64	-	0,36
Kosmetik und Körperpflege	-	-	0,15	-	0,19
Vertrieb und Großhandel	-	4,15	-	-	0,06
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	0,21	-	2,64
Elektrik	-	-	1,82	-	0,79
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	1,17	-	0,05
Elektronik	-	6,64	-	-	0,23
Energie – Alternative Energiequellen	-	-	-	-	0,23
Bau- und Ingenieurswesen	-	2,93	-	-	0,02
Unterhaltung	-	8,25	-	-	0,43
Umweltschutz	-	2,43	1,97	-	-
Lebensmittel	-	-	0,13	-	0,06
Gastronomie	-	-	-	-	-
Gas	-	-	-	-	0,44
Gesundheitswesen – Produkte	-	1,55	12,58	-	0,97
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	1,53	1,63	-	1,00
Holdinggesellschaften – Diversifiziert	-	-	-	-	-
Wohngebäude-Bauträger	-	-	0,06	-	-
Heimeinrichtungsgegenstände	-	6,76	-	-	0,08
Haushaltswaren	-	-	-	-	-
Versicherung	-	4,80	-	-	2,39
Internet	-	4,38	6,46	-	1,15
Investmentgesellschaften	-	-	2,61	1,38	1,68
Eisen und Stahl	-	-	-	-	-
Freizeit	-	-	1,17	-	-
Beherbergungsunternehmen	-	-	0,10	-	0,13
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	6,88	-	0,27
Maschinen – Diversifiziert	-	12,71	1,09	-	0,16
Medien	-	-	-	-	0,09
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	0,07
Bergbau	-	-	-	-	0,44
Diverse Fertigungsbetriebe	-	4,95	-	-	0,30
Öl und Gas	-	-	-	-	5,96

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA SEG US Equity %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)					
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	0,36
Pharmazeutika	-	-	3,17	-	1,28
Pipelines	-	-	-	-	0,60
Immobilien	-	-	0,24	-	0,51
Einzelhandel	-	5,35	1,23	-	0,50
Halbleiter	-	2,49	8,62	-	0,60
Software	-	6,38	8,32	-	0,51
Telekommunikation	-	-	0,18	-	0,12
Transport	-	-	2,20	-	0,11
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	97,15	89,32	87,33	1,41	89,23
Termineinlagen	-	-	-	64,42	-
Sonstiges Nettovermögen	2,85	10,68	12,67	34,17	10,77
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Anlageportfolio zum 30. September 2024

Schroder GAIA Asian Equity Long Short

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
Indonesien			4.138.104	2,93
7.495.600	IDR	Bank Mandiri Persero	3.428.469	2,43
2.008.200	IDR	Bank Negara Indonesia Persero	709.635	0,50
Philippinen			7.047.282	4,98
607.330	PHP	BDO Unibank	1.712.392	1,21
390.110	PHP	International Container Terminal Services	2.812.481	1,99
2.479.800	PHP	SM Prime Holdings	1.429.356	1,01
3.347.100	PHP	Wilcon Depot	1.093.053	0,77
Südkorea			8.250.705	5,83
118.171	KRW	Samsung Electronics	5.557.479	3,93
4.405	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	1.160.452	0,82
11.480	KRW	SK Hynix	1.532.774	1,08
Taiwan			36.847.878	26,05
574.000	TWD	ASE Technology Holding	2.738.818	1,94
102.000	TWD	Chroma ATE	1.203.830	0,85
259.000	TWD	Eclat Textile	4.460.367	3,15
102.000	TWD	MediaTek	3.787.149	2,68
62.000	TWD	Merida Industry	450.603	0,32
92.000	TWD	Nien Made Enterprise	1.482.628	1,05
203.750	TWD	Sporton International	1.406.771	0,99
633.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	19.142.116	13,53
34.000	TWD	Voltronic Power Technology	2.175.596	1,54
Thailand			2.124.870	1,50
2.279.100	THB	Bangkok Dusit Medical Services	2.124.870	1,50
Summe Aktien			58.408.839	41,29
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			58.408.839	41,29

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
USA			73.967.304	52,28
6.115.000	USD	United States Treasury Bill 03/10/24, ZCP	6.113.262	4,32
6.115.000	USD	United States Treasury Bill 10/10/24, ZCP	6.107.188	4,32
10.000.000	USD	United States Treasury Bill 17/10/24, ZCP	9.977.329	7,04
6.100.000	USD	United States Treasury Bill 24/10/24, ZCP	6.080.136	4,30
6.100.000	USD	United States Treasury Bill 31/10/24, ZCP	6.074.215	4,29
8.000.000	USD	United States Treasury Bill 07/11/24, ZCP	7.959.538	5,63
6.115.000	USD	United States Treasury Bill 14/11/24, ZCP	6.079.499	4,30
8.581.000	USD	United States Treasury Bill 21/11/24, ZCP	8.525.324	6,03
8.590.000	USD	United States Treasury Bill 29/11/24, ZCP	8.525.221	6,03
8.595.000	USD	United States Treasury Bill 05/12/24, ZCP	8.525.592	6,02
Summe Anleihen			73.967.304	52,28
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			73.967.304	52,28
Summe Kapitalanlagen			132.376.143	93,57
Sonstiges Nettovermögen			9.093.753	6,43
Nettoinventarwert			141.469.896	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA BlueTrend

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige übertragbare Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen									
USA			183.609.906	62,04					
15.000.000	USD	United States Treasury Note 15/10/24, 0,63%	14.975.699	5,06					
39.000.000	USD	United States Treasury Note 15/11/24, 0,75%	38.805.227	13,12					
37.000.000	USD	United States Treasury Note 30/11/24, 2,13%	36.841.079	12,45					
7.000.000	USD	United States Treasury Note 30/11/24, 4,50%	6.997.555	2,36					
2.500.000	USD	United States Treasury Note 15/12/24, 1,00%	2.481.767	0,84					
29.000.000	USD	United States Treasury Note 31/01/25, 4,13%	28.953.669	9,78					
16.000.000	USD	United States Treasury Note 28/02/25, 1,13%	15.785.357	5,33					
3.000.000	USD	United States Treasury Note 28/02/25, 2,75%	2.980.030	1,01					
3.000.000	USD	United States Treasury Note 28/02/25, 4,63%	3.002.486	1,01					
2.000.000	USD	United States Treasury Note 31/03/25, 0,50%	1.962.299	0,66					
1.500.000	USD	United States Treasury Note 31/03/25, 3,88%	1.496.428	0,51					
30.000.000	USD	United States Treasury Note 30/04/25, 0,38%	29.328.310	9,91					
Summe Anleihen			183.609.906	62,04					
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind									
			183.609.906	62,04					
Anleihen									
Irland								19.606.850	6,63
		1.146.599.434 USD	Star Compass Public 10/12/25, ZCP					19.606.850	6,63
Summe Anleihen								19.606.850	6,63
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere								19.606.850	6,63
Summe Kapitalanlagen								203.216.756	68,67
Sonstiges Nettovermögen								92.717.843	31,33
Nettoinventarwert								295.934.599	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen									
Bermuda		266.915.153	7,45		9.750.000	USD	Sanders Re III Series B 07/06/25, variabel	10.227.750	0,29
33.650.000	USD	Acorn Re 07/11/24, variabel	33.650.000	0,95	8.750.000	USD	Sanders Re III 07/04/26, variabel	7.929.250	0,22
10.263.000	USD	Baldwin Re 07/07/25, variabel	10.359.472	0,29	6.256.000	USD	Tailwind Re Series A 08/01/25, variabel	6.224.720	0,17
2.667.000	USD	Blue Halo Re Series A 24/02/25, variabel	2.665.667	0,07	14.958.000	USD	Tailwind Re Series B 08/01/25, variabel	14.955.008	0,43
3.500.000	USD	Blue Halo Re Series B 24/02/25, variabel	3.518.200	0,10	9.902.000	USD	Tailwind Re Series C 08/01/25, variabel	9.845.559	0,27
500.000	USD	Bowline Re Series 2022-1A 23/05/25, variabel	510.700	0,01	250.000	USD	Tailwind Re Series D 08/01/25, variabel	250.650	0,01
2.500.000	USD	Citrus Re Series A 07/06/27, variabel	2.593.875	0,07			Irland	40.616.939	1,13
4.500.000	USD	Citrus Re Series B 07/06/27, variabel	4.713.975	0,13	8.750.000	EUR	King Max Re Designated Activity 06/01/27, variabel	9.725.939	0,27
37.102	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	15.950	-	30.000.000	USD	Queen Street 2023 Re DAC 08/12/25, variabel	30.891.000	0,86
11.792.000	USD	Four Lakes Re 07/01/25, variabel	11.869.827	0,33			Singapur	70.803.751	1,97
2.600.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	2.620.020	0,07	54.825.000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	54.992.216	1,53
5.000.000	USD	Integrity Re 12/06/28, variabel	6.500	-	1.125.000	USD	Phoenix 2 Re 04/01/38, ZCP	1.591.423	0,04
13.847.717	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variabel	12.289.848	0,34	3.000.000	USD	Phoenix 2 Re Series 24B 04/01/38, ZCP	3.273.053	0,09
12.087.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variabel	11.742.521	0,33	4.012.000	USD	Phoenix 3 Re 04/01/29, ZCP	4.625.825	0,13
4.380.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B1 21/04/25, variabel	4.425.114	0,12	10.000.000	NZD	Totara Re 08/06/27, 13.39%	6.321.234	0,18
4.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C1 21/04/25, variabel	4.800.350	0,13	16.750.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 31/03/26, variabel	17.033.913	0,48
9.000.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B2 20/04/26, variabel	8.969.850	0,25	9.000.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 29/12/27, variabel	9.140.850	0,25
4.100.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C2 20/04/26, variabel	4.089.750	0,11	10.000.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 24/04/28, variabel	10.169.000	0,29
11.869.471	USD	Kilimanjaro III Re 08/01/27, variabel	10.534.156	0,29	3.000.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 24/04/28, variabel	3.020.850	0,08
507.166	USD	Manatee Re III 08/06/26, variabel	92.837	-	9.520.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series D 24/04/28, variabel	9.619.960	0,27
10.000.000	USD	Montoya Re 07/04/25, variabel	10.162.000	0,28			Summe Anleihen	427.320.416	11,92
16.000.000	USD	Nakama Re 14/01/25, variabel	16.051.200	0,46			Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	427.320.416	11,92
7.000.000	USD	Puerto Rico Parametric Re 07/06/27, variabel	7.345.450	0,20					
16.500.000	USD	Sanders Re II Series A 07/04/25, variabel	16.650.150	0,47					
24.947.000	USD	Sanders Re II Series A1 07/04/25, variabel	25.211.438	0,71					
12.130.000	USD	Sanders Re III Series A 07/06/25, variabel	12.593.366	0,35					

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens			Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung								
Anleihen											
Bermuda		1.983.358.334	55,29								
27.329.000	USD	2001 Cat Re 08/01/27, variabel		27.324.901	0,76	6.750.000	USD	12.478.000	USD	Charles River Re 10/05/27, variabel	12.872.305
11.000.000	USD	Alamo Re Series A 07/06/26, variabel		11.513.700	0,32	12.000.000	USD	Citrus Re 07/06/25, variabel		6.932.925	0,19
8.740.000	USD	Alamo Re Series C 07/06/26, variabel		9.220.263	0,26	5.000.000	USD	Citrus Re Series A 07/06/26, variabel		12.550.800	0,35
34.826.000	USD	Alamo Re Series A 07/06/27, variabel		36.006.600	1,00	11.785.000	USD	Citrus Re Series B 07/06/26, variabel		5.195.500	0,14
4.879.000	USD	Alamo Re Series B 07/06/27, variabel		5.056.108	0,14	20.000.000	USD	Commonwealth Re 08/07/25, variabel		12.049.573	0,34
7.076.000	USD	Aquila Re I Series 2023-1B 08/06/26, variabel		7.485.700	0,21	199.927	USD	Easton Re 08/01/27, variabel		20.131.000	0,56
8.971.000	USD	Aquila Re I Series 2023-1C 08/06/26, variabel		9.558.152	0,27	447.546	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP		4.598	-
7.750.000	USD	Aquila Re I Series 2023-1A 07/06/27, variabel		7.892.988	0,22	504.758	USD	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP		67.580	-
6.526.000	USD	Aquila Re I Series 2023-1B 07/06/27, variabel		6.828.154	0,19	25.714	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP		246.423	0,01
8.030.000	USD	Aragonite Re 07/04/27, variabel		8.258.454	0,23	11.300.000	USD	Eden Re II Series A 19/03/27, ZCP		77.787	-
5.707.000	USD	Ashera Re 07/04/27, variabel		5.786.042	0,16	40.589.000	USD	Eden Re II Series B 19/03/27, ZCP		512.802	0,01
5.511.000	USD	Baldwin Re 07/07/27, variabel		5.656.215	0,16	33.716.000	USD	Eden Re II 17/03/28, ZCP		13.354.340	0,37
4.600.000	USD	Bayou Re Series A 26/05/26, variabel		4.898.080	0,14	17.000.000	USD	Everglades Re II 13/05/27, variabel		42.381.003	1,19
2.000.000	USD	Bayou Re Series B 26/05/26, variabel		2.199.600	0,06	1.250.000	USD	Finca Re 06/06/25, variabel		27.681.990	0,04
9.283.000	USD	Bayou Re Series A 30/04/27, variabel		9.622.294	0,27	9.223.000	USD	FloodSmart Re IV 07/04/26, variabel		9.614.055	0,27
2.000.000	USD	Bayou Re Series B 30/04/27, variabel		2.137.100	0,06	27.020.000	USD	First Coast Re 07/04/26, variabel		2.280.938	0,06
6.250.000	USD	Blue Ridge Re Series A 08/01/27, variabel		6.400.000	0,18	8.750.000	USD	FloodSmart Re Series A 12/03/27, variabel		4.792.950	0,13
1.500.000	USD	Blue Ridge Re Series B 08/01/27, variabel		1.545.525	0,04	2.250.000	USD	FloodSmart Re Series B 12/03/27, variabel		43.642.900	1,23
3.500.000	EUR	Blue Sky Re DAC 26/01/27, variabel		3.970.439	0,11	19.308.000	USD	FloodSmart Re Series C 12/03/27, variabel		10.297.500	0,29
19.996.000	USD	Bonanza Re 23/12/24, variabel		20.094.980	0,56	4.500.000	USD	Foundation Re IV 08/01/27, variabel		18.471.600	0,52
13.500.000	USD	Bonanza Re 16/03/25, variabel		13.425.750	0,37	41.462.000	USD	Four Lakes Re 07/01/26, variabel		9.277.200	0,26
6.750.000	USD	Bonanza Re 08/01/26, variabel		7.013.925	0,20	10.000.000	USD	Frontline Re 06/07/26, variabel		4.083.200	0,11
3.333.000	USD	Bowline Re 23/05/25, variabel		3.407.326	0,10	18.000.000	USD	Four Lakes Re 07/01/27, variabel		610.973	0,02
11.000.000	USD	Cape Lookout Re 28/03/25, variabel		11.222.200	0,31	9.000.000	USD	Charles River Re 10/05/27, variabel			
8.405.000	USD	Cape Lookout Re 28/04/26, variabel		8.784.066	0,24	4.000.000	USD	Citrus Re 07/06/25, variabel			
28.169.000	USD	Cape Lookout Re 05/04/27, variabel		28.781.676	0,80	1.546.766	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP			

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden						Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung		Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung		Marktwert USD	% des Nettovermögens	
10.000.000	USD	Fuchsia 2023-1 - London Bridge 2 PCC 06/04/27, variabel	10.566.500	0,29	5.250.000	USD	Lower Ferry Re Series A 08/07/26, variabel	5.424.825	0,15	
5.750.000	USD	Galileo Re 08/01/26, variabel	5.900.075	0,16	9.750.000	USD	Lower Ferry Re Series B 08/07/26, variabel	10.086.863	0,28	
13.511.000	USD	Galileo Re 07/01/28, variabel	13.946.054	0,39	2.000.000	USD	Mangrove Risk Solutions Bermuda 10/05/25, ZCP	1.889.200	0,05	
12.180.000	USD	Gateway Re II 27/04/26, variabel	12.999.714	0,36	9.500.000	USD	Marlon Series A 07/06/27, variabel	9.606.400	0,27	
833.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	838.248	0,02	5.000.000	USD	Marlon Series B 07/06/27, variabel	5.300.250	0,15	
1.866.569	USD	Herbie Re 08/01/26, variabel	1.399.927	0,04	10.250.000	USD	Matterhorn Re 24/03/25, variabel	10.443.725	0,29	
6.000.000	USD	Herbie Re 08/01/27, variabel	6.627.000	0,18	11.500.000	USD	Matterhorn Re Series A 24/03/25, variabel	11.667.900	0,33	
9.000.000	USD	Herbie Re 07/01/28, variabel	8.435.700	0,24	14.750.000	USD	Matterhorn Re 08/12/25, variabel	14.198.350	0,40	
4.000.000	USD	Herbie Re 08/01/28, variabel	3.717.800	0,10	4.608.034	USD	Matterhorn Re 08/01/27, variabel	4.124.190	0,11	
14.150.000	USD	Hestia Re 22/04/25, variabel	13.230.250	0,37	5.250.000	USD	Matterhorn Re 25/01/27, variabel	7.625.843	0,21	
2.250.000	USD	Hestia Re 07/04/26, variabel	2.370.600	0,07	5.250.000	USD	Mayflower Re Series A 08/07/26, variabel	5.432.700	0,15	
2.250.000	EUR	Hexagon IV Re 21/01/26, variabel	2.489.309	0,07	6.750.000	USD	Mayflower Re Series B 08/07/26, variabel	5.472.600	0,15	
2.812.000	EUR	Hexagon IV Re 21/01/28, variabel	3.192.781	0,09	15.000.000	USD	Mayflower Re 08/07/27, variabel	6.978.488	0,19	
12.250.000	USD	High Point Re 06/01/27, variabel	12.550.738	0,35	14.000.000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/25, variabel	15.144.000	0,42	
14.258.000	USD	Hypatia 08/04/26, variabel	14.911.729	0,42	30.000.000	USD	Merna Reinsurance II Series 2 07/07/25, variabel	14.529.200	0,41	
3.500.000	USD	Integrity Re 06/06/25, variabel	612.500	0,02	16.031.000	USD	Merna Reinsurance II Series 3 07/07/25, variabel	31.223.999	0,87	
12.941.000	USD	Integrity Re Series A 06/06/25, variabel	13.842.988	0,39	18.641.000	USD	Merna Reinsurance II Series A 07/07/26, variabel	16.826.138	0,47	
3.215.000	USD	Integrity Re Series B 06/06/26, variabel	3.385.556	0,09	21.866.000	USD	Merna Reinsurance II Series B 07/07/26, variabel	19.696.081	0,55	
1.500.000	USD	Integrity Re Series D 06/06/26, variabel	1.611.450	0,04	20.000.000	USD	Merna Reinsurance II Series A 07/07/27, variabel	22.858.716	0,64	
18.043.000	USD	Kendall Re 30/04/27, variabel	18.740.362	0,52	44.873.000	USD	Merna Reinsurance II Series B 07/07/27, variabel	20.891.000	0,58	
14.857.000	USD	Kilimanjaro III Re 21/04/25, variabel	15.237.339	0,42	23.750.000	USD	Merna Reinsurance II Series C 07/07/27, variabel	47.100.943	1,32	
29.844.000	USD	Kilimanjaro III Re 25/06/25, variabel	30.570.700	0,85	8.250.000	USD	Mona Lisa Re 08/07/25, variabel	24.253.500	0,68	
14.964.000	USD	Kilimanjaro III Re 20/04/26, variabel	14.337.008	0,40	8.714.000	USD	Mona Lisa Re Series A 08/01/26, variabel	8.720.250	0,24	
2.250.000	USD	Kilimanjaro II Re Series A 30/06/28, variabel	2.313.675	0,06	8.289.000	USD	Mona Lisa Re Series B 08/01/26, variabel	9.201.113	0,26	
3.761.000	USD	Kilimanjaro II Re Series B 30/06/28, variabel	3.919.150	0,11	10.962.000	USD	Mona Lisa Re 25/06/27, variabel	8.973.257	0,25	
6.906.000	USD	Locke Tavern Re 09/04/26, variabel	7.126.992	0,20	5.667.000	USD	Montoya Re 07/04/26, variabel	11.807.170	0,33	
5.000.000	USD	Longleaf Pine Re 25/05/27, variabel	5.436.750	0,15			Montoya Re 07/04/27, variabel	5.852.878	0,16	

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens			Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung								
10.500.000	USD	Mountain Re 05/06/26, variabel		10.916.325	0,30	10.000.000	USD	Sanders Re III Series A 07/04/27, variabel		10.558.000	0,29
22.500.000	USD	Mystic Re IV Series A 08/01/25, variabel		22.641.750	0,63	37.800.000	USD	Sanders Re III 07/04/28, variabel		39.234.509	1,10
6.500.000	USD	Mystic Re IV Series B 08/01/25, variabel		6.566.625	0,18	6.829.000	USD	Solomon Re 08/06/26, variabel		7.008.944	0,20
14.250.000	USD	Mystic Re IV 08/01/26, variabel		14.971.763	0,42	7.875.000	USD	Stabilitas Re 05/06/26, variabel		8.107.313	0,23
29.915.000	USD	Mystic Re IV 08/01/27, variabel		30.917.152	0,86	22.475.000	USD	Sutter Re Series B 19/06/26, variabel		23.282.976	0,65
6.602.000	USD	Nakama Re Series 1 09/05/28, variabel		6.617.515	0,18	12.281.000	USD	Sutter Re Series E 19/06/26, variabel		12.829.347	0,36
8.111.000	USD	Nakama Re Series 2 09/05/28, variabel		8.280.925	0,23	17.107.000	USD	Titania Re 27/12/24, variabel		17.151.478	0,48
3.750.000	USD	Nature Coast Re 07/12/26, variabel		3.890.438	0,11	2.708.000	USD	Titania Re 27/02/26, variabel		2.891.467	0,08
5.000.000	USD	Nature Coast Re 07/06/28, variabel		5.315.750	0,15	9.250.000	USD	Tomoni Re Series A 07/04/26, variabel		9.324.000	0,26
13.918.000	USD	Northshore Re II 08/07/25, variabel		14.425.311	0,40	11.975.000	USD	Tomoni Re Series B 07/04/26, variabel		11.984.580	0,33
10.000.000	USD	Ocelot Re 07/01/27, variabel		10.097.000	0,28	8.250.000	USD	Tomoni Re Series A 05/04/28, variabel		8.273.513	0,23
14.864.000	USD	Palm Re 07/06/27, variabel		15.520.989	0,43	6.171.000	USD	Tomoni Re Series B 05/04/28, variabel		6.291.952	0,18
27.250.000	USD	Phoenician Re 14/12/24, variabel		27.290.875	0,76	20.000.000	USD	Torrey Pines Re Series A 06/06/25, variabel		20.166.000	0,56
2.250.000	USD	Power Protective Re 09/10/24, variabel		2.246.625	0,06	5.000.000	USD	Torrey Pines Re Series B 06/06/25, variabel		5.066.500	0,14
8.000.000	USD	Purple Re 24/04/26, variabel		8.580.800	0,24	10.433.000	USD	Torrey Pines Re Series A 05/06/26, variabel		10.662.004	0,30
9.653.000	USD	Purple Re 05/06/26, variabel		10.190.672	0,28	4.875.000	USD	Torrey Pines Re Series B 05/06/26, variabel		5.056.106	0,14
20.874.000	USD	Purple Re 07/06/27, variabel		21.558.667	0,60	3.500.000	USD	Torrey Pines Re Series C 05/06/26, variabel		3.602.200	0,10
8.250.000	USD	Ramble Re 05/03/27, variabel		8.034.675	0,22	21.500.000	USD	Torrey Pines Re Series A 07/06/27, variabel		22.220.250	0,62
23.000.000	USD	Riverfront Re Series A 07/01/25, variabel		22.979.300	0,64	13.000.000	USD	Torrey Pines Re Series B 07/06/27, variabel		13.411.450	0,37
5.750.000	USD	Riverfront Re Series B 07/01/25, variabel		5.775.300	0,16	21.366.000	USD	Ursa Re II 06/12/24, variabel		21.357.454	0,60
6.500.000	USD	Sabine Re 07/04/27, variabel		6.769.750	0,19	12.250.000	USD	Ursa Re II Series A 16/06/25, variabel		12.355.963	0,34
19.872.000	USD	Sakura Re Series A 07/04/25, variabel		20.001.168	0,56	5.250.000	USD	Ursa Re II Series E 16/06/25, variabel		5.290.688	0,15
20.000.000	USD	Sakura Re Series B 07/04/25, variabel		20.022.000	0,56	17.500.000	USD	Ursa Re II Series AA 06/12/25, variabel		18.157.125	0,51
11.500.000	USD	Sakura Re 05/01/26, variabel		12.225.650	0,34	11.250.000	USD	Ursa Re II Series C 06/12/25, variabel		11.830.500	0,33
1.468.485	USD	Sanders Re II 07/04/26, variabel		587.394	0,02	12.173.000	USD	Ursa Re Series AA 06/12/25, variabel		12.430.459	0,35
12.300.000	USD	Sanders Re III 07/04/26, variabel		12.276.630	0,34	2.419.000	USD	Ursa Re Series C 06/12/25, variabel		2.490.844	0,07
18.750.000	USD	Sanders Re III 05/06/26, variabel		19.950.938	0,56	17.000.000	USD	Ursa Re Series AA 07/12/26, variabel		17.607.750	0,49
5.156.000	USD	Sanders Re III 07/04/27, variabel		5.359.146	0,15	23.500.000	USD	Ursa Re Series D 07/12/26, variabel		24.785.450	0,69

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens			Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung								
3.750.000	USD	Ursa Re Series E 07/12/26, variabel		3.920.250	0,11	8.500.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 5 06/12/26, variabel		8.847.225	0,25
7.000.000	USD	Veraison Re 09/03/26, variabel		7.316.750	0,20	12.044.000	USD	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variabel		12.063.270	0,34
14.465.000	USD	Veraison Re 08/03/27, variabel		14.735.496	0,41	6.000.000	USD	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variabel		5.996.400	0,17
19.806.000	USD	Winston Re Series A 26/02/27, variabel		20.748.766	0,58	13.898.000	USD	Vitality Re XIII Series A 06/01/26, variabel		13.838.934	0,39
8.000.000	USD	Winston Re Series B 26/02/27, variabel		8.411.600	0,23	5.500.000	USD	Vitality Re XIII Series B 06/01/26, variabel		5.457.100	0,15
9.625.000	USD	Wrigley Re Series A 07/08/26, variabel		9.937.331	0,28	14.000.000	USD	Vitality Re XIV Series A 05/01/27, variabel		14.221.900	0,40
10.043.000	USD	Wrigley Re Series B 07/08/26, variabel		10.446.729	0,29	5.550.000	USD	Vitality Re XIV Series B 05/01/27, variabel		5.667.938	0,16
Kaimaninseln				190.706.988	5,32	11.022.000	USD	Vitality Re XV Series A 07/01/28, variabel		11.028.062	0,31
19.500.000	USD	Fish Pond Re 08/01/27, variabel		19.899.749	0,54	4.620.000	USD	Vitality Re XV Series B 07/01/28, variabel		4.619.307	0,13
16.800.000	USD	Long Point Re IV 01/06/26, variabel		17.093.999	0,48	Hongkong				15.255.501	0,43
1.480.545	USD	Residential Reinsurance 2019 06/06/26, variabel		1.299.993	0,04	11.558.000	USD	Black Kite Re 09/06/25, variabel		11.956.751	0,34
7.984.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variabel		7.987.992	0,22	3.250.000	USD	Great Wall Re 05/01/26, variabel		3.298.750	0,09
5.000.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variabel		5.002.500	0,14	Irland				114.649.697	3,20
4.250.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 11 06/06/25, variabel		3.463.750	0,10	5.625.000	USD	Atlas Capital DAC 05/06/26, variabel		5.751.844	0,16
8.285.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 12 06/06/25, variabel		8.302.399	0,23	17.336.000	USD	Atlas Capital DAC 08/06/27, variabel		18.873.703	0,53
4.642.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 13 06/06/25, variabel		4.669.852	0,13	23.500.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity 06/06/25, variabel		23.683.300	0,66
6.500.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 14 06/06/25, variabel		6.532.500	0,18	8.000.000	EUR	Azzurro Re II DAC 20/04/28, variabel		8.924.791	0,25
17.416.667	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 2 06/12/25, variabel		17.234.662	0,47	19.750.000	EUR	Lion III Re DAC 16/07/25, variabel		21.740.682	0,61
4.310.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 3 06/12/25, variabel		4.222.507	0,12	3.750.000	EUR	Orange Capital Re DAC 17/01/25, variabel		4.123.803	0,11
6.550.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 13 06/06/26, variabel		6.405.573	0,18	13.750.000	EUR	Quercus Re DAC 08/07/27, variabel		15.165.764	0,42
2.950.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 14 06/06/26, variabel		2.902.063	0,08	4.000.000	EUR	Taranis Reinsurance DAC 21/01/28, variabel		4.586.178	0,13
3.750.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 3 06/12/26, variabel		3.949.313	0,11	8.647.000	EUR	Windmill III Re DAC 05/07/28, variabel		9.533.967	0,27
Singapur										115.703.400	3,23
				4.000.000	USD	Astro Re 08/07/25, variabel				1.200.000	0,03
				12.000.000	USD	Catahoula II Re Series A 16/06/25, variabel				12.751.200	0,36

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Marktwert USD	% des Nettovermögens
5.250.000	USD	Catahoula II Re Series B 16/06/25, variabel		5.634.300	0,16	2.265.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 5 06/12/27, variabel		2.337.820	0,07
21.866.000	USD	First Coast Re III 07/04/25, variabel		21.590.488	0,60	3.750.000	USD	Residential Reinsurance 2024 06/06/28, variabel		3.704.063	0,10
9.957.000	EUR	Hexagon III Re 15/01/26, variabel		10.702.357	0,30	521.077	USD	Security First Managers 25/02/25, variabel		521.077	0,01
5.000.000	EUR	Hexagon III Re Series CAT 15/01/26, variabel		3.896.025	0,11	200.000.000	USD	United States Treasury Bill 15/10/24, ZCP		199.633.433	5,56
6.786.000	USD	Kizuna Re III 09/04/29, variabel		6.901.023	0,19	6.500.000	USD	Vista Re 21/05/25, variabel		6.765.850	0,19
22.464.000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel		22.382.007	0,63	Summe Anleihen				2.840.623.807	79,20
15.000.000	USD	Nakama Re 04/04/29, variabel		15.016.500	0,42	Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				2.840.623.807	79,20
10.000.000	USD	UmiGame Re Series A1 07/04/25, variabel		10.063.000	0,28						
3.000.000	USD	UmiGame Re Series A2 07/04/25, variabel		3.024.000	0,08						
2.500.000	USD	UmiGame Re Series B1 07/04/25, variabel		2.542.500	0,07						
Vereinigtes Königreich				29.982.050	0,84						
29.750.000	USD	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variabel		29.982.050	0,84						
USA				390.967.837	10,89						
2.100.000	USD	3264 Re 08/07/27, variabel		2.199.645	0,06						
14.525.000	USD	Gateway Re Series A 23/12/24, variabel		14.382.655	0,40						
13.000.000	USD	Gateway Re Series C 23/12/24, variabel		12.772.500	0,36						
15.000.000	USD	Gateway Re 12/05/25, variabel		15.499.500	0,43						
27.916.000	USD	Gateway Re Series A 24/02/26, variabel		30.173.009	0,84						
5.500.000	USD	Gateway Re Series B 24/02/26, variabel		5.885.550	0,16						
10.000.000	USD	Gateway Re 08/07/27, variabel		10.301.500	0,29						
460.856	USD	JGWPT XXV 15/02/67, 7,14%		481.130	0,01						
46.750.000	USD	Lightning Re 31/03/26, variabel		49.751.350	1,39						
7.500.000	USD	Logistics Re 20/12/24, variabel		7.500.000	0,21						
1.050.000	USD	Residential Reinsurance 2023 06/12/24, variabel		1.033.620	0,03						
8.500.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 13 06/06/27, variabel		8.568.850	0,24						
17.300.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 14 06/06/27, variabel		17.383.040	0,48						
2.031.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 3 06/12/27, variabel		2.073.245	0,06						
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Sonstige übertragbare Wertpapiere		Marktwert USD	% des Nettovermögens						
		Aktien									
		Bermuda									
		697		Vousoir Re							
		Supranational						95.530.340		2,66	
		550		Vousoir Re SideCar							
		697		Vousoir Re SideCar-Preference							
		530		Vousoir Re SideCar-Preference							
		557		Vousoir Re SideCar-Preference							
		800		Vousoir Re SideCar-Preference				84.444.800		2,35	
		667		Vousoir Re-Preference				11.085.540		0,31	
		Summe Aktien						95.530.340		2,66	
		Anleihen									
		Bermuda						118.988		-	
		4.750.000		Pelican IV Re Series B 07/05/27, variabel				118.988		-	
		USA						11.623.587		0,33	
		12.197.930		LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5,96%				11.618.527		0,33	
		1.011.906		LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP				5.060		-	
		Summe Anleihen						11.742.575		0,33	
		Summe sonstige übertragbare Wertpapiere						107.272.915		2,99	
		Summe Kapitalanlagen						3.375.217.138		94,11	
		Sonstiges Nettovermögen						211.360.559		5,89	
		Nettoinventarwert						3.586.577.697		100,00	

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
		Israel	7.370.024	2,99
191.728	USD	Global-e Online	7.370.024	2,99
		USA	211.940.177	85,87
30.766	USD	Alphabet	5.102.541	2,07
699.823	USD	AT&T	15.396.106	6,24
37.189	USD	Autodesk	10.244.826	4,15
178.000	USD	Block	11.949.140	4,84
234.086	USD	Bloom Energy	2.471.948	1,00
44.746	USD	Broadcom	7.718.685	3,13
54.851	USD	Carvana	9.550.108	3,87
19.975	USD	CyberArk Software	5.824.910	2,36
91.405	USD	HashiCorp	3.094.973	1,25
211.555	USD	HP	7.588.478	3,07
7.035	USD	HubSpot	3.739.806	1,52
169.000	USD	Marvell Technology	12.188.280	4,94
12.727	USD	Microsoft	5.476.428	2,22
14.603	USD	MongoDB	3.947.921	1,60
372.000	USD	News	9.906.360	4,01
97.620	USD	Oracle	16.634.448	6,74
46.634	USD	PayPal Holdings	3.638.851	1,47
43.250	USD	Qorvo	4.467.725	1,81
119.309	USD	Rocket	2.289.540	0,93
44.726	USD	Salesforce	12.241.953	4,96
16.000	USD	Spotify Technology	5.896.480	2,39
327.000	USD	Trimble	20.303.430	8,22
108.537	USD	Verizon Communications	4.874.397	1,98
58.000	USD	Wayfair	3.258.440	1,32
225.259	USD	Zillow Group	14.382.787	5,83
944.924	USD	ZoomInfo Technologies	9.751.616	3,95
Summe Aktien			219.310.201	88,86
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind				
			219.310.201	88,86
Summe Kapitalanlagen				
			219.310.201	88,86
Sonstiges Nettovermögen				
			27.492.998	11,14
Nettoinventarwert				
			246.803.199	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert EUR	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
Aktien									
Bermuda		17.198.041	3,50		37.860	USD	Meta Platforms	19.469.594	3,97
70.279	USD	RenaissanceRe Holdings	17.198.041	3,50	65.258	USD	Microsoft	25.226.176	5,14
Brasilien		4.279.702	0,87		106.996	USD	Progressive	24.391.416	4,97
134.689	USD	Embraer	4.279.702	0,87	6.574	USD	SharkNinja	642.015	0,13
Kanada		22.669.551	4,61		125.512	USD	Uber Technologies	8.474.583	1,72
295.051	CAD	Canadian Pacific Kansas City	22.669.551	4,61	4.636	USD	Vertex Pharmaceuticals	1.936.946	0,39
Dänemark		14.975.795	3,05		42.601	USD	Visa	10.522.522	2,14
141.883	DKK	Novo Nordisk	14.975.795	3,05	Summe Aktien				428.811.709 87,26
Frankreich		18.877.406	3,84		Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind				428.811.709 87,26
89.424	EUR	Safran	18.877.406	3,84	Summe Kapitalanlagen				428.811.709 87,26
Deutschland		53.784.624	10,94		Sonstiges Nettovermögen				62.633.993 12,74
64.717	EUR	Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft in München	31.989.613	6,50	Nettoinventarwert				491.445.702 100,00
94.000	EUR	SAP	19.213.600	3,91					
78.059	EUR	Siemens Energy	2.581.411	0,53					
Indien		3.916.902	0,80						
146.067	USD	ICICI Bank	3.916.902	0,80					
Irland		590.106	0,12						
114.695	EUR	AIB Group	590.106	0,12					
Japan		4.709.927	0,96						
80.600	JPY	Toyo Suisan Kaisha	4.709.927	0,96					
Vereinigtes Königreich		17.937.917	3,65						
67.286	USD	Flutter Entertainment	14.342.741	2,92					
441.600	HKD	HSBC Holdings	3.595.176	0,73					
USA		269.871.738	54,92						
120.556	USD	Alphabet	18.106.956	3,68					
119.818	USD	Amazon.com	20.056.316	4,09					
7.585	USD	Apple	1.587.661	0,32					
44.163	USD	Aramark	1.536.570	0,31					
117.957	USD	Arch Capital Group	11.855.571	2,41					
2.396	USD	Booking Holdings	9.066.379	1,84					
5.546	USD	Chubb	1.436.833	0,29					
162.156	USD	CRH	13.509.722	2,75					
8.899	USD	First Citizens BancShares	14.717.346	2,99					
12.940	USD	First Solar	2.899.657	0,59					
100.769	USD	Fiserv	16.262.993	3,31					
211.533	USD	GE HealthCare Technologies	17.834.409	3,63					
22.008	USD	GE Vernova	5.041.189	1,03					
72.103	USD	General Electric	12.215.051	2,49					
15.489	USD	Hilton Worldwide Holdings	3.207.308	0,65					
126.051	USD	Interactive Brokers Group	15.780.863	3,21					
7.695	USD	Martin Marietta Materials	3.720.823	0,76					
23.383	USD	Mastercard	10.372.839	2,11					

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Helix

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens						
Aktien															
Bahrain															
91.611	BHD	Aluminium Bahrain BSC	305.694	0,10	26.300	CNH	Tongwei	85.792	0,03						
Belgien															
62.499	EUR	Cenergy Holdings	697.520	0,23	5.326	USD	Trip.com Group	316.524	0,10						
Brasilien															
128.607	BRL	Azzas 2154	995.879	0,32	115.300	CNH	Wanhua Chemical Group	1.504.461	0,49						
187.018	BRL	B3 – Brasil Bolsa Balcao	367.800	0,12	24.800	CNH	Yifeng Pharmacy Chain	90.431	0,03						
153.383	BRL	Banco Bradesco	414.031	0,13	42.500	CNH	Zhejiang Shuanghuan Driveline	167.361	0,05						
55.862	BRL	Banco do Brasil	278.807	0,09	32.500	HKD	Zylox-Tonbridge Medical Technology	54.393	0,02						
9.807	BRL	Centrais Eletricas Brasileiras	70.863	0,02	Kolumbien										
45.872	BRL	Equatorial Energia	273.760	0,09	38.688	COP	Banco Davivienda	175.920	0,06						
76.121	BRL	Gerdau	266.978	0,09	Ägypten										
1.053.787	BRL	Itausa	2.142.094	0,71	126.010	USD	Commercial International Bank Egypt	213.965	0,07						
242.445	BRL	PRIO	1.929.035	0,63	Griechenland										
327.093	BRL	Raia Drogasil	1.531.015	0,50	1.075.314	EUR	Eurobank Ergasias Services & Holdings	9.734.974	3,17						
12.626	BRL	Rede D'Or Sao Luiz	71.711	0,02	3.332	EUR	GEK TERNA	2.469.814	0,80						
7.396	BRL	Telefônica Brasil	75.810	0,02	34.575	EUR	JUMBO	65.672	0,02						
11.740	USD	XP	210.616	0,07	45.761	EUR	Metlen Energy & Metals	991.697	0,32						
Chile															
3.471	CLP	Sociedad Quimica y Minera de Chile	144.209	0,05	408.581	EUR	National Bank of Greece	1.806.912	0,59						
China															
58.300	CNH	China Jushi	2.142.094	0,05	210.924	EUR	Piraeus Financial Holdings	213.965	0,07						
80.400	CNH	Contemporary Amperex Technology	97.963	0,03	Hongkong										
38.800	HKD	Fuyao Glass Industry Group	2.893.695	0,95	33.400	HKD	AIA Group	299.493	0,10						
29.800	CNH	Hangzhou Robam Appliances	260.998	0,09	Ungarn										
18.620	USD	Kanzhun	98.700	0,03	81.258	HUF	OTP Bank	8.044.988	2,62						
128.000	HKD	Lenovo Group	323.243	0,11	122.526	HUF	Richter Gedeon	4.260.954	1,39						
157.523	CNH	Midea Group	174.677	0,06	Indonesien										
260.600	CNH	Midea Group	703.011	0,23	1.635.100	IDR	Mayora Indah	5.736.625	1,87						
139.008	CNH	Sany Heavy Industry	1.711.930	0,56	5.808.300	IDR	Perusahaan Gas Negara	1.115.086	0,36						
20.300	HKD	Shenzhen Inovance Technology	78.138	0,03	2.440.800	IDR	Semen Gresik Persero	862.502	0,28						
7.400	CNH	Shenzhou International Group Holdings	1.240.389	0,40	904.200	IDR	Bank Central Asia	2.656.702	0,09						
4.000	TWD	Sieyuan Electric	184.379	0,06	784.600	IDR	Bank Mandiri Persero	137.798	0,02						
7.000	CNH	Silergy	59.153	0,02	1.566.600	IDR	Bank Negara Indonesia Persero	226.349	0,07						
18.418	USD	Sungrow Power Supply	221.937	0,07	Italien										
177.300	CNH	Toly Bread	135.679	0,05	28.427	EUR	Mayora Indah	2.523.905	0,82						
52.800	HKD	Tongcheng Travel Holdings	167.961	0,04	595	EUR	Eni	278.702	0,14						
Japan															
Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.															

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung				
Kasachstan				1.828.782	0,60
90.666	USD	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	1.593.908	0,52	
2.216	USD	Kaspi.KZ	234.874	0,08	
Kenia				70.025	0,02
205.300	KES	Equity Group Holdings	70.025	0,02	
Mexiko				5.969.884	1,94
35.052	MXN	Arca Continental	328.972	0,11	
43.992	USD	BBB Foods	1.319.760	0,43	
194.786	MXN	Fomento Economico Mexicano	1.929.080	0,63	
3.396	MXN	Gruma	63.211	0,02	
21.845	MXN	Grupo Aeroportuario del Pacifico	380.309	0,12	
297.042	MXN	Grupo Mexico	1.666.902	0,54	
37.572	MXN	La Comer	75.750	0,02	
99.288	MXN	Megacable Holdings	205.900	0,07	
Nigeria				13.186	-
583.306	NGN	Zenith Bank	13.186	-	
Peru				383.536	0,12
14.678	USD	Intercorp Financial Services	383.536	0,12	
Philippinen				6.046.641	1,97
2.926.200	PHP	Ayala Land	1.911.201	0,63	
304.360	PHP	BDO Unibank	858.155	0,28	
240.380	PHP	International Container Terminal Services	1.733.010	0,56	
7.550	PHP	SM Investments	128.803	0,04	
1.630.400	PHP	SM Prime Holdings	939.762	0,31	
1.456.700	PHP	Wilcon Depot	475.710	0,15	
Polen				17.377.078	5,66
44.584	PLN	Alior Bank	1.077.091	0,35	
23.185	PLN	Allegro.eu	210.377	0,07	
9.078	PLN	Dino Polska	829.876	0,27	
48.573	PLN	Grupa Pracuj	684.983	0,22	
16.947	PLN	KRUK	1.960.503	0,64	
978	PLN	LPP	4.025.394	1,31	
181.733	PLN	ORLEN	2.646.671	0,86	
216.336	PLN	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski	3.156.815	1,03	
151.748	PLN	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	1.664.509	0,54	
9.465	PLN	Santander Bank Polska	1.120.859	0,37	
Portugal				299.599	0,10
15.218	EUR	Jeronimo Martins SGPS	299.599	0,10	
		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung				
Rumänien				696.284	0,23
4.258.317	RON	OMV Petrom	696.284	0,23	
Slowenien				4.620.468	1,51
6.251	EUR	Krka dd Novo mesto	948.794	0,31	
137.652	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	3.671.674	1,20	
Südafrika				4.805.907	1,57
59.571	ZAR	Bid	1.530.542	0,50	
13.446	ZAR	Impala Platinum Holdings	75.499	0,02	
59.518	ZAR	Motus Holdings	419.605	0,14	
103.355	ZAR	Shoprite Holdings	1.773.994	0,58	
83.038	ZAR	Telkom SOC	126.972	0,04	
65.032	ZAR	Tiger Brands	879.295	0,29	
Südkorea				22.600.396	7,36
19.287	KRW	Hankook Tire & Technology	611.338	0,20	
303	KRW	Hanwha Aerospace	68.816	0,02	
336	KRW	Hanwha Industrial Solutions	8.556	-	
690	KRW	Hyundai Motor	128.745	0,04	
6.154	KRW	JB Financial Group	72.048	0,02	
15.701	KRW	KB Financial Group	971.332	0,32	
14.700	KRW	Kia	1.122.987	0,37	
483	KRW	LEENO Industrial	69.807	0,02	
1.420	KRW	NCSoft	207.402	0,07	
499	KRW	Park Systems	73.646	0,02	
9.291	KRW	Samsung Electro-Mechanics	941.391	0,31	
231.488	KRW	Samsung Electronics	10.886.681	3,54	
55.194	KRW	Samsung Electronics – Preference	2.148.333	0,70	
12.554	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	3.307.222	1,08	
656	KRW	Samsung SDI	189.872	0,06	
14.491	KRW	Shinhan Financial Group	615.011	0,20	
5.931	KRW	SK Hynix	791.889	0,26	
9.014	KRW	SK Telecom	385.320	0,13	
Taiwan				50.909.041	16,57
120.000	TWD	Accton Technology	2.017.285	0,66	
420.000	TWD	ASE Technology Holding	2.004.013	0,65	
1.000	TWD	ASMedia Technology	51.033	0,02	
6.000	TWD	Asustek Computer	104.846	0,03	
101.000	TWD	Chroma ATE	1.192.028	0,39	
22.000	TWD	Chunghwa Telecom	87.245	0,03	
120.000	TWD	CTBC Financial Holding	130.441	0,04	

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	
4.250	TWD	Dadi Early-Childhood Education Group	4.566	-	Vietnam			2.384.360	0,78	
54.000	TWD	Delta Electronics	649.266	0,21	338.900	VND	Asia Commercial Bank	355.248	0,12	
32.000	TWD	E Ink Holdings	296.273	0,10	312.900	VND	FPT	1.713.213	0,56	
123.000	TWD	Eclat Textile	2.118.244	0,69	110.700	VND	Vietnam Dairy Products	315.899	0,10	
456.000	TWD	Hon Hai Precision Industry	2.701.721	0,88	Summe Aktien				179.532.329	58,49
1.000	TWD	Largan Precision	80.262	0,03	Anleihen					
155.000	TWD	MediaTek	5.754.981	1,87	Argentinien				226.775	0,07
52.000	TWD	Merida Industry	377.925	0,12	470.000	USD	Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 4.13%	226.775	0,07	
65.000	TWD	Nien Made Enterprise	1.047.509	0,34	Brasilien				646.601	0,21
4.000	TWD	Parade Technologies	96.188	0,03	355.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie B 15/05/35, 6.00%	279.841	0,09	
4.000	TWD	Realtek Semiconductor	59.533	0,02	2.096.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10.00%	366.760	0,12	
139.000	TWD	Sporton International	959.711	0,31	Kolumbien				635.588	0,21
949.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	28.698.054	9,34	2.410.000.000 COP		Colombian TES 26/03/31, 7.00%	511.933	0,17	
36.000	TWD	Tatung	55.911	0,02	745.100.000 COP		Colombian TES 26/10/50, 7.25%	123.655	0,04	
117.000	TWD	Uni-President Enterprises	322.386	0,11	Dominikanische Republik				370.020	0,12
313.000	TWD	United Microelectronics	532.109	0,17	20.800.000 DOP		Dominican Republic International Bond 01/06/36, 10.75%	370.020	0,12	
23.650	TWD	Voltronic Power Technology	1.513.319	0,49	Ecuador				127.751	0,04
1.000	TWD	Wiwynn	54.192	0,02	246.000	USD	Ecuador Government International Bond 31/07/40, 5.00%	127.751	0,04	
Thailand			1.734.317	0,56	Ägypten				268.350	0,09
1.070.200	THB	Bangkok Dusit Medical Services	997.777	0,32	4.400.000 EGP		Egypt Government Bond 04/06/27, 23.87%	91.157	0,03	
158.000	THB	Kasikornbank	736.540	0,24	8.700.000 EGP		Egypt Government Bond 13/08/27, 25.32%	177.193	0,06	
Türkei			7.229.193	2,36	Lettland				318.060	0,10
431.324	TRY	Akbank	777.177	0,25	250.000 EUR		Air Baltic 14/08/29, 14.50%	318.060	0,10	
111.459	TRY	BIM Birlesik Magazalar	1.617.899	0,53	Mexiko				840.911	0,27
509.234	TRY	Coca-Cola Icecek	849.040	0,28	3.600.000 MXN		Mexican Bonos 26/05/33, 7.50%	164.274	0,05	
247.140	TRY	Haci Omer Sabanci Holding	703.744	0,23	9.000.000 MXN		Mexican Bonos 18/11/38, 8.50%	423.112	0,14	
41.737	TRY	MLP Saglik Hizmetleri	399.213	0,13	5.870.000 MXN		Mexican Bonos 07/11/47, 8.00%	253.525	0,08	
189.770	TRY	TAV Havalimanlari Holding	1.386.060	0,45	Pakistan				184.949	0,06
1.654.145	TRY	Yapi ve Kredi Bankasi	1.496.060	0,49	230.000 USD		Pakistan Government International Bond 08/04/51, 8.88%	184.949	0,06	
Vereinigte Arabische Emirate			3.150.630	1,03	Südafrika				1.378.361	0,46
1.067.361	AED	ADNOC Drilling	1.374.522	0,45	6.500.000 ZAR		Republic of South Africa			
716.709	AED	Emaar Development	1.703.476	0,56						
19.416	AED	First Abu Dhabi Bank	72.632	0,02						
USA			1.950.552	0,64						
2.558	USD	ARM Holdings	365.820	0,12						
270	USD	Goldman Sachs Group	133.680	0,04						
181.288	GBP	Haleon	955.417	0,31						
536	USD	Mastercard	264.677	0,09						
840	USD	Visa	230.958	0,08						

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung				
6.540.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8,88%	351.488	0,11	
1.730.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8,50%	87.216	0,03	
7.670.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/40, 9,00%	389.657	0,14	
220.000	USD	Sasol Financing USA 18/03/31, 5,50%	196.470	0,06	
Sri Lanka			226.025	0,07	
400.000	USD	Sri Lanka Government International Bond 28/03/30, 7,55%	226.025	0,07	
Supranational			295.846	0,10	
140.000.000	NGN	Asian Development Bank 03/01/25, 20,00%	86.657	0,03	
280.900.000	TRY	European Bank for Reconstruction & Development 05/04/36, ZCP	209.189	0,07	
Türkei			162.821	0,05	
5.600.000	TRY	Turkiye Government Bond 17/05/28, variabel	162.821	0,05	
Ukraine			128.581	0,04	
200.000	USD	NPC Ukrenergo 09/11/28, 6,88%	128.581	0,04	
Summe Anleihen			5.810.639	1,89	
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			185.342.968	60,38	
		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung				
Anleihen					
Argentinien			157.391	0,05	
149.000	USD	YPF 17/01/31, 9,50%	157.391	0,05	
Brasilien			160.272	0,05	
187.159	USD	MC Brazil Downstream Trading 30/06/31, 7,25%	160.272	0,05	
Kolumbien			321.375	0,10	
375.000	USD	Colombia Telecomunicaciones ESP 17/07/30, 4,95%	321.375	0,10	
Ägypten			463.801	0,16	
1.000.000	EGP	Egypt Treasury Bills 10/12/24, ZCP	19.718	0,01	
24.000.000	EGP	Egypt Treasury Bills 18/03/25, ZCP	444.083	0,15	

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung				
USA				60.971.788	19,86
13.992.300	USD	United States Treasury Bill 03/10/24, ZCP	13.988.299	4,56	
5.000.000	USD	United States Treasury Bill 10/10/24, ZCP	4.993.588	1,63	
20.000.000	USD	United States Treasury Bill 17/10/24, ZCP	19.954.763	6,49	
50.000	USD	United States Treasury Bill 24/10/24, ZCP	49.837	0,02	
50.000	USD	United States Treasury Bill 31/10/24, ZCP	49.789	0,02	
18.000.000	USD	United States Treasury Bill 07/11/24, ZCP	17.909.147	5,82	
4.000.000	USD	United States Treasury Bill 14/11/24, ZCP	3.976.687	1,30	
50.000	USD	United States Treasury Bill 21/11/24, ZCP	49.678	0,02	
Sambia				300.999	0,10
300.000	USD	First Quantum Minerals 01/06/31, 8,63%	300.999	0,10	
Summe Anleihen				62.375.626	20,32
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				62.375.626	20,32
		Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung				
Luxemburg				23.336.186	7,60
100.000	USD	Schroder GAIA Asian Equity Long Short	11.688.000	3,81	
223	USD	Schroder ISF – China A	30.751	0,01	
22.537	USD	Schroder ISF Indian Equity	11.617.435	3,78	
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen				23.336.186	7,60
		Sonstige übertragbare Wertpapiere		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung				
Aktien					
Vereinigtes Königreich				–	–
100.339	USD	Noventiq Holdings	–	–	
Summe Aktien				–	–
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere				–	–
Summe Kapitalanlagen				271.054.780	88,30
Sonstiges Nettovermögen				35.906.380	11,70
Nettoinventarwert				306.961.160	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens					
Anleihen														
Argentinien														
29.842	USD	YPF 27/06/29, 8.50%	30.249	0,04	290.000	EUR	IMA Industria Macchine Automatiche 15/04/29, variabel	326.904	0,38					
Belgien														
280.000	EUR	Ontex Group 15/07/26, 3.50%	309.556	0,37	200.000	EUR	Mooney Group 17/12/26, variabel	222.368	0,27					
Kanada														
200.000	EUR	Primo Water Holdings 31/10/28, 3.88%	219.335	0,26	270.000	EUR	Rossini 31/12/29, 6.75%	316.555	0,38					
China														
81.000	USD	Alibaba Group Holding 01/06/31, 0.50%	99.691	0,12	Japan									
Frankreich										145.848	0,17			
300.000	EUR	Accor perpetual, variabel	370.115	0,44	68.000	USD	NTT Finance 02/07/27, 5.10%	69.661	0,08					
23.531	EUR	Accor 07/12/27, 0.70%	28.037	0,03	10.000.000	JPY	Resonac Holdings 29/12/28, ZCP	76.187	0,09					
230.000	EUR	Affelou 25/07/29, 6.00%	263.614	0,31	Luxemburg									
300.000	EUR	Alstom perpetual, variabel	345.176	0,41	200.000	EUR	Altice Financing 15/01/28, 3.00%	182.974	0,22					
200.000	EUR	Altice France 15/07/29, 4.00%	156.555	0,19	230.000	EUR	Eurofins Scientific perpetual, variabel	271.735	0,32					
220.000	EUR	Banijay Entertainment 01/05/29, 7.00%	258.053	0,31	205.000	EUR	INEOS Finance 15/05/28, 6.63%	236.747	0,28					
200.000	EUR	Electricite de France perpetual, variabel	244.709	0,29	300.000	EUR	Summer BC Holdco B 31/10/26, 5.75%	334.321	0,40					
300.000	EUR	Iliad Holding 15/10/28, 5.63%	340.415	0,41	Niederlande									
285.000	EUR	Nova Alexandre III 15/07/29, variabel	311.431	0,37	300.000	GBP	Boost Newco Borrower 15/01/31, 8.50%	434.954	0,53					
36.178	EUR	Safran 01/04/28, ZCP	51.160	0,06	210.000	EUR	Odido Holding 15/01/29, 3.75%	229.817	0,27					
26.396	EUR	Veolia Environnement 01/01/25, ZCP	30.576	0,04	200.000	EUR	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 3.75%	222.185	0,26					
Deutschland										1.025.777	1,22			
280.000	EUR	Cheplapharm Arzneimittel 15/05/30, 7.50%	329.221	0,40	Spanien									
215.000	EUR	IHO Verwaltungs 15/05/28, 8.75%	251.776	0,30	100.000	EUR	Cellnex Telecom 05/07/28, 0.50%	119.083	0,14					
200.000	EUR	Nidda Healthcare Holding 21/08/26, 7.50%	230.573	0,27	170.000	EUR	Cirsia Finance International 31/07/28, 7.88%	201.234	0,24					
270.000	EUR	TUI Cruises 15/04/29, 6.25%	316.887	0,38	100.000	EUR	Cirsia Finance International 15/03/29, 6.50%	116.720	0,14					
Irland										290.000	EUR	Kaixo Bondco Telecom 30/09/29, 5.13%	323.509	0,38
56.000	USD	AerCap Ireland Capital DAC 29/10/26, 2.45%	53.792	0,06	100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	116.720	0,14					
Italien										100.000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	122.933	0,15
Schweden										745.751	0,89			
210.000	EUR	Cerved Group 15/02/29, variabel	228.181	0,27	180.000	EUR	Assemblin Caverion Group 01/07/30, 6.25%	205.898	0,25					
100.000	EUR	DiaSorin 05/05/28, ZCP	98.260	0,12	205.000	EUR	Castellum perpetual, variabel	218.863	0,26					
200.000	EUR	Engineering-Ingegneria Informatica 30/09/26, 5.88%	219.124	0,26	290.000	EUR	Verisure Midholding 15/02/29, 5.25%	320.990	0,38					
100.000	EUR	Eni 14/09/30, 2.95%	114.377	0,14	Vereinigtes Königreich									
Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.										270.000	EUR	Amber Finco 15/07/29, 6.63%	315.127	0,38
										280.000	EUR	Ardonagh Finco 15/02/31, 6.88%	317.234	0,38

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens			Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung								
200.000	GBP	British Telecommunications 20/12/83, variabel		288.839	0,34						
235.000	GBP	CD&R Firefly Bidco 30/04/29, 8,63%		326.053	0,39						
240.000	GBP	CPUK Finance 28/08/29, 7,88%		329.516	0,39						
195.000	GBP	INEOS Finance 15/05/28, 6,63%		261.345	0,31						
215.000	GBP	Virgin Media Secured Finance 15/05/29, 5,25%		271.276	0,32						
USA				2.528.236	3,02						
265.000	EUR	Allied Universal 01/06/28, 3,63%		278.576	0,33						
52.000	USD	Amcor Group Finance 23/05/29, 5,45%		53.913	0,06						
33.000	USD	American Tower 15/01/28, 3,60%		32.207	0,04						
200.000	EUR	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 2,13%		193.037	0,23						
5.000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/27, 5,25%		3.734	-						
265.000	EUR	Dana Financing Luxembourg 15/07/31, 8,50%		314.745	0,38						
250.000	EUR	EMRLD Borrower 15/12/30, 6,38%		292.750	0,35						
33.000	USD	Ford Motor Credit 10/08/26, 2,70%		31.720	0,04						
32.000	USD	Global Payments 15/02/25, 2,65%		31.703	0,04						
31.000	USD	HCA 15/06/26, 5,25%		31.238	0,04						
275.000	EUR	Helios Software Holdings 01/05/29, 7,88%		311.867	0,37						
100.000	EUR	Merrill Lynch 30/01/26, ZCP		112.580	0,13						
52.000	USD	Mohawk Industries 18/09/28, 5,85%		54.823	0,07						
190.000	USD	MPT Operating Partnership 15/10/27, 5,00%		170.925	0,20						
190.000	USD	Oceaneering International 01/02/28, 6,00%		190.516	0,23						
265.000	EUR	Olympus Water US Holding 15/11/28, 9,63%		317.249	0,39						
54.000	USD	Oracle 01/04/25, 2,50%		53.387	0,06						
54.000	USD	Stanley Black & Decker 01/03/26, 3,40%		53.266	0,06						
Summe Anleihen				14.208.847	16,94						
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind				14.208.847	16,94						

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens			Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung					Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung				
Kaimaninseln				5.574.257	6,64	195.000	USD	Vedanta Resources Finance II 17/09/29, 10.88%		198.090	0,24
250.000	USD	ACAM 17/11/34, variabel		236.462	0,28	Irland				8.433.059	10,06
250.000	USD	ACAM Series 2019-FL1 17/11/34, variabel		245.607	0,29	375.000	EUR	Ares European CLO XII DAC 20/04/32, variabel		420.192	0,50
1.162.549	USD	Falcon Aerospace 15/09/39, 6,66%		715.271	0,85	750.000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 15/04/32, variabel		832.875	1,00
375.000	USD	ICG US CLO 16/01/33, variabel		326.695	0,39	550.000	EUR	BBAM European CLO I DAC 22/07/34, variabel		611.733	0,74
375.000	USD	Marble Point CLO XV 23/07/32, variabel		366.180	0,44	250.000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund XXVI DAC 15/01/37, variabel		321.561	0,38
250.000	USD	MP CLO VIII 28/04/34, variabel		251.857	0,30	500.000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund XXXI DAC 15/06/37, variabel		564.126	0,67
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI 20/07/34, variabel		250.719	0,30	101.511	EUR	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel		107.997	0,13
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI Series 2021-11A 20/07/34, variabel		250.866	0,30	97.560	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel		125.248	0,15
395.245	USD	Pioneer Aircraft Finance 15/06/44, 3,97%		371.001	0,44	106.340	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel		132.575	0,16
1.116.071	USD	Thunderbolt II Aircraft Lease 15/09/38, variabel		798.921	0,95	375.000	EUR	Goldentree Loan Management CLO 4 DAC 20/07/34, variabel		420.886	0,50
375.000	USD	Trinitas CLO XVI 20/07/34, variabel		376.920	0,45	800.000	EUR	ICG Euro CLO DAC 19/04/36, variabel		891.988	1,07
1.000.000	USD	Trinitas CLO XVIII 20/01/35, variabel		1.010.000	1,20	100.000	GBP	Last Mile Logistics CMBS UK DAC 17/08/33, variabel		134.220	0,16
400.000	USD	TRTX Issuer 15/03/38, variabel		373.758	0,45	174.770	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 17/08/33, variabel		185.548	0,22
Chile				29.104	0,03	550.821	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance Series 1A 17/08/33, variabel		596.668	0,71
25.000	USD	Latam Airlines Group 15/10/29, 13,38%		29.104	0,03	375.000	EUR	Palmer Square European CLO DAC 15/04/35, variabel		421.680	0,50
China				159.565	0,19	300.000	EUR	Penta CLO 10 DAC 20/11/34, variabel		338.498	0,40
35.000	USD	H World Group 01/05/26, 3,00%		41.353	0,05	375.000	EUR	Segovia European CLO 20/07/32, variabel		421.017	0,50
42.000	USD	JD.com 01/06/29, 0,25%		48.131	0,06	250.000	EUR	St Paul's CLO VII DAC 18/07/34, variabel		277.882	0,33
22.000	USD	Trip.com Group 15/06/29, 0,75%		25.214	0,03	310.000	GBP	Taurus UK DAC 17/05/31, variabel		414.579	0,49
42.000	USD	ZTO Express Cayman 01/09/27, 1,50%		44.867	0,05	191.173	GBP	Taurus UK DAC 17/08/31, variabel		241.526	0,29
Dänemark				48.966	0,06	500.000	EUR	Tikehau CLO VIII DAC 25/10/34, variabel		562.248	0,67
42.000	USD	Ascendis Pharma 01/04/28, 2,25%		48.966	0,06	375.000	EUR	Vendome Funding CLO DAC 20/07/34, variabel		410.012	0,49
Deutschland				520.747	0,62	10.000.000	JPY	Daifuku 14/09/28, ZCP		75.596	0,09
610.000	USD	Mercer International 01/02/29, 5,13%		520.747	0,62	191.173	GBP				
Hongkong				481.521	0,57	375.000	EUR				
505.000	USD	Seaspan 01/08/29, 5,50%		481.521	0,57	375.000	EUR				
Indien				460.853	0,55	94.000	USD	Vedanta Resources Finance II 21/01/24, 13,88%	94.346	0,11	
168.000	USD	Vedanta Resources Finance II 21/01/24, 13,88%		168.417	0,20	168.000	USD				

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens			Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung					Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung				
Jersey				1.002.692	1,20	360.000	USD	B&G Foods 15/09/28, 8.00%		377.082	0,45
495.000	USD	Aston Martin Capital Holdings 31/03/29, 10.00%		486.478	0,58	71.000	USD	Bank of America 19/06/26, variabel		69.265	0,08
500.000	USD	ICG US CLO 18/07/36, variabel		516.214	0,62	50.000	USD	Bausch Health 01/02/27, 6.13%		45.204	0,05
Luxemburg				304.058	0,36	55.000	USD	Bausch Health 01/06/28, 4.88%		43.092	0,05
325.000	USD	ION Trading Technologies 15/05/28, 5.75%		304.058	0,36	375.000	USD	BellRing Brands 15/03/30, 7.00%		392.874	0,47
Mexiko				688.524	0,82	33.000	USD	Berry Global 15/01/26, 1.57%		31.764	0,04
510.610	USD	Borr IHC 15/11/28, 10.00%		530.788	0,63	267.682	USD	Blackbird Capital Aircraft 15/07/46, 2.44%		246.892	0,29
200.000	USD	Braskem Idesa 20/02/32, 6.99%		157.736	0,19	54.000	USD	BlackLine 01/06/29, 1.00%		56.700	0,07
Niederlande				54.128	0,06	90.000	USD	Block Communications 01/03/28, 4.88%		85.003	0,10
53.000	USD	AEGON Funding 16/04/27, 5.50%		54.128	0,06	595.000	USD	Bloomin' Brands 15/04/29, 5.13%		557.712	0,67
Schweiz				69.696	0,08	135.000	USD	Boost Newco Borrower 15/01/31, 7.50%		144.982	0,17
70.000	USD	UBS Group 15/04/26, 4.13%		69.696	0,08	430.000	USD	Brinker International 15/07/30, 8.25%		462.388	0,55
Vereinigtes Königreich				490.728	0,58	325.000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/27, 3.88%		310.604	0,37
100.000	GBP	UK Logistics DAC 17/05/34, variabel		133.291	0,16	270.000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/28, 5.63%		253.606	0,30
175.000	GBP	UK Logistics DAC Series 2022-1 17/05/34, variabel		233.595	0,27	415.000	USD	Calpine 01/02/29, 4.63%		401.392	0,48
100.000	GBP	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 15/07/28, 4.88%		123.842	0,15	90.000	USD	Calpine 01/02/31, 5.00%		87.252	0,10
USA				40.898.743	48,76	115.000	USD	Carnival 01/06/30, 10.50%		124.961	0,15
195.000	USD	Academy 15/11/27, 6.00%		195.597	0,23	246.445	USD	Castlelake Aircraft Structured Trust 2017-1R 15/08/41, 2.74%		230.019	0,27
300.000	USD	Acuris Finance US 01/05/28, 5.00%		274.995	0,33	105.000	USD	CCO Holdings 01/03/30, 4.75%		96.628	0,12
34.000	USD	Advanced Energy Industries 15/09/28, 2.50%		35.955	0,04	80.000	USD	CCO Holdings 01/03/31, 7.38%		81.992	0,10
36.000	USD	Akamai Technologies 01/09/27, 0.38%		37.251	0,04	145.000	USD	CCO Holdings 01/05/32, 4.50%		125.467	0,15
165.000	USD	Alliant Holdings Intermediate 01/10/32, 7.38%		167.681	0,20	220.000	USD	CCO Holdings 01/06/33, 4.50%		187.128	0,22
135.000	USD	Allied Universal 01/06/28, 4.63%		126.793	0,15	515.000	USD	Central Parent 15/06/29, 8.00%		536.203	0,64
485.000	USD	Allied Universal Holdco 15/02/31, 7.88%		495.941	0,59	32.000	USD	Charter Communications Operating 23/07/25, 4.91%		31.956	0,04
325.000	USD	AMC Networks 15/01/29, 10.25%		334.272	0,40	330.000	USD	CITGO Petroleum 15/06/25, 7.00%		330.394	0,39
275.000	USD	AMC Networks 15/02/29, 4.25%		199.167	0,24	285.000	USD	Clear Channel Outdoor Holdings 01/04/30, 7.88%		298.265	0,36
290.000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 4.13%		261.245	0,31	620.000	USD	Cloud Software Group 31/03/29, 6.50%		616.428	0,74
305.000	USD	ASP Unifrax Holdings 30/09/28, 5.25%		152.458	0,18						

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden					Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung		Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung		Marktwert USD	% des Nettovermögens
28.000	USD	CMS Energy 01/05/28, 3.38%	30.128	0,04	560.000	USD	FirstCash 01/01/30, 5.63%	555.422	0,67
68.000	USD	CNO Global Funding 04/06/27, 5,88%	70.045	0,08	100.749	USD	Five Point Operating 15/01/28, 10.50%	103.168	0,12
535.000	USD	Cogent Communications Group 15/06/27, 7,00%	544.958	0,65	33.000	USD	Fluor 15/08/29, 1,13%	40.458	0,05
141.000	USD	COLT Mortgage Loan Trust 25/02/69, variabel	143.355	0,17	400.000	USD	FMC GMSR Issuer Trust 25/07/26, variabel	374.771	0,45
45.000	USD	CommScope 01/07/28, 7,13%	37.654	0,04	23.000	USD	Ford Motor 15/03/26, ZCP	22.598	0,03
225.000	USD	CommScope 01/09/29, 4,75%	189.281	0,23	295.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/05/28, 5,50%	294.498	0,35
300.000	USD	CommScope Technologies 15/06/25, 6,00%	290.625	0,35	170.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/12/30, 7,88%	183.333	0,22
40.000	USD	Community Health Systems 15/03/27, 5,63%	39.393	0,05	80.000	USD	Freedom Mortgage 01/10/30, 12,25%	89.672	0,11
30.000	USD	Community Health Systems 15/01/29, 6,00%	29.149	0,03	210.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/28, 5,00%	208.585	0,25
145.000	USD	Community Health Systems 15/02/31, 4,75%	127.645	0,15	170.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/29, 6,75%	171.429	0,20
230.000	USD	Community Health Systems 15/01/32, 10,88%	253.806	0,30	75.000	USD	Frontier Communications Holdings 15/05/30, 8,75%	79.990	0,10
240.000	USD	Compass Group Diversified Holdings 15/01/32, 5,00%	221.770	0,26	69.000	USD	GA Global Funding Trust 23/09/27, 4,40%	68.846	0,08
380.000	USD	Consolidated Communications 01/10/28, 6,50%	359.646	0,43	69.000	USD	Goldman Sachs Bank USA 18/03/27, variabel	69.909	0,08
395.000	USD	CQP 15/06/31, 5,50%	387.559	0,46	370.000	USD	Graham Packaging 15/08/28, 7,13%	367.401	0,44
75.000	USD	CQP Holdco 15/12/33, 7,50%	81.435	0,10	66.000	USD	Guardant Health 15/11/27, ZCP	53.140	0,06
425.000	USD	Cushman & Wakefield US Borrower 01/09/31, 8,88%	464.281	0,55	17.000	USD	Haemonetics 01/06/29, 2,50%	17.145	0,02
340.000	USD	CVR Energy 15/02/28, 5,75%	319.573	0,38	21.000	USD	Halozyme Therapeutics 15/08/28, 1,00%	24.990	0,03
46.250	USD	Delta Air Lines 20/10/25, 4,50%	45.982	0,05	395.000	USD	Hanesbrands 15/02/31, 9,00%	426.299	0,51
325.000	USD	Directv Financing 15/08/27, 5,88%	319.464	0,38	35.000	USD	HAT Holdings I 15/06/26, 3,38%	33.917	0,04
500.000	USD	Endo Finance Holdings 15/04/31, 8,50%	536.430	0,64	360.000	USD	Helios Software Holdings 01/05/29, 8,75%	368.245	0,44
510.000	USD	EquipmentShare.com 15/05/28, 9,00%	533.307	0,64	450.000	USD	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow 01/06/29, 5,00%	427.852	0,51
75.000	USD	EquipmentShare.com 15/05/32, 8,63%	78.788	0,09	180.000	USD	Hilton Grand Vacations Borrower Escrow 01/07/31, 4,88%	163.508	0,19
28.000	USD	Etsy 15/06/28, 0,25%	22.958	0,03	340.000	USD	HUB International 15/06/30, 7,25%	354.665	0,42
33.000	USD	Evolent Health 01/12/29, 3,50%	35.615	0,04					
90.000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/30, 6,75%	83.900	0,10					
285.000	USD	Fiesta Purchaser 01/03/31, 7,88%	302.632	0,36					

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens			Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung								
585.000	USD	Hunt 15/04/29, 5,25%		566.443	0,69	256.125	USD	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 15/03/35, variabel		254.267	0,30
405.000	USD	Imola Merger 15/05/29, 4,75%		395.865	0,47	43.000	USD	NCL 15/02/27, 1,13%		41.783	0,05
6.000	USD	Insmed 01/06/28, 0,75%		13.779	0,02	340.000	USD	NCR Atleos Escrow 01/04/29, 9,50%		374.576	0,45
17.000	USD	Jazz Investments I 15/09/30, 3,13%		17.791	0,02	105.000	USD	NCR 01/10/28, 5,00%		103.277	0,12
345.000	USD	JB Poindexter 15/12/31, 8,75%		365.512	0,44	245.000	USD	NCR 15/04/29, 5,13%		239.968	0,29
700.000	USD	Kennedy-Wilson 01/02/30, 4,75%		635.455	0,77	305.000	USD	Necessity Retail Real Estate Investment Trust 30/09/28, 4,50%		286.503	0,34
95.000	USD	Kodiak Gas Services 15/02/29, 7,25%		98.404	0,12	560.000	USD	Neptune Bidco US 15/04/29, 9,29%		549.835	0,66
320.000	USD	Kraken Oil & Gas Partners 15/08/29, 7,63%		319.856	0,38	33.000	USD	NextEra Energy Capital Holdings 01/03/27, 3,00%		43.197	0,05
125.000	USD	LABL 01/11/28, 5,88%		117.438	0,14	33.000	USD	Nissan Motor Acceptance 13/09/27, 5,30%		32.937	0,04
375.000	USD	LCM Investments Holdings II 01/08/31, 8,25%		398.619	0,48	33.000	USD	Nutanix 01/10/27, 0,25%		39.518	0,05
375.000	USD	Level 3 Financing 01/07/28, 4,25%		302.320	0,36	370.000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/28, 4,25%		353.640	0,42
48.000	USD	Liberty Media-Liberty Formula One 15/08/27, 2,25%		52.988	0,06	135.000	USD	Olympus Water US Holding 15/11/28, 9,75%		144.256	0,17
200.000	USD	Lightning Power 15/08/32, 7,25%		210.156	0,25	80.000	USD	Olympus Water US Holding 15/06/31, 7,25%		83.323	0,10
12.000	USD	LivaNova USA 15/12/25, 3,00%		13.227	0,02	26.000	USD	ON Semiconductor 01/03/29, 0,50%		26.384	0,03
22.000	USD	Live Nation Entertainment 15/01/29, 3,13%		27.137	0,03	52.000	USD	Parsons 01/03/29, 2,63%		65.546	0,08
600.000	USD	Marriott Ownership Resorts 15/06/29, 4,50%		564.885	0,68	390.000	USD	Pediatrix Medical Group 15/02/30, 5,38%		378.083	0,45
32.000	USD	Mattel 01/04/26, 3,38%		31.298	0,04	54.000	USD	Penske Truck Leasing 15/07/25, 4,00%		53.684	0,06
340.000	USD	Medline Borrower 01/10/29, 5,25%		333.407	0,40	57.000	USD	PG&E 01/12/27, 4,25%		61.802	0,07
36.000	USD	Meritage Homes 15/05/28, 1,75%		41.166	0,05	460.000	USD	Pike 31/01/31, 8,63%		492.420	0,59
295.000	USD	Minerals Technologies 01/07/28, 5,00%		286.872	0,34	18.000	USD	PPL Capital Funding 15/03/28, 2,88%		19.112	0,02
47.000	USD	MKS Instruments 01/06/30, 1,25%		47.071	0,06	480.000	USD	Prime Security Services Borrower 15/01/28, 6,25%		480.531	0,57
74.000	USD	Morgan Stanley 20/07/27, variabel		70.386	0,08	299.299	USD	PRPM 25/06/26, variabel		297.226	0,35
75.000	USD	MPH Acquisition Holdings 01/09/28, 5,50%		53.801	0,06	200.600	USD	PRPM 25/09/26, variabel		200.112	0,24
375.000	USD	Nabors Industries 15/08/31, 8,88%		357.411	0,43	120.000	USD	PRPM Trust Series 2024-B1 25/12/68, variabel		99.916	0,12
153.000	USD	Nationstar Mortgage Holdings 15/08/28, 5,50%		151.574	0,18	236.000	USD	PRPM Trust Series 2024-M1 25/12/68, variabel		122.256	0,15
120.000	USD	Nationstar Mortgage Holdings 15/11/31, 5,75%		117.682	0,14	41.000	USD	QVC 15/04/29, 6,88%		196.398	0,23
								Rexford Industrial Realty 15/03/29, 4,13%		43.624	0,05

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens			Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung								
590.000	USD	Rocket Software 28/11/28, 9,00%		616.403	0,74	100.000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-M1 25/08/68, variabel		102.462	0,12
25.000	USD	Sarepta Therapeutics 15/09/27, 1,25%		28.400	0,03	167.829	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-A3 25/09/68, variabel		171.003	0,20
495.000	USD	Service Properties Trust 15/11/31, 8,63%		538.745	0,64	174.000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-B1 25/09/68, variabel		177.109	0,21
45.000	USD	Shake Shack 01/03/28, ZCP		41.935	0,05	100.000	USD	Vistra Operations 15/10/31, 7,75%		107.737	0,13
535.000	USD	Sirius XM Radio 01/07/29, 5,50%		523.270	0,62	365.000	USD	Vital Energy 15/04/32, 7,88%		353.883	0,42
45.000	USD	Sirius XM Radio 01/07/30, 4,13%		40.851	0,05	121.000	USD	VM Consolidated 15/04/29, 5,50%		119.998	0,14
22.000	USD	Snowflake 01/10/27, ZCP		22.924	0,03	189.000	USD	VMC Finance 16/06/36, variabel		165.632	0,20
530.000	USD	Sotera Health Holdings 01/06/31, 7,38%		551.063	0,66	520.000	USD	VMC Finance Series 2021-FL4 16/06/36, variabel		475.585	0,57
55.000	USD	Southern 15/12/25, 3,88%		61.229	0,07	185.000	USD	Wand NewCo 3 30/01/32, 7,63%		195.028	0,23
295.000	USD	Spirit AeroSystems 15/11/30, 9,75%		329.284	0,39	370.000	USD	Wash Multifamily Acquisition 15/04/26, 5,75%		368.456	0,44
55.000	USD	Standard Industries 15/01/28, 4,75%		53.934	0,06	205.000	USD	Watco 01/08/32, 7,13%		213.812	0,25
170.000	USD	Standard Industries 15/07/30, 4,38%		161.044	0,19	310.667	USD	WAVE Trust 15/11/42, 3,84%		285.900	0,34
110.000	USD	STL Holding 15/02/29, 8,75%		117.123	0,14	70.000	USD	WEC Energy Group 01/06/29, 4,38%		34.457	0,04
425.000	USD	Talen Energy Supply 01/06/30, 8,63%		463.619	0,55	470.000	USD	Wells Fargo 25/04/26, variabel		69.566	0,08
28.000	USD	Tetra Tech 15/08/28, 2,25%		36.778	0,04	470.000	USD	Windsor Holdings III 15/06/30, 8,50%		503.302	0,60
95.000	USD	TMS International 15/04/29, 6,25%		90.557	0,11	420.765		Zayo Group Holdings 01/03/27, 4,00%			
455.000	USD	Tronox 15/03/29, 4,63%		425.478	0,51						
37.000	USD	Uber Technologies 01/12/28, 0,88%		46.417	0,06						
1.042.000	USD	United States Treasury Bill 24/10/24, ZCP		1.038.927	1,24						
165.000	USD	Univision Communications 30/06/30, 7,38%		160.639	0,19						
75.000	USD	Venture Global LNG 01/02/29, 9,50%		84.309	0,10						
155.000	USD	Venture Global LNG 15/01/30, 7,00%		158.449	0,19						
360.000	USD	Venture Global LNG 01/06/31, 8,38%		380.439	0,45						
400.000	USD	Verus Securitization Trust 25/08/67, variabel		398.759	0,48						
271.000	USD	Verus Securitization Trust 25/06/68, variabel		273.353	0,33						
80.743	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-A3 25/08/68, variabel		82.286	0,10						
1.134.000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-B1 25/08/68, variabel		1.152.394	1,38						

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige übertragbare Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
200.000	USD	Sino-Ocean Land Treasure IV 05/05/26, 3.25%	14.000	0,01
Deutschland			173.832	0,21
155.000	EUR	Dynamo Newco II 15/10/31, 6,25%	173.832	0,21
Irland			2.361.554	2,82
750.000	EUR	Aurium CLO 18/01/38, variabel	846.403	1,02
500.000	EUR	Dryden 27 R Euro CLO DAC 15/04/33, variabel	552.420	0,66
250.000	EUR	ICG Euro CLO DAC 15/05/35, variabel	284.058	0,34
500.000	EUR	ICG Euro CLO DAC Series 2022-1A 15/05/35, variabel	565.472	0,67
100.000	EUR	Rockford Tower Europe CLO DAC 20/04/34, variabel	113.201	0,13
Summe Anleihen			3.153.696	3,76
Summe sonstige übertragbare Wertpapiere			3.153.696	3,76
Summe Kapitalanlagen			81.503.146	97,15
Sonstiges Nettovermögen			2.389.161	2,85
Nettoinventarwert			83.892.307	100,00

Schroder GAIA SEG US Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien				
USA				
27.577	USD	Amphenol	1.796.917	0,54
153.792	USD	Brown & Brown	15.932.851	4,80
64.276	USD	CDW	14.545.659	4,38
33.337	USD	Clean Harbors	8.057.886	2,43
310.316	USD	Core & Main	13.778.030	4,15
266.704	USD	Dayforce	16.335.620	4,92
22.577	USD	EMCOR Group	9.720.076	2,93
73.572	USD	Entegris	8.279.057	2,49
56.213	USD	Garmin	9.895.174	2,98
87.968	USD	ITT	13.152.096	3,96
22.786	USD	Labcorp Holdings	5.092.215	1,53
231.963	USD	Live Nation Entertainment	25.397.630	7,64
29.592	USD	Martin Marietta Materials	15.927.894	4,80
126.109	USD	Middleby	17.545.545	5,27
18.061	USD	Paychex	2.423.606	0,73
13.392	USD	PTC	2.419.399	0,73
40.264	USD	Revvity	5.143.726	1,55
176.378	USD	Service International	13.921.516	4,19
172.588	USD	Signet Jewelers	17.800.726	5,35
7.484	USD	Teledyne Technologies	3.275.447	0,99
412.016	USD	Tempur Sealy International	22.496.074	6,76
110.639	USD	Toro	9.595.720	2,89
166.854	USD	Trimble	10.359.965	3,12
11.656	USD	Vail Resorts	2.031.524	0,61
83.074	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	15.100.361	4,55
Summe Aktien				
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind				
280.024.714				

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
USA				
17.000.000	USD	United States Treasury Bill 20/02/25, ZCP	16.691.880	5,03
Summe Anleihen				
16.691.880				
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden				
16.691.880				
Summe Kapitalanlagen				
296.716.594				
Sonstiges Nettovermögen				
35.460.103				
Nettoinventarwert				
332.176.697				
100,00				

* Notleidendes Wertpapier.

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	
Aktien										
Taiwan		10.436.351	4,97		10.248	USD	Microsoft	4.409.714	2,10	
60.093	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	10.436.351	4,97	357	USD	Monolithic Power Systems	330.047	0,16	
Vereinigtes Königreich										
3.207	USD	Coca-Cola Europacific Partners	252.551	0,12	3.872	USD	Natera	491.550	0,23	
USA										
		141.025.272	67,21		38.448	USD	NVIDIA	4.669.125	2,23	
17.936	USD	Abbott Laboratories	2.044.883	0,97	15.726	USD	Old Dominion Freight Line	3.123.813	1,49	
4.875	USD	Adobe	2.524.178	1,20	21.727	USD	PACCAR	2.144.020	1,02	
83.981	USD	Alcon	8.403.980	4,01	48.279	USD	PagerDuty	895.575	0,43	
1.528	USD	Alphabet	253.419	0,12	159.930	USD	Portillo's	2.154.257	1,03	
40.301	USD	Amazon.com	7.509.285	3,58	1.762	USD	Procter & Gamble	305.178	0,15	
1.631	USD	American Express	442.327	0,21	138.102	USD	Riskified	653.222	0,31	
2.137	USD	American Tower	496.981	0,24	10.826	USD	Roper Technologies	6.024.019	2,87	
1.633	USD	Apple	380.489	0,18	1.345	USD	Ross Stores	202.436	0,10	
10.277	USD	Bank of America	407.791	0,19	13.854	USD	Royal Caribbean Cruises	2.457.145	1,17	
11.894	USD	Becton Dickinson	2.867.643	1,37	770	USD	S&P Global	397.797	0,19	
50.867	USD	Boston Scientific	4.262.655	2,03	23.811	USD	Sherwin-Williams	335.870	0,16	
14.464	USD	Broadcom	2.495.040	1,19	12.261	USD	Skechers USA	67.121	0,03	
127.056	USD	Carlyle Group	5.471.031	2,61	47.552	USD	Smartsheet	84.479	0,04	
9.015	USD	Clean Harbors	2.179.016	1,04	6.052	USD	Tenable Holdings	964.822	0,46	
22.840	USD	Clear Secure	756.918	0,36	4.465	USD	Tenet Healthcare	2.037.778	0,97	
11.508	USD	CONMED	827.655	0,39	32.248	USD	Uber Technologies	3.574.008	1,70	
2.564	USD	Constellation Brands	660.717	0,31	2.607	USD	Union Pacific	1.491.697	0,71	
19.330	USD	DocuSign	1.200.200	0,57	6.003	USD	US Foods Holding	210.515	0,10	
653	USD	DR Horton	124.573	0,06	10.958	USD	Vistra	274.598	0,13	
34.870	USD	Dun & Bradstreet Holdings	401.354	0,19	54.677	USD	Waste Connections	3.822.678	1,82	
7.422	USD	Eaton	2.459.948	1,17	3.756	USD	Wells Fargo	3.088.704	1,47	
4.254	USD	Eli Lilly	3.768.789	1,80			Workday	918.004	0,44	
25.333	USD	Extreme Networks	380.755	0,18	Summe Aktien				151.714.174	72,30
56.592	USD	GE Vernova	14.429.829	6,88	Anleihen					
23.294	USD	General Electric	4.392.783	2,09	USA				7.028.845	3,35
36.601	USD	Global Payments	3.748.674	1,79	1.794.000	USD	United States Treasury Note 31/07/26, 4,38%	1.815.654	0,87	
103.105	USD	Globus Medical	7.376.132	3,52	1.680.000	USD	United States Treasury Note 15/08/34, 3,88%	1.690.106	0,81	
3.386	USD	HCA Healthcare	1.376.172	0,66	3.252.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/54, 4,63%	3.523.085	1,67	
21.723	USD	HEICO	4.426.278	2,11	Summe Anleihen				7.028.845	3,35
23.307	USD	Ingersoll Rand	2.287.815	1,09	Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind				158.743.019	75,65
185	USD	KLA	143.266	0,07						
5.519	USD	Lantheus Holdings	605.710	0,29						
844	USD	Marriott International	209.818	0,10						
26.637	USD	Medtronic	2.398.129	1,14						
3.884	USD	Meta Platforms	2.223.357	1,06						

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
USA			24.504.167	11,68
25.000.000	USD	United States Treasury Bill 20/03/25, ZCP	24.504.167	11,68
Summe Anleihen			24.504.167	11,68
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			24.504.167	11,68
Summe Kapitalanlagen			183.247.186	87,33
Sonstiges Nettovermögen			26.586.980	12,67
Nettoinventarwert			209.834.166	100,00

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens							
					Währung	Nennbetrag										
Anleihen																
Deutschland																
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4.25%	13.681	0,01	5.000.000	USD	JPMorgan Liquidity Funds - US Dollar Treasury Liquidity Fund	5.000.000	1,38							
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4.75%	14.521	0,01	Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen				5.000.000 1,38							
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3.25%	12.418	-	Summe Kapitalanlagen				5.119.177 1,41							
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2.50%	11.190	-	Termineinlagen											
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2.50%	11.195	-	Finanzen				234.000.000 64,42							
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1.25%	8.734	-	54.000.000	USD	Banque NA 01/10/24, 4.80%	54.000.000	14,86							
USA																
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2.50%	7.637	-	54.000.000	USD	Credit Agricole 01/10/24, 4.81%	54.000.000	14,86							
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3.00%	8.307	0,01	54.000.000	USD	JPMorgan Chase Bank 01/10/24, 5.30%	54.000.000	14,87							
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2.88%	8.121	-	18.000.000	USD	Mizuho Bank 01/10/24, 4.82%	18.000.000	4,96							
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3.00%	8.288	-	54.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank 01/10/24, 4.80%	54.000.000	14,87							
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2.50%	7.554	-	Summe Termineinlagen				234.000.000 64,42							
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2.50%	7.531	-	Sonstiges Nettovermögen				124.121.602 34,17							
Summe Anleihen																
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind																
119.177 0,03																

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens												
Aktien																					
Australien																					
98.982	GBP	Glencore	565.992	0,19	9.726	GBP	Bank of Cyprus Holdings	48.762	0,02												
3.803	AUD	Macquarie Group	610.949	0,20	Tschechische Republik																
Österreich										3.337	CZK	Komercon Banka	117.570	0,04							
10.752	EUR	Addiko Bank	209.450	0,07	Dänemark																
10.050	EUR	BAWAG Group	778.068	0,26	559	DKK	Genmab	527.127	0,18	1.923	DKK	Novo Nordisk	135.231	0,05							
5.252	EUR	Erste Group Bank	287.928	0,10	2.490	DKK	NTG Nordic Transport Group	225.940	0,07												
Belgien										291	DKK	Pandora	107.088	0,04							
12.905	EUR	Ageas	688.380	0,23	57	DKK	Royal Unibrew	47.909	0,02												
7.764	EUR	Azelis Group	170.171	0,06	402	DKK	Scandinavian Tobacco Group	4.788	-												
1.590	EUR	KBC Group	126.407	0,04	Finnland																
1.895	EUR	Kinepolis Group	84.377	0,03	46.414	SEK	Nordea Bank Abp	6.171	-												
470	EUR	UCB	84.755	0,03	26.341	EUR	Sampo	1.775.163	0,59												
Bermuda										276.891	0,09	Frankreich									
14.317	USD	Sabre Insurance Group	276.891	0,09	728	EUR	Accor	546.593	0,18												
Brasilien										747.619	0,25	1.150	EUR	Dassault Aviation	1.228.570	0,41					
95.815	BRL	Hapvida Participacoes e Investimentos	70.353	0,02	7.406	EUR	Exclusive Networks	98.224	0,03												
238	USD	MercadoLibre	488.366	0,17	40	EUR	Hermes International	172.803	0,06												
10.935	USD	NU Holdings	149.263	0,05	2.750	EUR	IPSOS	144.655	0,05												
649	CAD	Wheaton Precious Metals Corp.	39.637	0,01	1.258	EUR	Legrand	124.696	0,04												
Kanada										4.900.558	1,64	764	EUR	BNP Paribas	236.823	0,08					
141.087	CAD	Advantage Energy	985.820	0,33	9.797	EUR	Société Générale	194.970	0,07												
71.371	CAD	ARC Resources	1.206.359	0,40	23	EUR	Thales	98.224	0,03												
11.468	USD	Canadian Natural Resources	380.852	0,13	3.091	EUR	TotalEnergies	3.650	-												
12.497	CAD	Headwater Exploration	58.491	0,02	16.585	EUR	Ubisoft Entertainment	201.284	0,07												
60.998	CAD	Kelt Exploration	282.338	0,09	Deutschland										186.462	0,06					
12.133	CAD	MEG Energy	227.956	0,08	3.303	EUR	Allianz	5.633.560	1,89												
64.879	CAD	NuVista Energy	533.443	0,18	514	EUR	Beiersdorf	83.514	0,03												
87.516	CAD	Peyto Exploration & Development	996.522	0,33	20.981	EUR	Commerzbank	77.327	0,03												
1.615	USD	Teck Resources	84.368	0,03	23.374	EUR	Deutsche Bank	385.941	0,13												
3.668	USD	Xenon Pharmaceuticals	144.409	0,05	2.022	EUR	Formycon	403.239	0,14												
Chile										97.051	0,03	87	EUR	FUCHS	122.668	0,04					
9.263	CAD	Lundin Mining	97.051	0,03	726	EUR	Heidelberg Materials	4.220	-												
China										447.166	0,15	1.111	EUR	Hensoldt	78.875	0,03					
1.303	USD	Baidu	137.193	0,05	435	EUR	HUGO BOSS	36.433	0,01												
14.465	HKD	ENN Energy Holdings	111.737	0,04	18.256	USD	Immatics	19.897	0,07												
58.200	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer	42.075	0,01	6.672	EUR	IONOS Group	208.301	0,06												
6.469	USD	Zai Lab	156.161	0,05	6.347	EUR	Jenoptik	166.363	0,07												
					386	EUR	RENK Group	194.999	-												
								9.539	-												

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
968	EUR	Rheinmetall	524.110	0,18	7.895	GBP	Fresnillo	64.545	0,02
14.789	EUR	RWE	537.990	0,18	1.091	USD	Argenx	591.410	0,19
3.091	EUR	Siemens	623.945	0,21	102	EUR	ASML Holding	84.656	0,03
179.142	GBP	Sirius Real Estate	233.756	0,08	3.964	USD	Merus	198.041	0,07
10.948	EUR	Talanx	921.320	0,30	Mexiko				896.760 0,30
Hongkong			770.506	0,26	Niederlande				241.226 0,08
10.000	HKD	AIA Group	89.595	0,03	17.627	NOK	DNB Bank	361.460	0,12
73.323	GBP	Prudential	680.911	0,23	8.459	USD	Seadrill	336.161	0,11
Ungarn			241.226	0,08	18.132	NOK	Storebrand	199.139	0,07
4.614	HUF	OTP Bank	241.226	0,08	Polen				117.120 0,04
Irland			64.477	0,02	4.864	PLN	Alior Bank	117.120	0,04
3.854	USD	Prothena	64.477	0,02	Singapur				9.552 -
Italien			2.612.323	0,87	3.789	SGD	Singapore Telecommunications	9.552	-
53.949	EUR	Banca Monte dei Paschi di Siena	311.196	0,10	Südafrika				574.279 0,19
26.300	EUR	BFF Bank	288.221	0,10	17.684	GBP	Anglo American	574.279	0,19
93	EUR	Buzzi	3.706	-	Spanien				1.256.129 0,42
2.682	EUR	DiaSorin	313.176	0,10	111.375	EUR	Banco de Sabadell	236.672	0,08
24.521	EUR	FinecoBank Banca Fineco	419.669	0,14	537.826	EUR	Linea Directa Aseguradora Cia de Seguros y Reaseguros	646.576	0,22
57.441	EUR	Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ	161.130	0,05	14.608	EUR	Merlin Properties Socimi	184.886	0,06
1.787	USD	Stevanato Group	35.740	0,01	147.498	EUR	Unicaja Banco	187.995	0,06
24.635	EUR	UniCredit	1.079.485	0,37	Schweden				1.383.025 0,46
Japan			3.755.342	1,26	23.032	SEK	Atlas Copco	445.520	0,16
3.546	JPY	Bank of Nagoya	152.967	0,05	8.868	SEK	Cibus Nordic Real Estate publ	153.769	0,05
32.517	JPY	Chiba Bank	260.747	0,09	4.662	SEK	Haypp Group	37.642	0,01
6.377	JPY	Chugai Pharmaceutical	307.569	0,10	17.651	USD	SiriusPoint	253.115	0,08
61.051	JPY	Concordia Financial Group	336.423	0,11	11.049	SEK	SKF	219.765	0,07
2.014	JPY	Daiichi Sankyo	65.987	0,02	26.616	SEK	Svenska Handelsbanken	273.214	0,09
406	JPY	Hokuhoku Financial Group	4.414	-	Schweiz				2.721.851 0,91
7.990	JPY	Kyoto Financial Group	122.553	0,04	1.365	CHF	Baloise Holding	278.209	0,09
57.981	JPY	Mebuki Financial Group	231.763	0,08	3.102	CHF	Cie Financiere Richemont	490.397	0,16
31.339	JPY	Mizuho Financial Group	640.190	0,22	3.120	CHF	Galderma Group	289.752	0,10
4.805	JPY	Otsuka Holdings	270.230	0,09	1.970	CHF	Novartis	226.130	0,08
20.861	JPY	Rakuten Bank	468.093	0,16	11.691	USD	On Holding	586.305	0,19
23.121	JPY	Shiga Bank	522.022	0,18	1.432	CHF	Sulzer	234.169	0,08
12.325	JPY	Sony Group	238.182	0,08	139	CHF	Swiss Life Holding	115.950	0,04
73.339	JPY	Tochigi Bank	134.202	0,04	16.269	CHF	UBS Group	500.939	0,17
Jersey			1.400.788	0,47	Taiwan				73.115 0,02
29.177	USD	WisdomTree Brent Crude Oil	1.400.788	0,47	421	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	73.115	0,02
Luxemburg			257.166	0,09	Thailand				145.625 0,05
11.511	EUR	CVC Capital Partners	257.166	0,09	7.962	USD	BKV	145.625	0,05

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Vereinigtes Königreich			5.695.656	1,91	1.306	USD	Bicara Therapeutics	33.264	0,01
5.266	GBP	AstraZeneca	815.839	0,27	959	USD	BILL Holdings	50.597	0,02
17.418	USD	Autolus Therapeutics	63.227	0,02	840	USD	Biogen	162.826	0,05
569.288	GBP	Barclays	1.709.072	0,58	2.454	USD	Blueprint Medicines	226.995	0,08
67.855	GBP	Beazley	690.370	0,23	78	USD	Booking Holdings	328.545	0,11
42.575	GBP	Deliveroo	87.942	0,03	1.941	USD	Boston Scientific	162.656	0,05
108	GBP	Genus	2.895	-	16.581	GBP	BP	86.832	0,03
581	GBP	Hill & Smith	15.924	0,01	3.387	USD	Broadcom	584.258	0,20
825	USD	Immunocore Holdings	25.682	0,01	137	USD	Burlington Stores	36.097	0,01
5.060	GBP	National Grid	69.679	0,02	275	USD	Cadence Design Systems	74.533	0,02
284.631	GBP	NewRiver Real Estate Investment Trust	307.855	0,10	1.604	USD	Caesars Entertainment	66.951	0,02
11.125	GBP	Savills	176.401	0,06	6.415	USD	Capital One Financial	505.488	0,17
2.818	GBP	Serco Group	6.706	-	264	USD	Celldex Therapeutics	8.973	-
5.290	GBP	Softcat	109.765	0,04	325	USD	Cencora	73.151	0,02
46.781	GBP	Standard Chartered	495.973	0,17	3.475	USD	Centene	261.598	0,09
15.121	NOK	Subsea 7	244.304	0,08	2.070	USD	CG oncology	78.101	0,03
7.258	GBP	Unilever	469.556	0,16	1.098	USD	Cheniere Energy	197.464	0,07
29.634	GBP	UNITE Group	372.420	0,12	15.027	USD	Chesapeake Energy	1.235.971	0,41
1.644	GBP	WH Smith	32.046	0,01	8.100	USD	Chord Energy	1.054.863	0,35
USA			56.568.336	18,94	31.732	USD	Citizens Financial Group	1.303.232	0,44
2.006	USD	Abbott Laboratories	228.704	0,08	5.554	USD	ConocoPhillips	584.725	0,20
4.509	USD	Acadia Healthcare	285.916	0,10	7.946	USD	Coterra Energy	190.307	0,06
930	USD	Addus HomeCare	123.718	0,04	15.102	USD	Crescent Energy	165.367	0,06
20.772	USD	agilon health	81.634	0,03	4.783	USD	Crinetics Pharmaceuticals	244.411	0,08
7.308	USD	Akero Therapeutics	209.667	0,07	200	USD	Crown Castle	23.726	0,01
1.056	USD	Align Technology	268.562	0,09	5.680	USD	Cytokinetics	299.904	0,10
12.199	USD	Alignment Healthcare	144.192	0,05	708	USD	Danaher	196.838	0,07
9.884	USD	Alkermes	276.653	0,09	535	USD	Datadog	61.557	0,02
2.507	USD	Alnylam Pharmaceuticals	689.500	0,23	4.466	USD	Denali Therapeutics	130.095	0,04
4.372	USD	Alphabet	730.955	0,24	4.689	USD	Diamondback Energy	808.384	0,27
4.370	USD	Amazon.com	814.262	0,27	3.787	USD	Disc Medicine	186.093	0,06
5.277	USD	American Express	1.431.121	0,49	1.590	USD	Discover Financial Services	223.061	0,07
309	USD	American Tower	71.861	0,02	3.002	USD	Dominion Energy	173.486	0,06
60.883	USD	Antero Resources	1.744.297	0,59	644	USD	DoorDash	91.918	0,03
4.888	USD	APA	119.560	0,04	5.215	USD	DraftKings	204.428	0,07
8.083	USD	Apellis Pharmaceuticals	233.114	0,08	1.599	USD	DT Midstream	125.777	0,04
2.108	USD	Apogee Therapeutics	123.824	0,04	4.152	USD	Dutch Bros	132.989	0,04
2.360	USD	Apple	549.880	0,18	4.144	USD	Edison International	360.901	0,12
2.800	USD	Ardent Health Partners	51.464	0,02	3.684	USD	Edwards Lifesciences	243.107	0,08
12.052	USD	Ares Management	1.878.183	0,64	1.869	USD	Elanco Animal Health	27.456	0,01
6.322	USD	Argan	641.240	0,21	179	USD	Elastic	13.740	-
907	USD	Arista Networks	348.125	0,12	650	USD	Electronic Arts	93.236	0,03
1.653	USD	ARM Holdings	236.396	0,08	227	USD	Elevance Health	118.040	0,04
4.982	USD	Atmos Energy	691.053	0,23	124	USD	Encompass Health	11.983	-
4.279	USD	AtriCure	119.983	0,04	2.439	USD	Enphase Energy	275.656	0,09
4.531	USD	AZEK	212.051	0,07	2.515	USD	EOG Resources	309.169	0,10

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens			Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		Markt-wert USD	% des Netto-vermö-gens
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung					Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung				
41.077	USD	EQT		1.505.060	0,51	24.459	USD	Nasdaq		1.785.751	0,61
2.365	USD	EverQuote		49.878	0,02	535	USD	Natera		67.918	0,02
3.495	USD	Evolent Health		98.839	0,03	13.439	USD	Navigator Holdings		215.965	0,07
9.781	USD	Exact Sciences		666.282	0,22	1.859	CHF	Nestle		186.614	0,06
2.551	USD	Exelon		103.443	0,03	15.153	USD	Net Power		106.223	0,04
206	USD	Expedia Group		30.492	0,01	4.940	USD	News		131.552	0,04
5.337	USD	Exxon Mobil		625.603	0,21	4.124	USD	NextDecade		19.424	0,01
664	USD	First Solar		165.628	0,06	1.000	USD	NEXTracker		37.480	0,01
486	USD	Five Below		42.938	0,01	3.984	USD	NiSource		138.046	0,05
19.279	USD	Flex		644.497	0,22	2.810	USD	Nurix Therapeutics		63.141	0,02
1.306	USD	Fluor		62.309	0,02	2.089	USD	Nuvalent		213.705	0,07
2.795	USD	Freshpet		382.272	0,13	3.625	USD	NVIDIA		440.220	0,15
501	USD	Global Payments		51.312	0,02	273	USD	Okta		20.295	0,01
7.467	USD	Golden Entertainment		237.376	0,08	4.795	USD	ONE Gas		356.844	0,12
6.149	GBP	GSK		124.670	0,04	1.352	USD	ONEOK		123.208	0,04
4.915	USD	Guardant Health		112.750	0,04	6.703	USD	PACS Group		267.919	0,09
670	USD	Gulfport Energy		101.405	0,03	4.843	USD	PG&E		95.746	0,03
19.502	USD	HA Sustainable Infrastructure Capital		672.234	0,23	710	USD	Phillips 66		93.330	0,03
957	USD	HCA Healthcare		388.954	0,13	2.783	USD	Pinterest		90.086	0,03
1.248	USD	Hilton Worldwide Holdings		287.664	0,10	600	USD	Privia Health Group		36.912	0,01
581	USD	HubSpot		308.860	0,10	8.014	USD	PTC Therapeutics		22.260	0,01
692	USD	Humana		219.184	0,07	972	USD	Red Rock Resorts		52.916	0,02
430	USD	Hyatt Hotels		65.446	0,02	1.349	USD	REVOLUTION Medicines		61.177	0,02
303	USD	ICON		87.055	0,03	94	USD	RH		31.436	0,01
313	USD	Intuitive Surgical		153.768	0,05			Rocket Pharmaceuticals		175.576	0,06
6.344	USD	Ionis Pharmaceuticals		254.141	0,09	9.506	USD	S&P Global		665.407	0,22
3.072	USD	JPMorgan Chase		647.762	0,22	1.288	USD	Salesforce		295.881	0,10
20.163	USD	KKR		2.632.884	0,89	1.081	USD	Sarepta Therapeutics		571.862	0,19
15.438	USD	Kodiak Gas Services		447.702	0,15	550	USD	SBA Communications		68.690	0,02
1.676	USD	Kymera Therapeutics		79.325	0,03	249	USD	Legend Biotech		59.934	0,02
1.228	USD	Liberty Media-Liberty Formula One		61.107	0,02	1.393	USD	Schlumberger		58.436	0,02
5.520	USD	Live Nation Entertainment		95.084	0,03	2.879	USD	SEACOR Marine Holdings		27.782	0,01
4.142	USD	Longboard Pharmaceuticals		604.385	0,20	7.992	USD	Sempra		259.109	0,09
94	USD	Madison Square Garden Sports		138.053	0,05	24.723	USD	Shell		175.781	0,06
3.669	USD	Maplebear		19.576	0,01	548	USD	Southwestern Energy		516.399	0,17
3.697	USD	Marathon Petroleum		149.475	0,05	5.837	USD	Spotify Technology		900.313	0,30
19.318	USD	Matador Resources		602.278	0,20	9.588	USD	State Street		458.914	0,15
496	USD	McDonald's		954.696	0,32	10.456	USD	Stifel Financial		229.904	0,08
4.828	USD	Merck		151.037	0,05	12.730	USD	Structure Therapeutics		180.641	0,06
3.306	USD	Micron Technology		548.268	0,18	5.603	USD	Sunrun		43.736	0,01
206	USD	Molina Healthcare		70.979	0,02	2.272	USD	Surgery Partners		38.428	0,01
1.920	USD	Murphy Oil		64.781	0,02	250	USD	Take-Two Interactive Software			

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
2.934	USD	Targa Resources	434.261	0,15	32.000.000	ZAR	European Bank for Reconstruction & Development 30/05/36, ZCP	476.412	0,16
137	USD	Thermo Fisher Scientific	84.744	0,03					
4.109	USD	Tidewater	294.985	0,10					
11.164	USD	TPG	642.600	0,22					
1.026	USD	Tradeweb Markets	126.885	0,04					
1.950	USD	TransUnion	204.165	0,07					
1.859	USD	Uber Technologies	139.722	0,05					
1.434	USD	United Therapeutics	513.874	0,17					
1.419	USD	UnitedHealth Group	829.661	0,28					
3.335	USD	Valero Energy	450.325	0,15					
530	USD	Vaxcyte	60.563	0,02					
219	USD	Vertex Pharmaceuticals	101.853	0,03					
600	USD	Vertiv Holdings	59.694	0,02					
29.336	USD	Viper Energy	1.323.346	0,44					
666	USD	Walt Disney	64.063	0,02					
4.931	USD	WEC Energy Group	474.264	0,16					
8.634	USD	Wells Fargo	487.735	0,16					
19.177	USD	Williams	875.430	0,29					
343	USD	Wingstop	142.715	0,05					
Summe Aktien		99.382.296	33,27						
Anleihen									
Kanada		85.350	0,03						
115.000	CAD	Advantage Energy 30/06/29, 5,00%	85.350	0,03	570.000	EUR	Kingdom of Belgium Treasury Bill 07/11/24, ZCP	632.198	0,21
Japan		373.266	0,12		85.000	EUR	Kingdom of Belgium Treasury Bill 09/01/25, ZCP	93.775	0,03
52.400.000	JPY	Japan Government Thirty Year Bond 20/06/54, 2,20%	373.266	0,12					
Mexiko		2.390.681	0,79						
561.563.800	MXN	Mexico Cetes 06/08/26, ZCP	2.390.681	0,79					
Neuseeland		226.797	0,08						
363.000	NZD	New Zealand Government Bond 15/05/36, 4,25%	226.797	0,08					
Peru		1.181.684	0,40						
2.845.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/31, 6,95%	821.726	0,28					
1.314.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/32, 6,15%	359.958	0,12					
Südafrika		791.651	0,27						
15.744.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8,50%	791.651	0,27					
Supranational									
Belgien		725.973	0,24						
570.000	EUR	Kingdom of Belgium Treasury Bill 07/11/24, ZCP	632.198	0,21					
85.000	EUR	Kingdom of Belgium Treasury Bill 09/01/25, ZCP	93.775	0,03					
Kanada		10.229.613	3,42						
13.850.000	CAD	Canadian Treasury Bill 10/10/24, ZCP	10.229.613	3,42					
Frankreich		3.279.913	1,10						
480.000	EUR	France Treasury Bill BTF 09/10/24, ZCP	533.881	0,18					
805.000	EUR	France Treasury Bill BTF 18/12/24, ZCP	889.201	0,30					
875.000	EUR	France Treasury Bill BTF 12/02/25, ZCP	962.307	0,32					
815.000	EUR	France Treasury Bill BTF 12/03/25, ZCP	894.524	0,30					
Deutschland		4.164.850	1,39						
3.110.000	EUR	German Treasury Bill 20/11/24, ZCP	3.445.830	1,15					
650.000	EUR	German Treasury Bill 11/12/24, ZCP	719.020	0,24					
Vereinigtes Königreich		271.428	0,09						
280.000	USD	Connect Finco Sarl 15/09/29, 9,00%	271.428	0,09					
USA		142.944.239	47,87						
400.000	USD	Aethon United BR 01/10/29, 7,50%	405.798	0,14					
47.000	USD	Enphase Energy 01/03/28, ZCP	41.501	0,01					
755.000	USD	Liberty Mutual Group 15/12/51, variabel	714.343	0,24					
56.000	USD	Sunnova Energy 01/09/26, 5,88%	52.334	0,02					

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2024 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Währung	Sonstige übertragbare Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
					Aktien	Anleihen				
71.000	USD	Sunnova Energy International 15/02/28, 2,63%	46.633	0,02					-	-
88.000	USD	Sunrun 01/02/26, ZCP	81.205	0,03					-	-
58.000	USD	Sunrun 01/03/30, 4,00%	78.097	0,03					-	-
400.000	USD	Tidewater 03/07/28, 10,38%	432.000	0,14					-	-
1.490.000	USD	United States Treasury Bill 01/10/24, ZCP	1.490.000	0,50					-	-
580.000	USD	United States Treasury Bill 03/10/24, ZCP	579.833	0,19					-	-
12.925.000	USD	United States Treasury Bill 08/10/24, ZCP	12.911.992	4,32					-	-
21.430.000	USD	United States Treasury Bill 15/10/24, ZCP	21.387.048	7,16					-	-
20.430.000	USD	United States Treasury Bill 22/10/24, ZCP	20.368.939	6,82					-	-
9.745.000	USD	United States Treasury Bill 24/10/24, ZCP	9.713.126	3,25					-	-
6.435.000	USD	United States Treasury Bill 29/10/24, ZCP	6.409.567	2,15					-	-
4.185.000	USD	United States Treasury Bill 31/10/24, ZCP	4.168.553	1,40					-	-
7.760.000	USD	United States Treasury Bill 05/11/24, ZCP	7.722.728	2,59					-	-
1.365.000	USD	United States Treasury Bill 07/11/24, ZCP	1.357.891	0,45					-	-
1.600.000	USD	United States Treasury Bill 12/11/24, ZCP	1.590.966	0,53					-	-
10.000.000	USD	United States Treasury Bill 14/11/24, ZCP	9.938.035	3,33					-	-
10.815.000	USD	United States Treasury Bill 19/11/24, ZCP	10.747.035	3,60					-	-
7.100.000	USD	United States Treasury Bill 29/11/24, ZCP	7.046.162	2,36					-	-
8.175.000	USD	United States Treasury Bill 05/12/24, ZCP	8.103.703	2,71					-	-
1.365.000	USD	United States Treasury Bill 10/12/24, ZCP	1.352.429	0,45					-	-
5.505.000	USD	United States Treasury Bill 12/12/24, ZCP	5.452.087	1,83					-	-
2.375.000	USD	United States Treasury Bill 19/12/24, ZCP	2.351.247	0,79					-	-
3.645.000	USD	United States Treasury Bill 30/01/25, ZCP	3.587.572	1,20					-	-
2.115.000	USD	United States Treasury Bill 06/02/25, ZCP	2.078.791	0,70					-	-
1.670.000	USD	United States Treasury Bill 20/02/25, ZCP	1.639.053	0,55					-	-
940.000	USD	Welltower OP 15/07/29, 3,13%	1.095.571	0,36					-	-
Summe Anleihen			161.616.016	54,11						
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			161.616.016	54,11						

Die begleitenden Anmerkungen stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024

Die Gesellschaft

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

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

Anteilklassen

Die für die einzelnen Teilfonds verfügbaren Anteilklassen sind im aktuellen Prospekt aufgeführt, zusammen mit Einzelheiten zu etwaigen Mindestzeichnungen, Mindestfolgezeichnungen und Mindestbeteiligungen sowie (gegebenenfalls) Einzelheiten zu den Ausgabeaufschlägen für jede Anteilkasse.

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

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

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

Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden

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

Nettoinventarwert

Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil

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

Der Abschluss wird auf der Grundlage des letzten während des Geschäftsjahres berechneten NIW (30. September 2024 für alle Teilfonds) erstellt und in Übereinstimmung mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen für Investmentfonds dargestellt.

Bewertung des Vermögens der Gesellschaft

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

Der Wert von Wertpapieren, derivativen Finanzinstrumenten und Vermögenswerten wird an dem jeweiligen Geschäftstag auf Basis der Schlusskurse an einer Börse oder einem anderen geregelten Markt ermittelt, an der bzw. an dem diese Wertpapiere oder Vermögenswerte gehandelt werden oder zum Handel zugelassen sind. Bei Wertpapieren, die nicht an einer amtlichen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden oder zum Handel zugelassen sind, oder bei Wertpapieren, die zwar gehandelt werden oder zum Handel zugelassen sind, deren letzter verfügbarer Kurs aber nicht ihren tatsächlichen Wert widerspiegelt, muss der Verwaltungsrat den erwarteten Verkaufspreis zugrunde legen, der mit der gebotenen Sorgfalt und in gutem Glauben anzusetzen ist.

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

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

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

Der Gesamtabschluss wird in EUR, der Währung der Gesellschaft, aufgestellt, und die Abschlüsse der Teilfonds werden in der jeweiligen Basiswährung aufgestellt. Für die Umrechnung von anderen Währungen als dem EUR in der Nettovermögensaufstellung, der Ertrags- und Aufwandsrechnung und der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in EUR werden die zum Jahresende geltenden Wechselkurse verwendet.

Swing-Pricing

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

Die Nettomittelzuflüsse werden von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der letzten verfügbaren Informationen zum Zeitpunkt der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil bestimmt. Das Ausmaß der Preisanpassung wird von der Verwaltungsgesellschaft auf eine Weise bestimmt, die Handels- und sonstige Kosten angemessen wiedergibt. Diese Anpassung kann von Teilfonds zu Teilfonds variieren und wird voraussichtlich unter normalen Marktbedingungen an einem Handelstag höchstens 2 % des nicht angepassten Nettoinventarwerts je Anteil des betreffenden Fonds betragen.

Der Mechanismus wurde für die Schroder GAIA-Teilfonds seit ihrer Auflegung angewandt.

Am 30. September 2024, dem letzten Berechnungstag des Berichtsjahres, wurden Swing-Pricing-Anpassungen für den Schroder GAIA Egerton Equity vorgenommen. In der folgenden Tabelle sind die offiziellen Nettoinventarwerte je Anteil dieses Teilfonds nach Anwendung der Swing-Pricing-Anpassung zu diesem Termin aufgeführt. Alle sonstigen in diesem Bericht aufgeführten Finanzinformationen werden vor den Swing Pricing-Anpassungen ausgewiesen.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Swing-Pricing (Forts.)

	Währung	Schroder GAIA Egerton Equity
Nettoinventarwert je Anteil* (einschließlich Swing-Pricing-Anpassung)		
zum 30. September 2024		
Klasse A Thes.	EUR	266,67
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	GBP	258,66
Klasse A Thes., in USD abgesichert	USD	280,10
Klasse A Aussch. GBP	GBP	246,64
Klasse A1 Thes.	EUR	247,06
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	USD	266,55
Klasse C Thes.	EUR	292,51
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	GBP	281,34
Klasse C Thes., in USD abgesichert	USD	307,47
Klasse C Aussch.	EUR	290,98
Klasse C Aussch. GBP	GBP	270,85
Klasse E Thes.	EUR	290,40
<u>Klasse X Thes.</u>	EUR	289,70

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Währung der Anteilkasse ausgewiesen.

Fair Value Pricing

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

Zum 30. September 2024 wurde die Fair-Value-Anpassung auf die folgenden Wertpapiere angewandt:

Teilfonds	Wertpapiername
Schroder GAIA Cat Bond	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP
Schroder GAIA Helix	CFD auf TRINITY LIMITED
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Clementia Pharmaceuticals
	Credit Suisse Group perpetual, 7,25 %
	Credit Suisse Group perpetual, 7,50 %
	Credit Suisse Group perpetual, 7,50 %

Besteuerung

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

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

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

Von der Gesellschaft vereinbahrte Zins- und Dividendenerträge unterliegen gegebenenfalls einer nicht erstattungsfähigen Quellensteuer in den Herkunftsländern. Des Weiteren muss die Gesellschaft möglicherweise Steuern auf realisierte und nicht realisierte Kapitalerträge auf ihre Vermögenswerte im Ursprungsland zahlen, und entsprechende Rückstellungen werden in bestimmten Ländern möglicherweise anerkannt.

Managementgebühren

Die Anlageverwalter haben Anspruch auf Managementgebühren für ihre Dienste, die auf der Grundlage der Nettoinventarwerte der Teilfonds täglich berechnet und verbucht sowie monatlich gezahlt werden. Für die Anteilklassen I sind keine Managementgebühren aus dem Nettovermögen zu entrichten, den Anlegern werden jedoch direkt von Schroders Gebühren in Rechnung gestellt. Die für das Berichtsjahr tatsächlich anfallenden Gebühren sind in der folgenden Tabelle dargestellt:

Teilfonds	Anteilkasse	Managementgebühren
Schroder GAIA Asian Equity Long Short		
	A-Anteile	2,00 %
	C- und IZ-Anteile*	1,00 %
	E-Anteile	0,75 %
	X1-Anteile	0,85 %
	I-Anteile	0,00 %
Schroder GAIA BlueTrend		
	A-Anteile	1,60 %
	C-, E- und N-Anteile	1,00 %

* Die Verwaltungsgebühr für die Anteilklassen C und IZ des Schroder GAIA Asian Equity Long Short wurde mit Wirkung zum 1. Januar 2024 von 1,25 % auf 1,00 % gesenkt.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Managementgebühren (Forts.)

Teilfonds	Anteilsklasse	Managementgebühren
Schroder GAIA Cat Bond	A- und F-Anteile C- und IF-Anteile PI-Anteile X-Anteile Y-Anteile Y1-Anteile Y2-Anteile I-Anteile	1,50 % 1,10 % 0,46 % 0,75 % 0,88 % 1,28 % 0,24 % 0,00 %
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A- und A1-Anteile C-Anteile E-Anteile	2,00 % 1,25 % 1,00 %
Schroder GAIA Egerton Equity	A- und A1-Anteile C-, E- und X-Anteile	2,00 % 1,25 %
Schroder GAIA Helix	A-Anteile C-, C1- und IZ-Anteile E-Anteile S-Anteile X-Anteile I-Anteile	2,00 % 1,00 % 0,75 % 0,35 % 0,60 % 0,00 %
Schroder GAIA Oaktree Credit	A2-Anteile C-Anteile E-Anteile I-Anteile	1,25 % 0,75 % 0,60 % 0,00 %
Schroder GAIA SEG US Equity	C- und R3-Anteile IZ-, R2- und R5-Anteile K-Anteile R1-Anteile R4-Anteile	1,40 % 1,15 % 1,90 % 1,75 % 2,30 %
Schroder GAIA Sirios US Equity	A-Anteile C- und X-Anteile E-Anteile	2,00 % 1,25 % 1,00 %
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C-Anteile K-Anteile	1,40 % 1,90 %
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A-Anteile C- und C1-Anteile E-Anteile	2,00 % 1,25 % 0,75 %

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

Performancegebühren

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

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

Die Teilfonds, für die Performancegebühren während des Berichtsjahres berechnet wurden, sowie die Daten der jeweiligen Anlageverwalter und die Benchmarks sind in der nachstehenden Tabelle aufgeführt: Weitere Angaben zur Berechnung der Performancegebühren sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Die für das Jahr zahlbaren Gebühren sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Fällige Performancegebühren“ ausgewiesen. Die für die einzelnen Anteilsklassen während des Berichtsjahres in Rechnung gestellten Performancegebühren sind auf den Seiten 146-147 aufgeführt.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Performancegebühren (Forts.)

Teilfonds	Anlageverwalter	Benchmark
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	Schroder Investment Management (Singapore) Ltd.	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short, in GBP abgesichert	Schroder Investment Management (Singapore) Ltd.	Secured Overnight Financing Rate (SOFR)
Schroder GAIA BlueTrend	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend, in BRL abgesichert	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend, in CHF abgesichert	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend, in EUR abgesichert	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend, in GBP abgesichert	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend, in SEK abgesichert	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA Cat Bond	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond, in CHF abgesichert	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond, in EUR abgesichert	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond, in GBP abgesichert	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond, in JPY abgesichert	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond, in SEK abgesichert	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Cat Bond, in SGD abgesichert	Schroder Investment Management (Switzerland) AG	
Schroder GAIA Contour Tech Equity	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity, in BRL abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity, in CHF abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity, in EUR abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity, in GBP abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity, in SEK abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity, in SGD abgesichert	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Egerton Equity	Egerton Capital (UK) LLP	
Schroder GAIA Egerton Equity, in GBP abgesichert	Egerton Capital (UK) LLP	
Schroder GAIA Egerton Equity, in USD abgesichert	Egerton Capital (UK) LLP	
Schroder GAIA Helix	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix, in CHF abgesichert	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix, in EUR abgesichert	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix, in GBP abgesichert	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix, in JPY abgesichert	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix, in SEK abgesichert	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix, in SGD abgesichert	Schroder Investment Management Limited	
Schroder GAIA SEG US Equity	Select Equity Group LP	
Schroder GAIA SEG US Equity, in CHF abgesichert	Select Equity Group LP	
Schroder GAIA SEG US Equity, in EUR abgesichert	Select Equity Group LP	
Schroder GAIA SEG US Equity, in GBP abgesichert	Select Equity Group LP	
Schroder GAIA Sirios US Equity	Sirios Capital Management LP	
Schroder GAIA Sirios US Equity, in CHF abgesichert	Sirios Capital Management LP	
Schroder GAIA Sirios US Equity, in EUR abgesichert	Sirios Capital Management LP	
Schroder GAIA Sirios US Equity, in GBP abgesichert	Sirios Capital Management LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified, in BRL abgesichert	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified, in CHF abgesichert	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified, in EUR abgesichert	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified, in GBP abgesichert	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Wellington Management International Limited	
Schroder GAIA Wellington Pagosa, in BRL abgesichert	Wellington Management International Limited	
Schroder GAIA Wellington Pagosa, in CHF abgesichert	Wellington Management International Limited	
Schroder GAIA Wellington Pagosa, in EUR abgesichert	Wellington Management International Limited	
Schroder GAIA Wellington Pagosa, in GBP abgesichert	Wellington Management International Limited	
Schroder GAIA Wellington Pagosa, in SGD abgesichert	Wellington Management International Limited	

Für Schroder GAIA Asian Equity Long Short, Schroder GAIA Contour Tech Equity, Schroder GAIA Egerton Equity, Schroder GAIA SEG US Equity und Schroder GAIA Two Sigma Diversified beträgt die Performancegebühr 20 % der Outperformance.

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

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

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

Vertriebsgebühren

Zum Zeitpunkt dieses Berichts fällt für alle Anteile der Klasse A1 von Schroder GAIA eine Vertriebsgebühr von 0,50 % an. Auf andere zur Anlage angebotene Anteilklassen der Gesellschaft werden keine weiteren Vertriebsgebühren erhoben.

Gebühren der Verwahrstelle und der Verwaltungsstelle

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Betriebskosten

Der Teilfonds zahlt andere im Zuge des Betriebs der Gesellschaft anfallende Betriebskosten. Hierbei handelt es sich um gesetzliche Gebühren, und zwar überwiegend Prüfungs-, Rechtsberatungs- und Veröffentlichungskosten. Nähere Anhaben hierzu sind unter „Sonstige Aufwendungen“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung ausgewiesen.

Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 18.915 EUR. Bernard Herman erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von EUR 24.500. Eric Bertrand erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 26.500 EUR. Hugh Mullan erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 22.000 EUR. Hugh Mullan erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 18.636 EUR. Die verbleibenden Verwaltungsratsmitglieder verzichteten auf ihr Honorar.

Wiederanlage von Barsicherheiten

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

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

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

Devisenterminkontrakte

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

Am 30. September 2024 waren die folgenden Teilfonds in Devisenterminkontrakten engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short					
Absicherung des Portfolios					
AUD	41.718.000	USD	28.334.496	17. Okt. 2024	514.569
GBP	4.100.000	USD	5.352.091	17. Okt. 2024	129.368
NZD	380.000	USD	231.247	17. Okt. 2024	10.174
SGD	12.094.000	USD	9.178.315	17. Okt. 2024	238.966
USD	958.949	AUD	1.471.000	17. Okt. 2024	(58.286)
USD	634.677	SGD	839.000	17. Okt. 2024	(18.630)
				USD	816.161
Absicherung der Anteilkasse					
GBP	31.232.186	USD	41.444.848	31. Okt. 2024	310.417
USD	1.030.355	GBP	773.921	31. Okt. 2024	(4.324)
				USD	306.093
				USD	1.122.254
Schroder GAIA BlueTrend					
Absicherung des Portfolios					
AUD	56.266.034	USD	38.137.114	16. Okt. 2024	771.620
BRL	1.700.880	USD	306.881	25. Okt. 2024	4.455
BRL	155.274.400	USD	28.005.274	18. Dez. 2024	236.931
CAD	28.984.716	USD	21.470.875	16. Okt. 2024	(32.587)
CHF	18.071.450	USD	21.446.032	16. Okt. 2024	(57.347)
CLP	17.720.412.296	USD	19.410.983	18. Dez. 2024	281.793
CNH	16.093.497	USD	2.301.455	08. Okt. 2024	(3.617)
CNH	4.395.467	USD	628.465	09. Okt. 2024	(834)
CNH	105.629.293	USD	14.949.117	16. Okt. 2024	143.940
CNH	14.640.447	USD	2.094.898	20. Nov. 2024	3.223
EUR	49.700.000	USD	55.200.097	16. Okt. 2024	157.074
EUR	3.545.000	USD	3.967.138	25. Okt. 2024	(16.921)
GBP	42.900.000	USD	56.400.622	16. Okt. 2024	954.154
HUF	17.180.773.400	USD	48.331.491	16. Okt. 2024	(222.053)
IDR	227.840.368.087	USD	14.706.019	18. Dez. 2024	296.113
ILS	26.697.184	USD	7.239.181	16. Okt. 2024	(75.665)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
INR	3.074.661.571	USD	36.584.063	18. Dez. 2024	(35.588)
JPY	1.412.093.951	USD	9.858.628	16. Okt. 2024	(13.265)
KRW	10.536.549.099	USD	7.931.574	18. Dez. 2024	162.983
MXN	71.845.161	USD	3.708.614	16. Okt. 2024	(68.056)
NOK	245.242.172	USD	23.288.803	16. Okt. 2024	(45.975)
NZD	35.100.000	USD	21.804.108	16. Okt. 2024	495.484
PHP	758.701.549	USD	13.508.767	18. Dez. 2024	26.657
PLN	185.330.972	USD	48.028.245	16. Okt. 2024	107.465
SEK	200.006.968	USD	19.455.362	16. Okt. 2024	252.446
SGD	39.183.849	USD	30.120.338	16. Okt. 2024	389.308
THB	339.886.265	USD	10.111.634	16. Okt. 2024	461.868
TWD	428.302.599	USD	13.626.309	18. Dez. 2024	(925)
USD	6.898.270	AUD	10.066.034	16. Okt. 2024	(62.531)
USD	3.177.240	AUD	4.630.000	25. Okt. 2024	(24.973)
USD	300.000	BRL	1.700.880	25. Okt. 2024	(11.336)
USD	287.175	BRL	1.597.196	26. Nov. 2024	(4.127)
USD	24.786.673	BRL	140.461.280	18. Dez. 2024	(761.234)
USD	16.679.250	CAD	22.635.374	16. Okt. 2024	(62.801)
USD	1.771.208	CAD	2.390.000	25. Okt. 2024	3.055
USD	6.767.617	CHF	5.719.958	16. Okt. 2024	(2.309)
USD	118.268	CHF	100.000	25. Okt. 2024	(225)
USD	7.962.947	CLP	7.553.593.046	18. Dez. 2024	(431.394)
USD	2.300.002	CNH	16.093.497	08. Okt. 2024	2.166
USD	628.155	CNH	4.395.467	09. Okt. 2024	523
USD	5.878.560	CNH	41.714.581	16. Okt. 2024	(81.910)
USD	2.772.707	CNH	19.328.197	20. Nov. 2024	2.783
USD	10.188	CZK	230.000	25. Okt. 2024	29
USD	24.680.428	EUR	22.200.000	16. Okt. 2024	(46.517)
USD	12.852.026	EUR	11.535.000	25. Okt. 2024	(1.501)
USD	21.723.379	GBP	16.300.000	16. Okt. 2024	(68.764)
USD	1.360.864	GBP	1.020.000	25. Okt. 2024	(2.809)
USD	815.664	HKD	6.345.000	25. Okt. 2024	(780)
USD	13.326.189	HUF	4.745.625.610	16. Okt. 2024	37.533
USD	5.988	HUF	2.125.000	25. Okt. 2024	40
USD	4.111.285	IDR	63.849.979.556	18. Dez. 2024	(92.910)
USD	13.433.219	ILS	50.228.238	16. Okt. 2024	(44.260)
USD	9.485.043	INR	798.473.100	18. Dez. 2024	(6.397)
USD	7.966.181	JPY	1.130.787.130	16. Okt. 2024	82.136
USD	1.434.156	JPY	205.475.000	25. Okt. 2024	(508)
USD	3.005.892	KRW	4.006.042.421	25. Okt. 2024	(62.093)
USD	6.787.568	KRW	8.966.749.537	18. Dez. 2024	(101.014)
USD	12.451.080	MXN	248.133.710	16. Okt. 2024	(122.422)
USD	1.802	MXN	35.000	25. Okt. 2024	31
USD	12.156.742	NOK	131.232.192	16. Okt. 2024	(280.792)
USD	16.292.167	NZD	26.000.000	16. Okt. 2024	(226.047)
USD	2.061.599	PHP	115.902.385	18. Dez. 2024	(6.126)
USD	7.855.997	PLN	30.035.696	16. Okt. 2024	54.874
USD	10.314.926	SEK	105.865.860	16. Okt. 2024	(116.630)
USD	187.478	SEK	1.900.000	25. Okt. 2024	169
USD	13.681.622	SGD	17.576.911	16. Okt. 2024	(4.259)
USD	151.648	SGD	195.000	25. Okt. 2024	(265)
USD	3.547.791	THB	117.296.467	16. Okt. 2024	(101.179)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
USD	65.817	THB	2.199.323	25. Okt. 2024	(2.648)
USD	67.477	TRY	2.380.000	25. Okt. 2024	(365)
USD	21.089.329	TWD	666.536.660	18. Dez. 2024	(114.883)
USD	14.874.402	ZAR	255.414.924	16. Okt. 2024	109.446
USD	688.569	ZAR	11.955.000	25. Okt. 2024	(1.942)
ZAR	755.282.363	USD	42.250.230	16. Okt. 2024	1.410.921
ZAR	9.435.000	USD	545.981	25. Okt. 2024	(1.022)
				USD	3.027.414
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	139.208.158	USD	24.875.704	31. Okt. 2024	587.013
CHF	1.355.240	USD	1.599.588	31. Okt. 2024	7.528
EUR	75.150.546	USD	83.497.692	31. Okt. 2024	267.148
GBP	107.689.987	USD	142.922.595	31. Okt. 2024	1.051.438
SEK	35.850.236	USD	3.508.520	31. Okt. 2024	26.881
USD	1.044.173	BRL	5.774.339	31. Okt. 2024	(12.019)
USD	134.605	CHF	113.444	31. Okt. 2024	76
USD	773.924	EUR	694.388	31. Okt. 2024	(58)
USD	1.460.715	GBP	1.095.510	31. Okt. 2024	(3.903)
USD	59.716	SEK	607.890	31. Okt. 2024	(231)
				USD	1.923.873
				USD	4.951.287
Schroder GAIA Cat Bond					
Absicherung des Portfolios					
USD	99.646.650	EUR	90.000.000	14. Nov. 2024	(721.143)
USD	6.499.766	NZD	10.800.000	14. Nov. 2024	(362.203)
				USD	(1.083.346)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	229.597.758	USD	270.963.091	31. Okt. 2024	1.306.050
EUR	1.182.593.111	USD	1.313.846.192	31. Okt. 2024	4.304.184
GBP	37.202.640	USD	49.367.014	31. Okt. 2024	370.333
JPY	1.457.881	USD	10.206	31. Okt. 2024	(17)
SEK	8.901.165.924	USD	870.958.336	31. Okt. 2024	6.837.514
SGD	714.083	USD	553.416	30. Okt. 2024	3.049
USD	3.225	CHF	2.703	31. Okt. 2024	20
USD	559.928	EUR	500.983	31. Okt. 2024	1.517
USD	3.239.506	GBP	2.429.898	31. Okt. 2024	(9.100)
USD	203.474	SEK	2.051.213	31. Okt. 2024	1.192
				USD	12.814.742
				USD	11.731.396
Schroder GAIA Contour Tech Equity					
Absicherung des Portfolios					
AUD	1.003.544	USD	674.390	08. Nov. 2024	19.801
CAD	1.956.244	USD	1.441.112	08. Nov. 2024	6.664
EUR	3.582.224	USD	3.987.193	08. Nov. 2024	6.839
GBP	1.680.631	USD	2.187.111	08. Nov. 2024	59.736
JPY	868.300.864	USD	6.044.464	08. Nov. 2024	29.823
NOK	31.746.726	USD	2.996.460	08. Nov. 2024	12.956
USD	725.962	AUD	1.085.925	08. Nov. 2024	(25.216)
USD	1.347.364	CAD	1.831.374	08. Nov. 2024	(7.998)
USD	3.850.735	EUR	3.490.761	08. Nov. 2024	(41.320)
USD	2.651.860	GBP	2.030.785	08. Nov. 2024	(63.108)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)					
USD	4.909.160	JPY	705.602.564	08. Nov. 2024	(26.956)
USD	2.168.650	NOK	23.075.173	08. Nov. 2024	(18.752)
				USD	(47.531)
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	127.501.298	USD	22.770.055	31. Okt. 2024	551.345
CHF	3.388.122	USD	3.998.485	31. Okt. 2024	19.330
EUR	41.245.067	USD	45.825.986	31. Okt. 2024	146.883
GBP	59.718.924	USD	79.248.332	31. Okt. 2024	591.721
SEK	82.472.443	USD	8.069.822	31. Okt. 2024	63.266
SGD	961.762	USD	745.370	30. Okt. 2024	4.104
USD	525.403	BRL	2.907.334	31. Okt. 2024	(6.380)
USD	3.921	EUR	3.505	31. Okt. 2024	14
USD	737.007	GBP	550.164	31. Okt. 2024	1.479
USD	26.952	SEK	272.663	31. Okt. 2024	62
				USD	1.371.824
				USD	1.324.293
Schroder GAIA Egerton Equity					
Absicherung des Portfolios					
CNY	4.863.000	EUR	621.541	15. Okt. 2024	1.566
EUR	9.629.555	CAD	14.414.000	15. Okt. 2024	57.667
EUR	3.441.648	CHF	3.235.000	15. Okt. 2024	4.385
EUR	622.488	CNY	4.863.000	15. Okt. 2024	(619)
EUR	1.324.107	DKK	9.874.000	15. Okt. 2024	(698)
EUR	1.929.896	INR	179.654.000	15. Okt. 2024	6.236
EUR	2.951.898	JPY	474.164.000	15. Okt. 2024	(15.878)
EUR	13.877.211	MXN	306.619.000	15. Okt. 2024	(75.059)
EUR	837.594	SEK	9.518.000	15. Okt. 2024	(4.419)
EUR	366.451.821	USD	405.774.000	15. Okt. 2024	2.128.031
GBP	13.252.000	EUR	15.730.366	15. Okt. 2024	176.965
KRW	4.370.478.000	EUR	2.953.604	15. Okt. 2024	49.742
				EUR	2.327.919
Absicherung der Anteilsklasse					
EUR	169	USD	188	31. Okt. 2024	-
GBP	23.910.961	EUR	28.572.983	31. Okt. 2024	106.794
USD	249.241.618	EUR	224.358.443	31. Okt. 2024	(748.555)
				EUR	(641.761)
				EUR	1.686.158
Schroder GAIA Helix					
Absicherung des Portfolios					
AUD	21.573.000	USD	14.596.413	17. Okt. 2024	373.641
AUD	24.136.684	USD	16.324.805	21. Okt. 2024	425.405
AUD	126.000	USD	87.426	30. Okt. 2024	28
BRL	3.799.000	USD	694.902	04. Nov. 2024	(65)
CAD	816.770	USD	601.263	21. Okt. 2024	3.602
CAD	28.000	USD	20.757	30. Okt. 2024	(16)
CHF	774.000	EUR	799.442	21. Okt. 2024	26.734
CHF	2.639.846	JPY	440.464.312	21. Okt. 2024	48.638
CHF	12.359.675	USD	14.050.460	21. Okt. 2024	635.937
CLP	10.699.000	USD	11.945	24. Okt. 2024	(32)
CLP	527.285.000	USD	566.200	21. Nov. 2024	20.794
COP	5.031.413.000	USD	1.203.952	24. Okt. 2024	(2.278)
DKK	33.541.099	USD	4.908.536	21. Okt. 2024	118.341

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)					
EUR	80.564	CHF	78.000	21. Okt. 2024	(2.694)
EUR	38.712.769	USD	42.505.099	21. Okt. 2024	736.827
EUR	510.000	USD	570.572	30. Okt. 2024	(660)
GBP	38.000	EUR	44.949	21. Okt. 2024	762
GBP	2.140.000	USD	2.766.407	17. Okt. 2024	104.049
GBP	24.694.739	USD	32.036.183	21. Okt. 2024	1.087.643
GBP	790.000	USD	1.057.522	30. Okt. 2024	2.123
HKD	323.821.103	USD	41.587.607	21. Okt. 2024	111.767
IDR	4.178.498.000	USD	275.263	24. Okt. 2024	459
INR	767.438.527	USD	9.160.929	21. Okt. 2024	(11.372)
INR	13.214.000	USD	157.521	24. Okt. 2024	(5)
JPY	918.000.942	CHF	5.119.119	21. Okt. 2024	353.444
JPY	5.230.296.952	USD	34.642.816	21. Okt. 2024	2.027.588
JPY	5.844.000	USD	41.042	30. Okt. 2024	(9)
MXN	1.245.000	USD	63.302	30. Okt. 2024	(81)
NOK	452.000	EUR	38.597	21. Okt. 2024	(189)
NOK	26.511.388	USD	2.446.351	21. Okt. 2024	71.261
NOK	5.378.000	USD	511.309	30. Okt. 2024	(542)
NZD	282.000	USD	171.626	17. Okt. 2024	7.801
NZD	111.000	USD	70.636	30. Okt. 2024	(6)
SEK	16.360.020	USD	1.560.945	21. Okt. 2024	54.601
SEK	7.397.000	USD	732.214	30. Okt. 2024	(1.406)
SGD	6.565.000	USD	4.920.587	17. Okt. 2024	204.376
SGD	9.180.934	USD	6.885.183	21. Okt. 2024	283.591
TRY	16.770.000	USD	371.180	14. Mai 2025	20.949
USD	662.993	AUD	1.017.000	17. Okt. 2024	(42.729)
USD	3.955.125	AUD	5.827.462	21. Okt. 2024	(88.978)
USD	2.861.855	BRL	15.566.489	21. Okt. 2024	10.070
USD	70.606	BRL	386.000	04. Nov. 2024	7
USD	122.668	CAD	166.274	21. Okt. 2024	(467)
USD	512.250	CAD	691.000	30. Okt. 2024	406
USD	3.093.378	CHF	2.661.577	21. Okt. 2024	(69.243)
USD	156.981	CHF	132.000	30. Okt. 2024	(50)
USD	23.618	CLP	21.154.000	24. Okt. 2024	63
USD	1.482.167	DKK	10.035.499	21. Okt. 2024	(21.876)
USD	13.578.434	EUR	12.358.763	21. Okt. 2024	(226.233)
USD	1.085.885	EUR	975.000	17. Dez. 2024	(5.673)
USD	440.700	GBP	337.000	17. Okt. 2024	(11.330)
USD	22.816.122	GBP	17.561.584	21. Okt. 2024	(739.776)
USD	10.947.375	HKD	85.233.291	21. Okt. 2024	(28.363)
USD	134.121	HUF	47.716.000	30. Okt. 2024	187
USD	62.907	IDR	954.929.000	24. Okt. 2024	(105)
USD	23.167	ILS	86.000	30. Okt. 2024	32
USD	22.949.656	JPY	3.388.506.203	21. Okt. 2024	(807.678)
USD	157.621	JPY	22.444.000	30. Okt. 2024	36
USD	181.948	KRW	238.732.000	24. Okt. 2024	(871)
USD	359.679	MXN	6.710.000	29. Okt. 2024	18.889
USD	57.862	MXN	1.138.000	30. Okt. 2024	74
USD	196.339	MYR	812.000	24. Okt. 2024	(840)
USD	1.249.477	NOK	13.331.326	21. Okt. 2024	(16.511)
USD	315.636	NZD	496.000	30. Okt. 2024	28

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)					
USD	6.475	RON	29.713	21. Okt. 2024	(188)
USD	512.473	SEK	5.260.316	21. Okt. 2024	(6.981)
USD	591.974	SGD	783.000	17. Okt. 2024	(19.275)
USD	928.317	SGD	1.216.258	21. Okt. 2024	(21.378)
USD	669.700	SGD	857.000	30. Okt. 2024	172
USD	473.137	TWD	14.927.000	24. Okt. 2024	484
USD	94.070	ZAR	1.623.668	21. Okt. 2024	8
USD	532.872	ZAR	9.925.000	29. Okt. 2024	(41.668)
USD	133.303	ZAR	2.301.000	30. Okt. 2024	115
ZAR	9.925.000	USD	566.503	29. Okt. 2024	8.036
ZAR	1.839.000	USD	106.538	30. Okt. 2024	(92)
				USD	4.589.308
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	928.578	USD	1.095.850	31. Okt. 2024	8.957
EUR	202.922.528	USD	225.439.382	31. Okt. 2024	1.332.016
GBP	28.007.076	USD	37.165.120	31. Okt. 2024	401.344
JPY	1.214.542	USD	8.503	31. Okt. 2024	26
SEK	63.217	USD	6.185	31. Okt. 2024	59
SGD	30.578	USD	23.698	30. Okt. 2024	191
USD	6.752	CHF	5.714	31. Okt. 2024	(46)
USD	1.176.767	EUR	1.055.894	31. Okt. 2024	(3.223)
USD	569.065	GBP	425.359	31. Okt. 2024	(1.476)
USD	50	JPY	7.100	31. Okt. 2024	-
USD	29	SEK	297	31. Okt. 2024	-
USD	109	SGD	141	30. Okt. 2024	(1)
				USD	1.737.847
				USD	6.327.155
Schroder GAIA Oaktree Credit					
Absicherung des Portfolios					
AUD	187.054	USD	127.017	17. Okt. 2024	2.335
EUR	3.756.861	USD	4.098.769	17. Okt. 2024	85.923
GBP	42.347	USD	55.170	17. Okt. 2024	1.445
JPY	21.142.133	USD	148.710	17. Okt. 2024	(1.280)
USD	951.554	AUD	1.402.396	17. Okt. 2024	(18.239)
USD	24.774.434	EUR	22.867.723	17. Okt. 2024	(697.458)
USD	3.419.900	GBP	2.667.623	17. Okt. 2024	(146.556)
USD	270.371	JPY	42.924.633	17. Okt. 2024	(28.955)
				USD	(802.785)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	470.220	USD	554.923	31. Okt. 2024	2.686
EUR	14.817.060	USD	16.461.300	31. Okt. 2024	54.198
GBP	2.229.035	USD	2.957.930	31. Okt. 2024	22.134
USD	10.732	EUR	9.634	31. Okt. 2024	(6)
USD	22.650	GBP	16.886	31. Okt. 2024	75
				USD	79.087
				USD	(723.698)
Schroder GAIA SEG US Equity					
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2.320.350	USD	2.738.594	31. Okt. 2024	12.999
EUR	165.780.557	USD	184.188.473	31. Okt. 2024	595.037

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA SEG US Equity (Forts.)					
GBP	14.878.708	USD	19.745.482	31. Okt. 2024	146.313
USD	30.164	CHF	25.533	31. Okt. 2024	(115)
USD	2.174.177	EUR	1.950.470	31. Okt. 2024	129
USD	202.546	GBP	151.953	31. Okt. 2024	(600)
					USD
					753.763
Schroder GAIA Sirios US Equity					
Absicherung des Portfolios					
CAD	365.000	USD	269.437	18. Dez. 2024	990
CHF	321.000	USD	381.452	18. Dez. 2024	1.146
DKK	5.537.000	USD	830.877	18. Dez. 2024	(687)
EUR	305.000	USD	341.618	18. Dez. 2024	(1.025)
GBP	475.000	USD	634.472	18. Dez. 2024	468
USD	270.535	CAD	365.000	18. Dez. 2024	107
USD	346.419	DKK	2.310.000	18. Dez. 2024	69
USD	15.288.550	EUR	13.678.000	18. Dez. 2024	14.350
USD	18.354.675	GBP	13.899.000	18. Dez. 2024	(224.317)
					USD
					(208.899)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2.716.000	USD	3.205.255	31. Okt. 2024	15.519
EUR	26.807.901	USD	29.782.812	31. Okt. 2024	98.000
GBP	4.075.858	USD	5.408.553	31. Okt. 2024	40.586
USD	233	CHF	197	31. Okt. 2024	(1)
USD	5.263	EUR	4.721	31. Okt. 2024	1
USD	235.484	GBP	176.792	31. Okt. 2024	(875)
					USD
					153.230
					USD
					(55.669)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
AUD	12.356.865	USD	8.304.285	18. Dez. 2024	245.452
CAD	5.385.375	USD	3.985.854	18. Dez. 2024	4.154
CHF	8.533.210	USD	10.186.367	18. Dez. 2024	(15.687)
CNH	6.472.350	USD	924.142	18. Dez. 2024	5.434
GBP	11.794.616	USD	15.495.707	18. Dez. 2024	270.326
IDR	81.633.000.000	USD	5.290.195	15. Okt. 2024	98.561
ILS	532.724	USD	144.259	18. Dez. 2024	(1.015)
JPY	1.276.213.514	USD	8.893.053	18. Dez. 2024	82.346
KRW	1.260.721.680	USD	951.000	18. Dez. 2024	17.532
MXN	85.306.661	USD	4.228.918	18. Dez. 2024	51.358
NOK	13.392.484	USD	1.250.482	18. Dez. 2024	19.123
NZD	10.220.921	USD	6.319.911	18. Dez. 2024	174.267
PLN	22.487.660	USD	5.794.878	18. Dez. 2024	33.466
SEK	13.828.772	USD	1.347.711	18. Dez. 2024	19.236
SGD	5.098.469	USD	3.924.515	18. Dez. 2024	57.840
TWD	5.753.048	USD	180.976	18. Dez. 2024	2.043
USD	5.599.522	AUD	8.332.049	18. Dez. 2024	(165.438)
USD	10.653.828	CAD	14.394.369	18. Dez. 2024	(10.920)
USD	8.561.482	CHF	7.170.335	18. Dez. 2024	15.205
USD	4.308.460	CNH	30.199.400	18. Dez. 2024	(28.861)
USD	1.629.668	CZK	36.861.741	18. Dez. 2024	(1.099)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)					
USD	3.332.737	EUR	3.000.000	18. Dez. 2024	(17.357)
USD	8.135.212	GBP	6.200.913	18. Dez. 2024	(153.636)
USD	671.224	HUF	239.934.747	18. Dez. 2024	790
USD	516.624	ILS	1.908.000	18. Dez. 2024	3.581
USD	10.293.563	JPY	1.483.181.464	18. Dez. 2024	(137.408)
USD	3.500.876	KRW	4.644.331.120	18. Dez. 2024	(67.066)
USD	3.951.715	MXN	79.755.660	18. Dez. 2024	(50.039)
USD	2.224.757	NOK	23.824.536	18. Dez. 2024	(33.804)
USD	1.681.312	NZD	2.718.759	18. Dez. 2024	(46.136)
USD	4.231.660	PLN	16.415.680	18. Dez. 2024	(22.950)
USD	1.725.179	SEK	17.694.924	18. Dez. 2024	(23.929)
USD	1.676.794	SGD	2.178.413	18. Dez. 2024	(24.739)
USD	300.000	TWD	9.467.072	18. Dez. 2024	(1.171)
USD	1.323.500	ZAR	23.953.911	18. Dez. 2024	(53.762)
ZAR	27.635.984	USD	1.527.061	18. Dez. 2024	61.906
				USD	307.603
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	38.974.733	USD	6.965.959	31. Okt. 2024	162.952
CHF	2.110.963	USD	2.491.276	31. Okt. 2024	12.016
EUR	81.137.600	USD	90.161.857	31. Okt. 2024	276.315
GBP	18.821.761	USD	24.977.186	31. Okt. 2024	186.202
USD	114.792	BRL	640.967	31. Okt. 2024	(2.448)
USD	37.561	CHF	31.490	31. Okt. 2024	219
USD	1.278.026	EUR	1.140.014	31. Okt. 2024	7.336
USD	361.635	GBP	269.407	31. Okt. 2024	1.456
				USD	644.048
				USD	951.651
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Absicherung des Portfolios					
AUD	29.161.787	USD	19.682.744	02. Okt. 2024	478.262
AUD	615.000	USD	407.253	10. Okt. 2024	17.983
AUD	12.303.518	USD	8.503.727	04. Nov. 2024	6.885
AUD	734.000	USD	494.225	18. Dez. 2024	13.630
AUD	529.000	USD	360.090	24. Mrz. 2025	5.771
BRL	29.232.000	USD	5.298.004	02. Okt. 2024	67.928
BRL	5.774.000	USD	1.088.888	03. Okt. 2024	(29.125)
BRL	11.000	USD	2.004	31. Okt. 2024	8
BRL	10.185.000	USD	1.864.844	04. Nov. 2024	(2.740)
BRL	7.776.000	USD	1.393.432	03. Dez. 2024	23.631
BRL	1.162.000	USD	204.714	02. Jan. 2025	6.215
CAD	28.955.865	USD	21.435.011	02. Okt. 2024	(25.076)
CAD	832.000	USD	613.208	09. Okt. 2024	2.062
CAD	13.717.576	USD	10.156.884	04. Nov. 2024	(5.831)
CAD	770.000	USD	567.841	18. Dez. 2024	2.650
CHF	9.838.000	USD	11.658.362	02. Okt. 2024	(34.331)
CHF	7.245.000	USD	8.619.456	04. Nov. 2024	(24.314)
CLP	3.023.233.000	USD	3.261.973	02. Okt. 2024	99.789
CLP	385.085.000	USD	412.622	25. Nov. 2024	15.415
CLP	270.200.000	USD	292.172	18. Dez. 2024	8.103
CNH	92.871.000	USD	13.185.947	08. Okt. 2024	74.228

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
CNH	17.490.000	USD	2.511.391	04. Nov. 2024	(7.880)
CNH	2.552.000	USD	361.281	18. Dez. 2024	5.244
COP	45.222.421.000	USD	11.040.606	02. Okt. 2024	(288.849)
COP	30.249.121.000	USD	7.217.489	01. Nov. 2024	(56.120)
COP	2.523.843.000	USD	605.529	25. Nov. 2024	(9.717)
COP	90.300.000	USD	21.363	18. Dez. 2024	(106)
CZK	18.530.000	USD	823.409	02. Okt. 2024	(5.296)
CZK	15.290.000	USD	676.301	04. Nov. 2024	(755)
CZK	8.238.000	USD	364.641	18. Dez. 2024	(191)
DKK	7.020.000	USD	1.050.774	31. Okt. 2024	(718)
DKK	1.165.000	USD	172.752	18. Dez. 2024	1.922
EGP	11.060.000	USD	222.961	15. Okt. 2024	4.811
EGP	5.530.000	USD	106.040	22. Okt. 2024	7.497
EGP	5.530.000	USD	108.644	29. Okt. 2024	4.545
EGP	18.480.000	USD	365.595	18. Dez. 2024	4.685
EUR	1.203.220	CHF	1.135.000	31. Okt. 2024	(4.802)
EUR	438.741	NOK	5.170.000	31. Okt. 2024	(1.041)
EUR	3.719.731	SEK	42.050.000	31. Okt. 2024	(683)
EUR	24.684.000	USD	27.480.615	02. Okt. 2024	(3.635)
EUR	28.000	USD	31.231	08. Okt. 2024	(56)
EUR	220.000	USD	240.834	15. Okt. 2024	4.196
EUR	10.758.755	USD	12.010.899	31. Okt. 2024	(18.898)
EUR	2.339.000	USD	2.612.557	04. Nov. 2024	(5.041)
EUR	753.000	USD	842.116	18. Dez. 2024	(1.244)
EUR	717.000	USD	801.463	31. Jan. 2025	560
GBP	4.509.000	EUR	5.401.590	31. Okt. 2024	7.461
GBP	19.326.000	USD	25.481.276	02. Okt. 2024	356.622
GBP	4.843.000	USD	6.483.420	04. Nov. 2024	(8.725)
GBP	272.000	USD	354.907	18. Dez. 2024	8.680
HKD	751.000	USD	96.608	31. Okt. 2024	37
HUF	1.646.400.000	USD	4.644.317	02. Okt. 2024	(31.454)
HUF	241.400.000	USD	677.278	04. Nov. 2024	(1.831)
HUF	363.835.000	USD	1.009.378	18. Dez. 2024	7.261
HUF	268.016.000	USD	735.036	31. Jan. 2025	12.672
HUF	270.412.000	USD	756.892	25. Mrz. 2025	(4.131)
IDR	12.025.000.000	USD	778.242	02. Okt. 2024	16.012
IDR	3.082.000.000	USD	203.534	04. Nov. 2024	(259)
IDR	4.326.000.000	USD	285.733	18. Dez. 2024	(888)
ILS	33.902.000	USD	9.178.240	07. Okt. 2024	(83.558)
ILS	4.215.000	USD	1.137.582	04. Nov. 2024	(5.962)
INR	2.015.042.000	USD	24.054.685	03. Okt. 2024	(10.219)
INR	8.630.000	USD	103.009	31. Okt. 2024	(172)
INR	2.013.762.000	USD	24.026.633	04. Nov. 2024	(34.997)
INR	106.603.000	USD	1.265.006	18. Dez. 2024	2.183
JPY	3.111.295.000	USD	21.696.452	02. Okt. 2024	(48.893)
JPY	36.900.000	USD	257.068	31. Okt. 2024	822
JPY	193.800.000	USD	1.354.221	01. Nov. 2024	438
JPY	7.299.000	USD	51.959	18. Dez. 2024	(626)
KRW	10.454.505.000	USD	7.859.029	02. Okt. 2024	135.547
KRW	85.880.000	USD	64.621	31. Okt. 2024	1.174

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
KRW	4.923.450.000	USD	3.736.214	04. Nov. 2024	36.574
KZT	248.600.000	USD	519.491	18. Dez. 2024	(12.348)
MXN	225.120.000	USD	11.495.634	02. Okt. 2024	(62.419)
MXN	137.710.000	USD	7.197.512	07. Okt. 2024	(209.083)
MXN	48.137.000	USD	2.576.121	23. Okt. 2024	(139.755)
MXN	137.690.000	USD	6.992.097	04. Nov. 2024	(36.795)
MXN	97.733.000	USD	5.240.423	13. Nov. 2024	(310.282)
MXN	1.460.000	USD	79.607	06. Dez. 2024	(6.216)
MXN	31.850.000	USD	1.608.324	18. Dez. 2024	(10.245)
MXN	145.870.000	USD	8.045.826	20. Dez. 2024	(729.031)
MXN	1.344.000	USD	70.886	24. Dez. 2024	(3.513)
MXN	80.153.000	USD	4.490.742	10. Jan. 2025	(483.319)
MXN	47.355.000	USD	2.591.319	21. Jan. 2025	(227.731)
MXN	47.355.000	USD	2.595.292	29. Jan. 2025	(234.624)
MXN	2.310.000	USD	118.280	18. Feb. 2025	(3.480)
MXN	107.000.000	USD	5.928.142	24. Feb. 2025	(615.479)
MXN	90.890.000	USD	5.147.096	20. Mrz. 2025	(650.913)
MXN	48.137.000	USD	2.675.095	23. Apr. 2025	(306.146)
MXN	97.733.000	USD	5.498.745	13. Mai 2025	(703.610)
NGN	106.611.000	USD	66.424	15. Okt. 2024	(3.212)
NGN	131.609.000	USD	78.199	24. Okt. 2024	(713)
NGN	222.189.000	USD	131.901	13. Jan. 2025	(8.196)
NOK	108.958.000	USD	10.132.698	02. Okt. 2024	192.189
NOK	50.210.000	USD	4.753.241	04. Nov. 2024	6.351
NZD	41.581.000	USD	25.797.889	02. Okt. 2024	618.511
NZD	18.046.000	USD	11.470.542	04. Nov. 2024	(4.610)
NZD	370.000	USD	230.257	18. Dez. 2024	4.834
PEN	9.175.000	USD	2.452.313	02. Okt. 2024	22.837
PEN	3.263.000	USD	875.895	04. Nov. 2024	3.876
PEN	3.280.000	USD	873.020	18. Dez. 2024	11.117
PHP	75.330.000	USD	1.337.939	02. Okt. 2024	6.339
PHP	40.800.000	USD	728.832	04. Nov. 2024	(879)
PHP	12.700.000	USD	227.313	18. Dez. 2024	(742)
PLN	55.545.473	USD	14.393.108	02. Okt. 2024	38.035
PLN	2.000	USD	522	31. Okt. 2024	(3)
PLN	26.803.473	USD	6.980.447	04. Nov. 2024	(22.118)
PLN	2.977.000	USD	766.033	18. Dez. 2024	5.545
SEK	147.613.000	USD	14.400.956	02. Okt. 2024	133.818
SGD	3.258.872	USD	2.510.821	02. Okt. 2024	24.773
SGD	455.000	USD	354.876	30. Okt. 2024	(308)
SGD	285.000	USD	220.988	18. Dez. 2024	1.622
THB	131.920.000	USD	3.902.089	02. Okt. 2024	197.669
THB	1.772.000	USD	48.655	21. Okt. 2024	6.491
THB	282.000	USD	8.618	31. Okt. 2024	164
THB	3.800.000	USD	118.071	04. Nov. 2024	308
THB	89.610.000	USD	2.694.242	18. Dez. 2024	105.103
THB	1.652.000	USD	46.275	21. Jan. 2025	5.435
TRY	159.240.000	USD	4.501.802	02. Okt. 2024	154.678
TRY	159.240.000	USD	4.495.671	04. Nov. 2024	(7.822)
TRY	49.977.000	USD	1.324.578	18. Dez. 2024	18.069

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
TRY	172.515.000	USD	3.585.085	18. Sep. 2025	34.361
TWD	308.157.000	USD	9.701.776	02. Okt. 2024	35.699
TWD	12.625.000	USD	399.388	31. Okt. 2024	649
TWD	189.830.000	USD	5.999.666	04. Nov. 2024	17.362
USD	12.248.255	AUD	18.028.270	02. Okt. 2024	(215.592)
USD	952.159	AUD	1.399.000	10. Okt. 2024	(15.166)
USD	6.225.642	AUD	9.045.000	04. Nov. 2024	(30.982)
USD	639.026	AUD	955.000	18. Dez. 2024	(21.740)
USD	5.257.165	BRL	29.232.000	02. Okt. 2024	(108.771)
USD	1.027.157	BRL	5.774.000	03. Okt. 2024	(32.605)
USD	172.519	BRL	945.000	31. Okt. 2024	(332)
USD	2.161.821	BRL	11.787.000	04. Nov. 2024	6.827
USD	984.020	BRL	5.406.000	03. Dez. 2024	(1.144)
USD	1.567	BRL	9.000	06. Jan. 2025	(66)
USD	13.348.389	CAD	18.060.289	02. Okt. 2024	(5.369)
USD	411.131	CAD	557.000	09. Okt. 2024	(775)
USD	9.966.238	CAD	13.734.000	10. Okt. 2024	(190.416)
USD	19.978	CAD	27.000	04. Nov. 2024	(2)
USD	5.894.747	CAD	7.981.000	18. Dez. 2024	(18.353)
USD	126.550	CAD	173.000	14. Feb. 2025	(1.803)
USD	395.131	CAD	534.000	24. Mrz. 2025	(1.388)
USD	3.723.744	CHF	3.146.000	02. Okt. 2024	6.606
USD	219.288	CHF	185.000	31. Okt. 2024	(95)
USD	1.849.831	CHF	1.554.000	04. Nov. 2024	6.236
USD	434.811	CHF	367.000	18. Dez. 2024	(2.614)
USD	3.320.169	CLP	3.023.233.000	02. Okt. 2024	(41.594)
USD	6.593.815	CLP	5.935.633.000	04. Nov. 2024	(4.698)
USD	411.196	CLP	385.085.000	25. Nov. 2024	(16.841)
USD	780.117	CLP	729.300.000	18. Dez. 2024	(30.357)
USD	13.096.441	CNH	92.871.000	08. Okt. 2024	(163.732)
USD	940.489	CNH	6.549.000	04. Nov. 2024	3.068
USD	811.419	CNH	5.702.000	18. Dez. 2024	(7.518)
USD	226.181	CNY	1.573.000	18. Dez. 2024	492
USD	10.858.415	COP	45.222.421.000	02. Okt. 2024	106.660
USD	101.669	COP	426.100.000	01. Nov. 2024	790
USD	608.775	COP	2.523.843.000	25. Nov. 2024	12.963
USD	22.000	COP	94.800.000	18. Dez. 2024	(316)
USD	5.989.010	CZK	134.925.000	02. Okt. 2024	31.977
USD	5.158.136	CZK	116.395.000	04. Nov. 2024	15.549
USD	1.067.239	DKK	7.130.000	31. Okt. 2024	729
USD	53.064.134	EUR	47.785.000	02. Okt. 2024	(127.709)
USD	31.714.296	EUR	28.408.295	31. Okt. 2024	49.640
USD	40.309.977	EUR	36.120.000	04. Nov. 2024	43.406
USD	4.868.998	EUR	4.392.000	18. Dez. 2024	(35.542)
USD	749.064	EUR	686.000	31. Jan. 2025	(18.282)
USD	756.850	EUR	676.000	25. Mrz. 2025	(759)
USD	22.980.199	GBP	17.458.000	02. Okt. 2024	(360.283)
USD	2.130.274	GBP	1.592.000	31. Okt. 2024	1.880
USD	2.605.814	GBP	1.947.000	04. Nov. 2024	2.834
USD	991.662	GBP	760.000	18. Dez. 2024	(24.241)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	265.285	HKD	2.060.000	31. Okt. 2024	190
USD	772	HKD	6.000	18. Dez. 2024	(1)
USD	11.696.647	HUF	4.156.893.000	02. Okt. 2024	49.920
USD	7.453.415	HUF	2.657.793.000	04. Nov. 2024	16.795
USD	827.931	HUF	294.600.000	18. Dez. 2024	4.751
USD	801.814	HUF	285.836.000	31. Jan. 2025	4.392
USD	778.882	IDR	12.025.000.000	02. Okt. 2024	(15.372)
USD	279.241	IDR	4.326.000.000	18. Dez. 2024	(5.604)
USD	9.164.674	ILS	33.902.000	07. Okt. 2024	69.992
USD	2.855.216	ILS	10.584.000	04. Nov. 2024	13.683
USD	24.075.955	INR	2.015.042.000	03. Okt. 2024	31.491
USD	15.272	INR	1.280.000	04. Nov. 2024	22
USD	159.931	INR	13.440.000	18. Dez. 2024	170
USD	241.146	INR	20.413.000	18. Feb. 2025	(562)
USD	23.083.568	JPY	3.297.458.000	02. Okt. 2024	140.741
USD	2.826.172	JPY	405.674.000	31. Okt. 2024	(9.032)
USD	5.262.119	JPY	747.663.000	01. Nov. 2024	35.963
USD	61.465	JPY	8.600.000	18. Dez. 2024	982
USD	7.867.971	KRW	10.454.505.000	02. Okt. 2024	(126.604)
USD	3.316.607	KRW	4.373.458.000	04. Nov. 2024	(34.728)
USD	236.120	KZT	114.400.000	18. Dez. 2024	2.745
USD	12.602.809	MXN	245.840.000	02. Okt. 2024	117.283
USD	230.790	MXN	3.981.000	04. Okt. 2024	28.670
USD	7.747.489	MXN	137.710.000	07. Okt. 2024	759.058
USD	2.749.429	MXN	48.137.000	23. Okt. 2024	313.063
USD	6.059.706	MXN	119.110.000	04. Nov. 2024	42.957
USD	5.650.562	MXN	97.733.000	13. Nov. 2024	720.421
USD	4.528.723	MXN	89.777.000	18. Dez. 2024	24.148
USD	8.360.821	MXN	145.870.000	20. Dez. 2024	1.044.026
USD	4.286.486	MXN	80.153.000	10. Jan. 2025	279.063
USD	2.495.784	MXN	47.355.000	21. Jan. 2025	132.195
USD	2.494.666	MXN	47.355.000	29. Jan. 2025	133.998
USD	5.789.887	MXN	107.000.000	24. Feb. 2025	477.224
USD	4.842.639	MXN	90.890.000	20. Mrz. 2025	346.454
USD	2.503.432	MXN	48.137.000	23. Apr. 2025	134.483
USD	5.092.661	MXN	97.733.000	13. Mai 2025	297.527
USD	12.932.512	NOK	136.179.000	02. Okt. 2024	28.159
USD	3.257.786	NOK	34.311.000	04. Nov. 2024	5.320
USD	19.877.946	NZD	31.933.000	02. Okt. 2024	(409.083)
USD	386.280	NZD	608.000	04. Nov. 2024	(27)
USD	448.644	NZD	730.000	18. Dez. 2024	(15.184)
USD	2.441.551	PEN	9.175.000	02. Okt. 2024	(33.597)
USD	1.630.959	PEN	6.090.000	04. Nov. 2024	(11.029)
USD	1.723.192	PEN	6.503.000	18. Dez. 2024	(29.716)
USD	1.338.813	PHP	75.330.000	02. Okt. 2024	(5.465)
USD	7.383.277	PLN	28.742.000	02. Okt. 2024	(84.119)
USD	239.251	PLN	940.000	15. Okt. 2024	(4.900)
USD	1.974.738	PLN	7.580.000	04. Nov. 2024	6.928
USD	180.571	PLN	695.000	18. Dez. 2024	441
USD	99.835	PLN	394.000	21. Jan. 2025	(2.106)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkäufer Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	27.181.666	SEK	277.486.000	02. Okt. 2024	(141.111)
USD	673.754	SEK	6.810.000	31. Okt. 2024	2.180
USD	16.281.775	SEK	164.342.000	04. Nov. 2024	72.043
USD	4.390.950	SGD	5.725.000	02. Okt. 2024	(63.435)
USD	780	SGD	1.000	30. Okt. 2024	1
USD	1.928.232	SGD	2.466.128	04. Nov. 2024	5.960
USD	3.788.148	THB	128.120.000	02. Okt. 2024	(193.517)
USD	117.664	THB	3.850.000	31. Okt. 2024	(2.243)
USD	284.900	THB	9.500.000	18. Dez. 2024	(11.872)
USD	4.590.994	TRY	172.517.000	18. Dez. 2024	(43.726)
USD	9.648.876	TWD	308.157.000	02. Okt. 2024	(88.599)
USD	14.143	TWD	450.000	31. Okt. 2024	(115)
USD	26.609.731	ZAR	472.837.000	02. Okt. 2024	(757.482)
USD	64.607	ZAR	1.249.000	21. Okt. 2024	(7.561)
USD	20.012.604	ZAR	344.563.000	04. Nov. 2024	128.698
USD	32.580	ZAR	617.000	06. Dez. 2024	(2.933)
USD	3.195.468	ZAR	57.579.000	18. Dez. 2024	(115.112)
USD	32.208	ZAR	589.000	24. Dez. 2024	(1.640)
ZAR	136.824.000	USD	7.774.787	02. Okt. 2024	144.416
ZAR	59.066.000	USD	3.411.018	04. Nov. 2024	(2.460)
ZAR	13.833.000	USD	791.362	18. Dez. 2024	3.986
				USD	(252.242)
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	62.882.662	USD	11.228.390	31. Okt. 2024	273.547
CHF	9.942.549	USD	11.733.600	31. Okt. 2024	56.799
EUR	68.670.063	USD	76.289.383	31. Okt. 2024	252.133
GBP	46.199.425	USD	61.306.226	31. Okt. 2024	459.199
SGD	2.704.945	USD	2.096.332	30. Okt. 2024	11.553
USD	174.068	BRL	971.952	31. Okt. 2024	(3.713)
USD	4.717	CHF	3.990	31. Okt. 2024	(16)
USD	228.084	EUR	204.736	31. Okt. 2024	(121)
USD	25	SGD	34	30. Apr. 2024	-
				USD	1.049.381
				USD	797.139

Die Devisenterminkontrakte bezogen sich auf die folgenden Kontrahenten:

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short		
	Barclays Bank	(8.967)
	BNP Paribas	(58.286)
	Canadian Imperial Bank of Commerce	52.263
	Citi Bank	350.786
	HSBC	306.093
	J.P. Morgan	21.735
	Royal Bank of Canada	59.596
	Standard Chartered Bank	29.328
	State Street	205.804

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short (Forts.)	The Bank of New York Mellon UBS	20.295 143.607 USD 1.122.254
Schroder GAIA BlueTrend	HSBC UBS	1.923.873 3.027.414 USD 4.951.287
Schroder GAIA Cat Bond	Brown Brothers Harriman & Co HSBC	(1.083.346) 12.814.742 USD 11.731.396
Schroder GAIA Contour Tech Equity	HSBC Morgan Stanley	1.371.824 (47.531) USD 1.324.293
Schroder GAIA Egerton Equity	Brown Brothers Harriman & Co HSBC	2.270.995 (584.837) EUR 1.686.158
Schroder GAIA Helix	Goldman Sachs HSBC J.P. Morgan	458.275 1.737.847 4.131.033 USD 6.327.155
Schroder GAIA Oaktree Credit	HSBC State Street	79.087 (802.785) USD (723.698)
Schroder GAIA SEG US Equity	HSBC	753.763 USD 753.763
Schroder GAIA Sirios US Equity	HSBC Morgan Stanley	153.230 (208.899) USD (55.669)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank Deutsche Bank HSBC Morgan Stanley Newedge Group	92.413 402.793 644.048 (48.662) (138.941) USD 951.651
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Bank of America Barclays Bank BNP Paribas Citi Bank Deutsche Bank Goldman Sachs HSBC J.P. Morgan Morgan Stanley Standard Chartered Bank UBS	(296.807) 757.135 58.266 (567.378) (205.725) 192.165 2.211.556 (57.590) (1.454.200) (19.276) 178.993 USD 797.139

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Kassageschäfte

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

Zum 30. September 2024 war der folgende Teilfonds in offenen Kassageschäften engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währung	Verkaufter Betrag	Abrechnungsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
USD	251.000	AUD	362.000	02. Okt. 2024	731
USD	93.569	GBP	70.000	03. Okt. 2024	(17)
					USD
					714

Kontrahenten von Kassageschäften

Fonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
Brown Brothers Harriman & Co		
	Morgan Stanley	(17)
		731
		USD
		714

Terminkontrakte

Terminkontrakte wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Terminkontrakten“ aufgeführt. Zum 30. September 2024 hielten die folgenden Teifonds offene Terminkontrakte auf Indizes (mit Marktwertrisiken), Rentenwerte und Währungen:

Fälligkeits-datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long-Position	Markt-preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Jun. 25	335	3 Month CORRA Future	J.P. Morgan	CAD	60.062.784	97,18	115.596
Sep. 25	70	3 Month CORRA Future	J.P. Morgan	CAD	(12.546.896)	97,41	(57.451)
Dez. 25	65	3 Month CORRA Future	J.P. Morgan	CAD	(11.675.524)	97,50	(39.327)
Mrz. 26	48	3 Month CORRA Future	J.P. Morgan	CAD	(8.649.331)	97,54	(5.185)
Jun. 25	19	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	5.169.872	98,03	13.427
Sep. 25	27	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	7.352.439	98,16	22.694
Dez. 25	30	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	8.179.551	98,19	17.964
Mrz. 27	339	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	92.316.352	97,99	126.885
Sep. 25	26	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	6.299.688	96,79	(8.338)
Dez. 25	30	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	7.279.400	96,94	(9.275)
Mrz. 26	30	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	7.283.213	97,00	(8.213)
Jun. 27	73	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	17.696.713	96,93	(6.988)
Sep. 27	77	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	18.656.350	96,90	(3.100)
Dez. 27	84	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	20.349.400	96,88	(5.650)
Mrz. 28	90	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	21.796.713	96,85	(6.588)
Jun. 28	88	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	21.298.263	96,82	1.038
Sep. 28	94	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	22.744.175	96,79	300
Dez. 28	84	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	20.327.050	96,76	(8.500)
Dez. 24	265	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	181.361.411	9,90	(35.983)
Mrz. 25	257	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	176.026.485	9,91	(20.400)
Jun. 25	265	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	181.611.519	9,91	2.004
Sep. 25	49	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(33.526.648)	9,92	(68.681)
Okt. 24	7	Amsterdam Index Future	Morgan Stanley	EUR	1.428.761	912,00	(7.492)
Dez. 24	138	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	11.202.093	116,40	(97.157)
Dez. 24	235	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	17.450.055	107,18	(36.963)
Okt. 24	76	BIST 30 Index Futures	Morgan Stanley	TRY	(247.557)	11.149,50	(228)
Okt. 24	14	CAC 40 Index Future	Morgan Stanley	EUR	1.206.733	7.649,50	(14.627)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits-datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long-Position	Markt-preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Dez. 24	416	Canada 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	38.306.318	125,01	145.499
Dez. 24	105	Canada 2 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	8.167.570	105,25	3.712
Dez. 24	476	Canada 5 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	40.403.194	115,44	226.360
Okt. 24	9	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(163.960)	18,84	(5.623)
Nov. 24	18	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(320.500)	18,10	(5.255)
Dez. 24	17	Dax Index Future	Morgan Stanley	EUR	8.941.989	19.503,00	284.660
Dez. 24	22	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	J.P. Morgan	USD	4.617.410	42.643,00	73.320
Dez. 24	16	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	4.603.613	5.814,25	47.788
Dez. 24	11	Euro BUXL 30 Year Bond Future	Morgan Stanley	EUR	1.681.435	136,28	(12.734)
Dez. 24	64	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	3.521.817	5.030,00	61.635
Dez. 24	68	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	9.039.145	120,05	47.943
Dez. 24	229	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	30.261.461	121,47	702.620
Dez. 24	65	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	9.734.018	134,92	28.085
Dez. 24	329	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	46.500.783	126,84	(48.634)
Dez. 24	22	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	2.459.406	8.288,50	(21.518)
Okt. 24	629	FTSE China A50 Future	Morgan Stanley	USD	(7.973.003)	13.900,00	(770.097)
Dez. 24	45	FTSE MIB Index Future	Morgan Stanley	EUR	8.439.057	34.053,00	89.815
Okt. 24	105	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	7.996.644	1.866,00	(159.444)
Dez. 24	153	FTSE/JSE Top 40 Future	Morgan Stanley	ZAR	6.676.520	79.617,00	373.922
Okt. 24	7	Hang Seng Index Future	Morgan Stanley	HKD	919.782	21.278,00	38.212
Okt. 24	12	Hang Seng TECH Index Future	Morgan Stanley	HKD	347.736	4.789,00	21.888
Okt. 24	10	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	459.296	7.555,00	26.628
Okt. 24	9	IBEX 35 Index Future	Morgan Stanley	EUR	1.163.982	11.891,40	27.340
Sep. 25	48	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	15.418.860	96,29	28.527
Dez. 25	42	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	13.520.257	96,46	20.773
Mrz. 26	54	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	17.412.737	96,55	13.403
Jun. 27	228	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	73.532.682	96,57	59.595
Okt. 24	153	IFSC Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	8.009.823	26.006,50	(51.834)
Dez. 24	78	Japan 10 Year Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	78.391.894	144,65	110.106
Dez. 24	13	KOSPI2 Index Future	J.P. Morgan	KRW	(853.158)	347,90	(11.471)
Dez. 24	79	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	10.590.809	98,43	(194.727)
Okt. 24	1.447	Mini Bovespa Future	Morgan Stanley	BRL	7.324.001	132.581,00	(280.856)
Dez. 24	133	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	16.255.550	2.487,80	288.320
Dez. 24	157	MSCI Emerging Markets Index Future	Morgan Stanley	USD	8.767.408	1.172,70	438.288
Okt. 24	209	MSCI Singapore Index ETS Future	Morgan Stanley	SGD	5.564.228	343,40	19.946
Dez. 24	3	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	1.201.790	20.261,25	13.885
Dez. 24	4	Nikkei 225 (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	1.059.315	37.950,00	(3.131)
Dez. 24	2	Nikkei 225 (SGX) Future	Morgan Stanley	JPY	269.925	37.840,00	(6.645)
Okt. 24	61	OMXS30 Index Future	Morgan Stanley	SEK	1.527.580	2.625,75	49.548
Dez. 24	13	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	1.460.125	2.249,20	1.855
Dez. 24	8	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	2.496.400	3.148,60	22.480
Dez. 24	126	S&P/TSX 60 Index Future	J.P. Morgan	CAD	26.653.686	1.444,40	259.605
Dez. 24	469	SET 50 Index Future	J.P. Morgan	THB	2.696.931	914,70	(30.507)
Dez. 24	664	Short-Term Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	78.961.361	107,67	620.937
Dez. 24	546	South Korea 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	49.163.646	117,38	(154.332)
Dez. 24	2.018	South Korea 3 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	164.093.538	106,35	22.314
Dez. 24	216	SPI 200 Future	Morgan Stanley	AUD	30.595.624	8.306,00	413.082
Dez. 24	23	Stoxx Euro ESG-X Index Future	Morgan Stanley	EUR	495.163	195,60	5.622
Dez. 24	24	Swiss Market Index Future	Morgan Stanley	CHF	3.432.032	12.206,00	29.231
Dez. 24	13	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	2.373.561	2.647,50	21.116
Dez. 24	20	WIG20 Index Future	Morgan Stanley	PLN	(241.309)	2.358,00	(3.741)
							USD 2.737.273

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits-datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long-Position	Markt-preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix							
Dez. 24	4	Australia 10 Year Bond Future	Goldman Sachs	AUD	323.623	116,40	(623)
Dez. 24	1	E-mini Nikkei 225 (YEN) Future	Goldman Sachs	JPY	26.587	37.950,00	(56)
Dez. 24	3	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	(853.680)	5.814,25	(18.458)
Dez. 24	22	E-mini S&P 500 Future	J.P. Morgan	USD	(6.355.250)	5.814,25	(40.425)
Dez. 24	1	Euro BUXL 30 Year Bond Future	Goldman Sachs	EUR	152.698	136,28	(603)
Dez. 24	7	Euro Stoxx 50 Future	Goldman Sachs	EUR	(378.387)	5.030,00	(14.574)
Dez. 24	23	Euro Stoxx Future	J.P. Morgan	EUR	(653.855)	519,40	(12.773)
Dez. 24	2	Euro-Bund Future	Goldman Sachs	EUR	301.490	134,92	(335)
Dez. 24	65	FTSE 100 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(7.248.788)	8.288,50	22.231
Dez. 24	19	FTSE 250 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(1.066.727)	21.164,00	(12.029)
Okt. 24	3	FTSE China A50 Future	Goldman Sachs	USD	(41.376)	13.900,00	(324)
Dez. 24	2	FTSE MIB Mini Future	Goldman Sachs	EUR	76.176	34.053,00	(166)
Okt. 24	4	IFSC Nifty 50 Future	Goldman Sachs	USD	207.447	26.006,50	605
Dez. 24	2	Long Gilt Future	Goldman Sachs	GBP	264.675	98,43	(617)
Dez. 24	11	Micro E-mini Russell 2000 Future	Goldman Sachs	USD	123.059	2.249,20	647
Dez. 24	1	Mini Dax Index Future	Goldman Sachs	EUR	108.943	19.503,00	(112)
Okt. 24	2	Mini Hang Seng Index Future	Goldman Sachs	HKD	54.190	21.278,00	597
Dez. 24	1	Mini Topix Index Future	Goldman Sachs	JPY	18.549	2.647,50	(40)
Dez. 24	10	MSCI AC AJX NTR Future	J.P. Morgan	USD	(581.030)	636,10	(55.070)
Dez. 24	12	MSCI Asia Future	Goldman Sachs	USD	(783.740)	671,20	(21.700)
Dez. 24	64	MSCI Asia Future	J.P. Morgan	USD	(4.003.388)	671,20	(292.292)
Dez. 24	6	MSCI China Future	Goldman Sachs	USD	(132.420)	549,00	(32.280)
Dez. 24	332	MSCI China Future	J.P. Morgan	USD	7.332.176	549,00	1.781.224
Dez. 24	2	MSCI EAFE Index Future	J.P. Morgan	USD	(244.250)	2.487,80	(4.530)
Dez. 24	31	MSCI Emerging Markets Index Future	Goldman Sachs	USD	(1.708.992)	1.172,70	(108.693)
Dez. 24	7	MSCI Emerging Markets Index Future	J.P. Morgan	USD	(390.600)	1.172,70	(19.845)
Dez. 24	35	MSCI Europe Future	Goldman Sachs	EUR	(1.346.966)	348,30	(13.554)
Dez. 24	378	MSCI Europe Future	J.P. Morgan	EUR	(14.547.236)	348,30	(146.388)
Dez. 24	3	MSCI India Future	Goldman Sachs	USD	422.372	1.419,80	3.569
Dez. 24	37	MSCI India Future	J.P. Morgan	USD	5.209.249	1.419,80	44.011
Dez. 24	6	MSCI Switzerland Future	J.P. Morgan	CHF	(274.803)	3.913,00	(3.521)
Dez. 24	45	MSCI World Index Future	J.P. Morgan	USD	(5.260.500)	11.848,00	(71.100)
Dez. 24	3	Nasdaq 100 E-mini Future	Goldman Sachs	USD	121.071	20.261,25	497
Okt. 24	3	OMXS30 Index Future	Goldman Sachs	SEK	77.704	2.625,75	8
Dez. 24	1	Russell 1000 E-mini Future	Goldman Sachs	USD	(93.600)	1.885,20	(660)
Dez. 24	2	Russell 2000 E-mini Future	Goldman Sachs	USD	146.300	1.457,40	(560)
Dez. 24	1	S&P/TSX 60 Index Future	Goldman Sachs	CAD	213.287	1.444,40	548
Dez. 24	9	S&P500 Micro E-mini Future	Goldman Sachs	USD	260.123	5.814,25	1.519
Dez. 24	1	SPI 200 Future	Goldman Sachs	AUD	143.572	8.306,00	486
Dez. 24	10	SPI 200 Future	J.P. Morgan	AUD	(1.428.466)	8.306,00	(12.106)
Dez. 24	12	Stoxx 600 Bank Future	Goldman Sachs	EUR	(134.576)	203,20	(1.493)
Dez. 24	61	Topix Index Future	Goldman Sachs	JPY	(10.812.843)	2.647,50	(477.531)
Dez. 24	31	Topix Index Future	J.P. Morgan	JPY	(5.512.968)	2.647,50	(224.762)
Dez. 24	6	US 10 Year Note Future (CBT)	Goldman Sachs	USD	687.656	114,28	(1.969)
Dez. 24	3	US Long Bond Future (CBT)	Goldman Sachs	USD	374.531	124,19	(1.969)
						USD	264.784
Schroder GAIA Oaktree Credit							
Dez. 24	100	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	20.772.682	104,12	51.537
Dez. 24	65	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	7.116.992	109,88	25.391
						USD	76.928
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Dez. 24	14	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(3.772.901)	97,16	(12.476)
Mrz. 25	1	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	270.537	97,72	1.405
Jun. 25	61	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(16.542.564)	98,03	(98.556)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits-datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long-Position	Markt-preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Sep. 25	49	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	13.250.715	98,16	133.787
Dez. 25	34	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	9.235.991	98,19	54.526
Mrz. 25	39	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	9.366.413	95,96	(10.312)
Jun. 25	27	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(6.439.576)	96,49	(73.162)
Sep. 25	100	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(24.039.800)	96,79	(157.700)
Dez. 25	59	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(14.196.438)	96,94	(101.475)
Mrz. 26	39	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9.353.663)	97,00	(103.837)
Jun. 26	39	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(9.429.525)	97,03	(30.413)
Sep. 26	15	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(3.640.775)	97,02	2.525
Dez. 26	26	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	6.266.925	97,00	37.750
Mrz. 27	19	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	4.607.500	96,96	(1.900)
Okt. 24	10	Amsterdam Index Future	Morgan Stanley	EUR	(2.002.958)	912,00	(27.428)
Dez. 24	10	Australia 10 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	811.938	116,40	(7.232)
Dez. 24	7	Australia 3 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	519.345	107,18	(657)
Dez. 24	1	Australian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(66.895)	69,25	(2.350)
Dez. 24	1	British Pound Future	Morgan Stanley	USD	81.875	133,74	1.713
Okt. 24	25	CAC 40 Index Future	Citi Bank	EUR	2.081.173	7.649,50	47.587
Dez. 24	3	Canada 10 Year Bond Future	Citi Bank	CAD	277.215	125,01	81
Dez. 24	1	Canada 5 Year Bond Future	Citi Bank	CAD	(84.706)	115,44	(651)
Dez. 24	1	Canadian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(73.794)	74,09	(296)
Okt. 24	7	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	135.727	18,84	(3.829)
Nov. 24	5	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	97.770	18,10	(7.283)
Dez. 24	29	Dax Index Future	Newedge Group	EUR	(15.234.539)	19.503,00	(505.040)
Dez. 24	54	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Morgan Stanley	USD	(11.216.610)	42.643,00	(297.000)
Dez. 24	159	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	45.327.477	5.814,25	895.810
Dez. 24	9	Euro BUXL 30 Year Bond Future	Newedge Group	EUR	(1.331.572)	136,28	(33.728)
Dez. 24	97	Euro Stoxx 50 Future	Newedge Group	EUR	5.281.624	5.030,00	149.546
Dez. 24	50	Euro Stoxx Banks Future	Morgan Stanley	EUR	401.277	144,70	1.405
Dez. 24	72	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(9.512.974)	120,05	(108.649)
Dez. 24	114	Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	15.037.922	121,47	376.512
Dez. 24	45	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(6.652.685)	134,92	(105.694)
Dez. 24	27	Euro-OAT Future	Newedge Group	EUR	(3.774.146)	126,84	(38.036)
Dez. 24	181	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(21.473.804)	107,18	(119.831)
Dez. 24	103	FTSE 100 Index Future	Newedge Group	GBP	(11.535.037)	8.288,50	121.288
Okt. 24	317	FTSE China A50 Future	Newedge Group	USD	(3.880.943)	13.900,00	(525.357)
Dez. 24	22	FTSE MIB Index Future	Newedge Group	EUR	4.128.451	34.053,00	41.220
Dez. 24	60	FTSE/JSE Top 40 Future	Newedge Group	ZAR	(2.630.530)	79.617,00	(134.350)
Okt. 24	12	IBEX 35 Index Future	Newedge Group	EUR	(1.565.178)	11.891,40	(23.251)
Mrz. 25	4	ICE 3 Month SONIA Index Future	Newedge Group	GBP	1.276.453	95,51	468
Okt. 24	69	IFSC Nifty 50 Future	Newedge Group	USD	3.600.169	26.006,50	(11.272)
Dez. 24	19	Japan 10 Year Bond (OSE) Future	Newedge Group	JPY	19.078.240	144,65	44.042
Dez. 24	1	Japanese Yen Future	Morgan Stanley	USD	89.063	70,31	(1.181)
Dez. 24	38	KOSDAQ150 Index Future	Newedge Group	KRW	(348.968)	1.293,80	(26.993)
Dez. 24	78	KOSPI2 Index Future	Newedge Group	KRW	(5.051.331)	347,90	(136.442)
Dez. 24	45	Long Gilt Future	Newedge Group	GBP	5.945.067	98,43	(23.247)
Dez. 24	3	Mexican Peso Future	Morgan Stanley	USD	74.445	5,03	960
Dez. 24	20	MSCI EAFE Index Future	Citi Bank	USD	(2.440.200)	2.487,80	(47.600)
Dez. 24	75	MSCI Emerging Markets Index Future	Citi Bank	USD	(4.112.625)	1.172,70	(285.000)
Okt. 24	33	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	(883.439)	343,40	1.727
Dez. 24	97	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	38.365.367	20.261,25	941.458
Dez. 24	1	New Zealand Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(61.815)	63,55	(1.730)
Dez. 24	3	Nikkei 225 (OSE) Future	Newedge Group	JPY	(760.063)	37.950,00	(32.075)
Dez. 24	11	Nikkei 225 (YEN) Future	Morgan Stanley	JPY	(1.377.631)	38.115,00	(80.936)
Okt. 24	42	OMXS30 Index Future	Newedge Group	SEK	(1.054.399)	2.625,75	(31.492)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits-datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long-Position	Markt-preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Dez. 24	59	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(6.413.433)	2.249,20	(221.707)
Dez. 24	8	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	2.411.920	3.148,60	106.960
Dez. 24	18	S&P/TSX 60 Index Future	Citi Bank	CAD	3.805.665	1.444,40	39.090
Dez. 24	62	SET 50 Index Future	Newedge Group	THB	356.259	914,70	(3.768)
Dez. 24	59	Short-Term Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	7.013.524	107,67	57.795
Dez. 24	127	South Korea 10 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	(11.419.997)	117,38	20.395
Dez. 24	16	South Korea 3 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	1.299.870	106,35	1.346
Dez. 24	40	SPI 200 Future	Newedge Group	AUD	5.671.075	8.306,00	71.278
Dez. 24	1	Stoxx 600 Bank Future	Newedge Group	EUR	11.218	203,20	92
Dez. 24	41	Stoxx Europe 600 Future	Newedge Group	EUR	1.188.997	525,90	11.085
Dez. 24	1	Swiss Franc Future	Morgan Stanley	USD	148.104	119,11	777
Okt. 24	22	TAIEX Future	Morgan Stanley	TWD	3.025.822	22.326,00	78.294
Dez. 24	6	Topix Index Future	Newedge Group	JPY	1.082.936	2.647,50	22.300
Dez. 24	55	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	6.280.188	114,28	5.281
Dez. 24	10	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(1.181.734)	118,30	(1.234)
Dez. 24	46	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(9.564.055)	104,12	(15.086)
Dez. 24	2	US 3 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	425.984	106,70	813
Dez. 24	86	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(9.435.141)	109,88	(14.781)
Okt. 24	10	US Dollar Future	Newedge Group	KRW	102.492	1.306,50	(2.584)
Dez. 24	1	US Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	101.243	100,52	(722)
Dez. 24	12	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(1.493.625)	124,19	3.375
Dez. 24	10	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	1.330.166	133,09	771
Okt. 24	58	VSTOXX Mini Future	Newedge Group	EUR	(115.804)	19,05	(7.188)
Dez. 24	20	WIG20 Index Future	Newedge Group	PLN	(244.427)	2.358,00	(624)
						USD	(202.693)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Dez. 24	18	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	1.335.090	107,18	(1.322)
Dez. 24	25	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	(1.411.730)	5.030,00	11.944
Dez. 24	94	Euro Stoxx Banks Future	Morgan Stanley	EUR	(749.719)	144,70	(7.323)
Dez. 24	13	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	1.738.217	120,05	(980)
Dez. 24	15	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	2.259.661	134,92	(6.868)
Dez. 24	19	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(2.254.151)	107,18	(12.584)
Dez. 24	42	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(5.548.062)	98,43	21.030
Dez. 24	5	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	(901.451)	2.647,50	(19.579)
Dez. 24	22	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(2.530.276)	114,28	16.089
Dez. 24	48	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	10.008.898	104,12	(13.274)
Dez. 24	18	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(1.964.008)	109,88	(13.883)
Dez. 24	5	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(625.750)	124,19	4.813
Dez. 24	9	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(1.215.938)	133,09	18.094
						USD	(3.843)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte

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

Zum 30. September 2024 waren die folgenden Teilfonds in offenen Optionskontrakten auf Finanzindizes und international notierte Aktien engagiert:

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend						
(4.083.398)	Put auf UBS ETC Linked to a Systematica Strategy Delta-1 Basket on Commodity Future Ausübungskurs 54,64 Verfallstermin 01. Okt. 2024	UBS	USD	(16.293) USD	- -	16.293 16.293
Schroder GAIA Contour Tech Equity						
513	Put auf Trade Desk, Inc. Ausübungskurs 50,00 Verfallstermin 15. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	113.373 USD	126.968 126.968	13.595 13.595
Schroder GAIA Helix						
83	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 8.100,00 Verfallstermin 18. Okt. 2023	UBS	GBP	28.278	36.740	8.462
62	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 8.150,00 Verfallstermin 18. Okt. 2023	UBS	GBP	36.051	36.800	749
20	Put auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 1.060,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	UBS	USD	11.074	2.500	(8.574)
16	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 5.450,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	UBS	USD	60.860	17.680	(43.180)
25	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 5.550,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	UBS	USD	89.633 USD	45.625 139.345	(44.008) (86.551)
Schroder GAIA SEG US Equity						
304	Call auf Citizens Financial Group, Inc. Ausübungskurs 27,50 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Goldman Sachs	USD	353.262	408.880	55.618
360	Call auf Estee Lauder Cos., Inc. Ausübungskurs 70,00 Verfallstermin 18. Jun. 2026	Goldman Sachs	USD	916.870	1.359.000	442.130
1.736	Call auf Pfizer, Inc. Ausübungskurs 35,00 Verfallstermin 18. Dez. 2026	Goldman Sachs	USD	383.587	343.728	(39.859)
468	Call auf Polaris, Inc. Ausübungskurs 70,00 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Goldman Sachs	USD	514.969	680.940	165.971
1.640	Call auf VF Corp. Ausübungskurs 17,50 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Goldman Sachs	USD	324.764	914.300	589.536
346	Put auf DaVita, Inc. Ausübungskurs 110,00 Verfallstermin 18. Dez. 2026	Goldman Sachs	USD	352.627	330.430	(22.197)
80	Call auf Eli Lilly & Co. Ausübungskurs 510,00 Verfallstermin 18. Dez. 2026	Goldman Sachs	USD	126.162	183.200	57.038
295	Put auf ResMed, Inc. Ausübungskurs 150,00 Verfallstermin 17. Apr. 2025	Goldman Sachs	USD	155.664	76.700	(78.964)
94	Put auf ResMed Inc. Ausübungskurs 220,00 Verfallstermin 15. Jan. 2027	Goldman Sachs	USD	339.415 USD	352.500 4.649.678	13.085 1.182.358

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity						
1.156	Put auf GE Vernova, Inc. Ausübungskurs 210,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Goldman Sachs	USD	440.028 USD	450.840 450.840	10.812 10.812
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
10	Call auf Adobe, Inc. Ausübungskurs 550,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	7.445	8.900	1.455
(10)	Call auf Airbnb, Inc. Ausübungskurs 600,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1.429)	(1.715)	(286)
31	Call auf Apple, Inc. Ausübungskurs 140,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3.324	946	(2.378)
20	Call auf Applied Materials, Inc. Ausübungskurs 230,00 Verfallstermin 25. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3.740	4.870	1.130
31	Call auf Astera Labs, Inc. Ausübungskurs 55,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	5.451	2.356	(3.095)
36	Call auf Astera Labs, Inc. Ausübungskurs 65,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7.714	8.910	1.196
(36)	Call auf AT&T, Inc. Ausübungskurs 23,00 Verfallstermin 25. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(1.752)	(1.890)	(138)
365	Call auf Broadcom, Inc. Ausübungskurs 185,00 Verfallstermin 11. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	14.409	6.935	(7.474)
41	Call auf CBOE Mini-SPX Index Ausübungskurs 592,00 Verfallstermin 15. Nov. 2021	Morgan Stanley	USD	9.449	3.628	(5.821)
11	Call auf Crown Castle, Inc. Ausübungskurs 125,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	5.251	6.023	772
21	Call auf Datadog, Inc. Ausübungskurs 124,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3.595	4.357	762
26	Call auf Domino's Pizza, Inc. Ausübungskurs 450,00 Verfallstermin 25. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3.079	1.807	(1.272)
10	Call auf Domino's Pizza, Inc. Ausübungskurs 480,00 Verfallstermin 25. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7.865	13.950	6.085
(10)	Call auf DoorDash, Inc. Ausübungskurs 150,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(2.299)	(4.950)	(2.651)
26	Call auf Expedia Group, Inc. Ausübungskurs 150,00 Verfallstermin 20. Mrz. 2025	Morgan Stanley	USD	5.429	3.211	(2.218)
20	Call auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,68 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	5.346	5.950	604
(1.970.000)	Call auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,71 Verfallstermin 20. Mrz. 2025	Bank of America	AUD	(34.001)	(46.994)	(12.993)
1.970.000	Call auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,62 Verfallstermin 31. Okt. 2024	Bank of America	AUD	13.066	19.777	6.711
185.000	Call auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,63 Verfallstermin 02. Okt. 2024	Bank of America	EUR	1.867	1.428	(439)
184.000		Citi Bank	EUR	1.670	8	(1.662)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
269.000	Call auf EUR/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 393,74 Verfallstermin 01. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1.932	2.688	756
1.609.000	Call auf EUR/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 400,00 Verfallstermin 21. Mrz. 2025	Bank of America	EUR	31.173	34.802	3.629
(269.000)	Call auf EUR/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 22,16 Verfallstermin 01. Okt. 2024	HSBC	EUR	(6.837)	(120)	6.717
(277.000)	Call auf EUR/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 11,82 Verfallstermin 15. Okt. 2024	Morgan Stanley	EUR	(3.075)	(1.304)	1.771
(277.000)	Call auf EUR/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 11,83 Verfallstermin 08. Okt. 2024	J.P. Morgan	EUR	(3.011)	(680)	2.331
185.000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,78 Verfallstermin 23. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1.762	591	(1.171)
184.000	Call auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 1,80 Verfallstermin 16. Okt. 2024	Barclays Bank	EUR	1.855	174	(1.681)
277.000	Call auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,29 Verfallstermin 08. Okt. 2024	J.P. Morgan	EUR	1.645	627	(1.018)
277.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,10 Verfallstermin 15. Okt. 2024	J.P. Morgan	EUR	1.603	991	(612)
181.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,10 Verfallstermin 06. Nov. 2024	Bank of America	EUR	2.495	3.645	1.150
185.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Verfallstermin 09. Okt. 2024	UBS	EUR	1.320	1.658	338
184.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Verfallstermin 16. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1.381	1.084	(297)
185.000	Call auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,93 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Bank of America	EUR	2.537	2.405	(132)
155.000	Call auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,94 Verfallstermin 31. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1.685	1.596	(89)
155.000	Call auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 187,08 Verfallstermin 02. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1.591	327	(1.264)
156.000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,28 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	2.707	5.540	2.833
157.000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Verfallstermin 01. Nov. 2024	BNP Paribas	GBP	2.585	9.148	6.563
155.000	Call auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Verfallstermin 02. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1.629	3.300	1.671
155.000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Verfallstermin 16. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1.567	3.107	1.540
335.000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Bank of America	NZD	3.340	7.679	4.339
(495.000)	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,62 Verfallstermin 09. Okt. 2024	HSBC	NZD	(3.550)	(10.388)	(6.838)
330.000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,62 Verfallstermin 23. Okt. 2024	HSBC	NZD	2.227	4.808	2.581

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
207.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,49 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Barclays Bank	USD	5.637	5.605	(32)
450.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,65 Verfallstermin 02. Jan. 2025	Barclays Bank	USD	21.780	8.559	(13.221)
448.000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 6,14 Verfallstermin 30. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	7.759	1.997	(5.762)
206.000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 20. Dez. 2024	UBS	USD	2.014	2.092	78
207.000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 31. Okt. 2024	Citi Bank	USD	1.124	1.157	33
206.000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,36 Verfallstermin 23. Okt. 2024	Citi Bank	USD	1.004	648	(356)
199.000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,37 Verfallstermin 07. Nov. 2024	Barclays Bank	USD	2.123	282	(1.841)
1.732.000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,84 Verfallstermin 13. Feb. 2025	Barclays Bank	USD	25.720	12.109	(13.611)
206.000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,85 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Bank of America	USD	3.062	2.340	(722)
199.000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,89 Verfallstermin 06. Nov. 2024	Barclays Bank	USD	3.190	1.493	(1.697)
2.034.000	Call auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 946,65 Verfallstermin 09. Okt. 2024	UBS	USD	21.052	499	(20.553)
308.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,97 Verfallstermin 30. Okt. 2024	Barclays Bank	USD	4.472	89	(4.383)
(311.000)	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,11 Verfallstermin 30. Okt. 2024	Bank of America	USD	(2.092)	(2.925)	(833)
(309.000)	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,29 Verfallstermin 10. Okt. 2024	Bank of America	USD	(1.794)	(81)	1.713
1.356.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,35 Verfallstermin 09. Mai 2025	Morgan Stanley	USD	11.960	6.375	(5.585)
1.356.000	Call auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4.186,00 Verfallstermin 05. Mrz. 2025	J.P. Morgan	USD	10.234	3.335	(6.899)
1.356.000	Call auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 7,37 Verfallstermin 18. Feb. 2025	BNP Paribas	USD	12.611	3.033	(9.578)
1.356.000	Call auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4.226,00 Verfallstermin 22. Apr. 2025	BNP Paribas	USD	14.374	4.482	(9.892)
299.000	Call auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 84,03 Verfallstermin 01. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	4.899	1.788	(3.111)
307.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 84,63 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Barclays Bank	USD	4.884	2.255	(2.629)
207.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 84,63 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	1.000	1.087	87
1.732.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 84,63 Verfallstermin 14. Feb. 2025	Goldman Sachs	USD	14.360	9.732	(4.628)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(207.000)	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 141,30 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	(4.624)	(5.269)	(645)
202.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 155,70 Verfallstermin 15. Okt. 2024	Bank of America	USD	3.563	5	(3.558)
(479.000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,28 Verfallstermin 04. Dez. 2024	UBS	USD	(17.163)	(39.543)	(22.380)
(460.000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,87 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Barclays Bank	USD	(18.561)	(27.919)	(9.358)
(866.000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,42 Verfallstermin 13. Feb. 2025	Deutsche Bank	USD	(34.970)	(45.713)	(10.743)
309.000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,49 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Barclays Bank	USD	5.250	7.039	1.789
309.000	Call auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 20,17 Verfallstermin 10. Okt. 2024	Deutsche Bank	USD	5.698	1.153	(4.545)
880.000	Call auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,06 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Barclays Bank	USD	24.033	11.154	(12.879)
(207.000)	Call auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,12 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Barclays Bank	USD	(4.022)	(4.597)	(575)
312.000	Call auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,30 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Citi Bank	USD	3.211	3.486	275
(307.000)	Call auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 32,60 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Bank of America	USD	(1.827)	(67)	1.760
(312.000)	Call auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 33,92 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Citi Bank	USD	(3.253)	(2.082)	1.171
(299.000)	Call auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 35,65 Verfallstermin 01. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(2.989)	-	2.989
(1.056.000)	Call auf USD/TWD-Devisenkurs Ausübungskurs 36,36 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Bank of America	USD	(23.057)	(1.412)	21.645
(1.391.000)	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 31,36 Verfallstermin 17. Okt. 2024	Bank of America	USD	(30.744)	(2)	30.742
311.000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 17,37 Verfallstermin 30. Okt. 2024	Bank of America	USD	2.879	4.119	1.240
(309.000)	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,20 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Bank of America	USD	(4.257)	(3.400)	857
460.000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,84 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Bank of America	USD	18.982	4.685	(14.297)
479.000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 19,23 Verfallstermin 04. Dez. 2024	Bank of America	USD	20.210	1.706	(18.504)
696.000	Call auf International Business Machines Corp. Ausübungskurs 220,00 Verfallstermin 17. Okt. 2024	Bank of America	USD	30.176	50	(30.126)
26	Call auf McDonald's Corp. Ausübungskurs 305,00 Verfallstermin 18. Apr. 2024	Morgan Stanley	USD	5.099	12.350	7.251
21	Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	4.364	9.923	5.559

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
10	Call auf Microsoft Corp. Ausübungskurs 450,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024 Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 19.900,00	Morgan Stanley	USD	4.127	1.435	(2.692)
2	Verfallstermin 18. Okt. 2024 Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 20.225,00	Morgan Stanley	USD	58.211	85.040	26.829
2	Verfallstermin 18. Okt. 2024 Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 20.550,00	Morgan Stanley	USD	43.167	48.070	4.903
1	Ausübungskurs 20.550,00 Verfallstermin 11. Okt. 2024 Call auf NVIDIA Corp. Ausübungskurs 130,00	Morgan Stanley	USD	8.041	7.175	(866)
21	Verfallstermin 18. Okt. 2024 Call auf PENN Entertainment, Inc. Ausübungskurs 21,00	Morgan Stanley	USD	4.795	3.801	(994)
105	Verfallstermin 01. Nov. 2024 Put auf Philadelphia Stock Exchange Ausübungskurs 5.684,00	Morgan Stanley	USD	7.196	7.560	364
98	Verfallstermin 18. Okt. 2024 Call auf Pinterest, Inc. Ausübungskurs 35,00	Morgan Stanley	USD	3.749	2.112	(1.637)
303	Verfallstermin 25. Okt. 2024 Call auf RH Ausübungskurs 340,00	Morgan Stanley	USD	17.298	11.514	(5.784)
5	Verfallstermin 04. Okt. 2024 Call auf RH Ausübungskurs 380,00	Morgan Stanley	USD	6.011	2.250	(3.761)
(5)	Verfallstermin 04. Okt. 2024 Call auf Russel 2000 Index Ausübungskurs 2.260,00	Morgan Stanley	USD	(1.354)	(113)	1.241
6	Verfallstermin 30. Sep. 2024 Call auf Russel 2000 Index Ausübungskurs 2.270,00	Morgan Stanley	USD	14.524	24	(14.500)
4	Verfallstermin 18. Okt. 2024 Call auf Russel 2000 Index Ausübungskurs 2.275,00	Morgan Stanley	USD	10.685	10.120	(565)
10	Verfallstermin 11. Okt. 2024 Call auf Russel 2000 Index Ausübungskurs 2.300,00	Morgan Stanley	USD	17.608	18.050	442
16	Verfallstermin 18. Okt. 2024 Call auf S&P 500 Index Ausübungskurs 5.800,00	Morgan Stanley	USD	24.917	25.680	763
6	Verfallstermin 11. Okt. 2024 Call auf S&P Regional Banks Select Industry Index Ausübungskurs 1.823,00	Morgan Stanley	USD	23.836	21.060	(2.776)
684	Verfallstermin 18. Sep. 2024 Call auf Shopify, Inc. Ausübungskurs 86,00	Morgan Stanley	USD	17.036	13.765	(3.271)
16	Verfallstermin 18. Okt. 2024 Call auf Snowflake, Inc. Ausübungskurs 120,00	Morgan Stanley	USD	1.197	1.232	35
15	Verfallstermin 15. Nov. 2024 Call auf Snowflake, Inc. Ausübungskurs 140,00	Morgan Stanley	USD	6.441	8.513	2.072
(15)	Verfallstermin 15. Nov. 2024 Call auf SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF Ausübungskurs 5.264,00	Morgan Stanley	USD	(1.154)	(1.830)	(676)
110	Verfallstermin 18. Okt. 2024 Call auf Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. Ausübungskurs 185,00	Morgan Stanley	USD	9.307	2.960	(6.347)
21	Verfallstermin 01. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	9.996	9.765	(231)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
	Call auf Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. Ausübungskurs 205,00 Verfallstermin 01. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(2.213)	(2.237)	(24)
(21)	Call auf Tencent Music Entertainment Group Ausübungskurs 13,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	9.111	7.020	(2.091)
108	Call auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 255,00 Verfallstermin 04. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7.060	17.288	10.228
15	Call auf Ubisoft Entertainment S.A. Ausübungskurs 32,00 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Goldman Sachs	EUR	18.592	248	(18.344)
8.055	Call auf Verizon Communications, Inc. Ausübungskurs 47,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1.388)	(1.932)	(544)
(46)	Call auf Walmart, Inc. Ausübungskurs 86,67 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	5.672	7.599	1.927
51	Call auf Walt Disney Co. Ausübungskurs 100,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	8.583	12.710	4.127
41	Call auf Walt Disney Co. Ausübungskurs 110,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(2.427)	(3.567)	(1.140)
(41)	Call auf Warner Bros. Discovery, Inc. Ausübungskurs 9,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	11.917	3.266	(8.651)
311	Call auf Wayfair, Inc. Ausübungskurs 60,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	6.611	5.634	(977)
36	Call auf Yum China Holdings, Inc. Ausübungskurs 50,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	6.217	4.715	(1.502)
82	Put auf Adobe, Inc. Ausübungskurs 460,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1.647)	(1.493)	154
(5)	Put auf Airbnb, Inc. Ausübungskurs 115,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	8.283	10.404	2.121
36	Put auf Airbnb, Inc. Ausübungskurs 95,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	4.905	2.844	(2.061)
36	Put auf Alphabet, Inc. Ausübungskurs 155,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	2.758	1.030	(1.728)
20	Put auf Amazon.com, Inc. Ausübungskurs 177,50 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	4.979	4.896	(83)
36	Put auf Antero Resources Corp. Ausübungskurs 20,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	(62.765)	(44.022)	18.743
(319)	Put auf Apple, Inc. Ausübungskurs 210,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7.321	760	(6.561)
20	Put auf Apple, Inc. Ausübungskurs 215,00 Verfallstermin 04. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	1.579	221	(1.358)
52	Put auf CBOE Mini-SPX Index Ausübungskurs 560,00 Verfallstermin 04. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7.526	2.548	(4.978)
(58)	Put auf Chesapeake Energy Corp. Ausübungskurs 60,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	(29.969)	(19.865)	10.104
(57)	Put auf Chesapeake Energy Corp. Ausübungskurs 60,00 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Morgan Stanley	USD	(9.670)	(3.306)	6.364

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
102	Put auf Clear Secure, Inc. Ausübungskurs 31,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	9.419	3.825	(5.594)
(21)	Put auf Coherent Corp. Ausübungskurs 65,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1.495)	(1.575)	(80)
21	Put auf Coherent Corp. Ausübungskurs 80,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	6.811	7.350	539
(5)	Put auf Costco Wholesale Corp. Ausübungskurs 830,00 Verfallstermin 11. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(1.531)	(510)	1.021
5	Put auf Costco Wholesale Corp. Ausübungskurs 860,00 Verfallstermin 11. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3.513	2.025	(1.488)
(175)	Put auf Coterra Energy, Inc. Ausübungskurs 20,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	(27.594)	(23.625)	3.969
41	Put auf Crown Castle, Inc. Ausübungskurs 110,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7.207	2.153	(5.054)
25	Put auf Dell Technologies, Inc. Ausübungskurs 100,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	7.677	3.462	(4.215)
(25)	Put auf Dell Technologies, Inc. Ausübungskurs 85,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1.868)	(713)	1.155
20	Put auf Devon Energy Corp. Ausübungskurs 95,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	4.206	350	(3.856)
194	Put auf Diamondback Energy, Inc. Ausübungskurs 32,50 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	51.278	56.551	5.273
22	Put auf Doximity, Inc. Ausübungskurs 40,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	23.445	25.410	1.965
64	Put auf EQT Corp. Ausübungskurs 25,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	5.404	1.120	(4.284)
(245)	Put auf EQT Corp. Ausübungskurs 28,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	(46.258)	(33.810)	12.448
(258)	Put auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,62 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Morgan Stanley	USD	(35.522)	(8.643)	26.879
185.000	Put auf EUR/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,63 Verfallstermin 31. Okt. 2024	Bank of America	EUR	1.867	2.345	478
184.000	Put auf EUR/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 393,74 Verfallstermin 02. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1.670	2.666	996
269.000	Put auf EUR/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 22,16 Verfallstermin 01. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1.932	-	(1.932)
(269.000)	Put auf EUR/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 11,82 Verfallstermin 01. Okt. 2024	HSBC	EUR	(6.837)	(3.496)	3.341
(277.000)	Put auf EUR/NOK-Devisenkurs Ausübungskurs 11,83 Verfallstermin 15. Okt. 2024	Morgan Stanley	EUR	(3.075)	(3.155)	(80)
(277.000)	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,78 Verfallstermin 08. Okt. 2024	J.P. Morgan	EUR	(3.011)	(2.975)	36
185.000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,78 Verfallstermin 23. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1.762	3.951	2.189

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
184.000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,80 Verfallstermin 16. Okt. 2024	Barclays Bank	EUR	1.855	5.510	3.655
860.000	Put auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,20 Verfallstermin 11. Okt. 2024	Barclays Bank	EUR	4.901	11	(4.890)
277.000	Put auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,29 Verfallstermin 08. Okt. 2024	J.P. Morgan	EUR	1.645	778	(867)
277.000	Put auf EUR/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 4,29 Verfallstermin 15. Okt. 2024	J.P. Morgan	EUR	1.603	940	(663)
181.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,10 Verfallstermin 06. Nov. 2024	Bank of America	EUR	2.495	516	(1.979)
185.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Verfallstermin 09. Okt. 2024	UBS	EUR	1.320	411	(909)
184.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Verfallstermin 16. Okt. 2024	Citi Bank	EUR	1.381	1.110	(271)
185.000	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,12 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Bank of America	EUR	2.537	2.597	60
155.000	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,93 Verfallstermin 31. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1.685	1.773	88
155.000	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,94 Verfallstermin 02. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1.591	558	(1.033)
156.000	Put auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 187,08 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	2.707	235	(2.472)
157.000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,28 Verfallstermin 01. Nov. 2024	BNP Paribas	GBP	2.585	73	(2.512)
155.000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Verfallstermin 02. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1.629	2	(1.627)
155.000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Verfallstermin 16. Okt. 2024	Citi Bank	GBP	1.567	389	(1.178)
335.000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Bank of America	NZD	3.340	52	(3.288)
(495.000)	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,61 Verfallstermin 09. Okt. 2024	HSBC	NZD	(3.550)	(107)	3.443
330.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,32 Verfallstermin 23. Okt. 2024	HSBC	NZD	2.227	819	(1.408)
(448.000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,49 Verfallstermin 30. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	(6.129)	(5.582)	547
207.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,65 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Barclays Bank	USD	5.637	5.262	(375)
450.000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,32 Verfallstermin 02. Jan. 2025	Barclays Bank	USD	14.648	19.802	5.154
(1.341.000)	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 21. Mrz. 2025	Bank of America	USD	(6.866)	(8.134)	(1.268)
206.000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 20. Dez. 2024	UBS	USD	2.014	1.800	(214)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1.341.000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 21. Mrz. 2025	Bank of America	USD	18.302	20.815	2.513
207.000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,35 Verfallstermin 31. Okt. 2024	Citi Bank	USD	1.124	1.082	(42)
206.000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,36 Verfallstermin 23. Okt. 2024	Citi Bank	USD	1.004	1.426	422
199.000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,37 Verfallstermin 07. Nov. 2024	Barclays Bank	USD	2.123	3.396	1.273
1.732.000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 1,37 Verfallstermin 13. Feb. 2025	Barclays Bank	USD	24.560	35.406	10.846
206.000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,84 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Bank of America	USD	3.062	3.391	329
199.000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,85 Verfallstermin 06. Nov. 2024	Barclays Bank	USD	3.190	2.139	(1.051)
(2.034.000)	Put auf USD/CLP-Devisenkurs Ausübungskurs 946,65 Verfallstermin 08. Nov. 2024	Bank of America	USD	(17.505)	(79.325)	(61.820)
308.000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,81 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Barclays Bank	USD	4.472	16.261	11.789
(1.356.000)	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,82 Verfallstermin 09. Mai 2025	Morgan Stanley	USD	(11.662)	(16.974)	(5.312)
(1.356.000)	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,84 Verfallstermin 05. Mrz. 2025	J.P. Morgan	USD	(11.450)	(12.424)	(974)
(1.356.000)	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,84 Verfallstermin 18. Feb. 2025	BNP Paribas	USD	(13.126)	(12.565)	561
(1.356.000)	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,91 Verfallstermin 22. Apr. 2025	BNP Paribas	USD	(14.902)	(24.358)	(9.456)
(311.000)	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 6,97 Verfallstermin 30. Okt. 2024	Bank of America	USD	(2.091)	(2.016)	75
(309.000)	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 7,11 Verfallstermin 10. Okt. 2024	Bank of America	USD	(1.794)	(4.654)	(2.860)
299.000	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4.186,00 Verfallstermin 01. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	4.899	321	(4.578)
307.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 4.226,00 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Barclays Bank	USD	4.884	3.331	(1.553)
207.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 84,03 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	1.000	847	(153)
1.732.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 84,63 Verfallstermin 14. Feb. 2025	Goldman Sachs	USD	13.960	13.446	(514)
(207.000)	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 141,30 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Morgan Stanley	USD	(4.624)	(4.017)	607
202.000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 155,70 Verfallstermin 15. Okt. 2024	Bank of America	USD	3.563	17.211	13.648
(479.000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,28 Verfallstermin 04. Dez. 2024	UBS	USD	(17.163)	(1.163)	16.000

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(460.000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,87 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Barclays Bank	USD	(16.431)	(3.621)	12.810
(866.000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,42 Verfallstermin 13. Feb. 2025	Deutsche Bank	USD	(34.970)	(17.129)	17.841
309.000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,49 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Barclays Bank	USD	5.250	2.912	(2.338)
309.000	Put auf USD/PLN-Devisenkurs Ausübungskurs 20,17 Verfallstermin 10. Okt. 2024	Deutsche Bank	USD	5.698	8.348	2.650
880.000	Put auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 3,94 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Barclays Bank	USD	22.097	27.615	5.518
(207.000)	Put auf USD/SEK-Devisenkurs Ausübungskurs 10,06 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Barclays Bank	USD	(4.022)	(3.416)	606
312.000	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausübungskurs 10,12 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Citi Bank	USD	3.211	2.766	(445)
(307.000)	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 1,30 Verfallstermin 09. Okt. 2024	Bank of America	USD	(1.827)	(4.500)	(2.673)
(312.000)	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausübungskurs 32,60 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Citi Bank	USD	(3.253)	(4.353)	(1.100)
(299.000)	Put auf USD/TWD-Devisenkurs Ausübungskurs 33,92 Verfallstermin 01. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(2.989)	(13.892)	(10.903)
(1.056.000)	Put auf USD/TWD-Devisenkurs Ausübungskurs 35,65 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Bank of America	USD	(21.616)	(113.620)	(92.004)
(1.391.000)	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 36,36 Verfallstermin 17. Okt. 2024	Bank of America	USD	(28.514)	(170.661)	(142.147)
311.000	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 31,36 Verfallstermin 30. Okt. 2024	Bank of America	USD	2.879	1.982	(897)
(309.000)	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 17,37 Verfallstermin 24. Okt. 2024	Bank of America	USD	(4.257)	(4.325)	(68)
460.000	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,20 Verfallstermin 20. Dez. 2024	Bank of America	USD	16.774	25.480	8.706
479.000	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausübungskurs 18,84 Verfallstermin 04. Dez. 2024	Bank of America	USD	17.804	41.751	23.947
696.000	Put auf Global Payments, Inc. Ausübungskurs 105,00 Verfallstermin 17. Okt. 2024	Bank of America	USD	26.467	77.127	50.660
20	Call auf Marvell Technology, Inc. Ausübungskurs 57,50 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3.720	8.200	4.480
(26)	Call auf Marvell Technology, Inc. Ausübungskurs 67,50 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1.409)	(1.391)	18
26	Call auf Meta Platforms, Inc. Ausübungskurs 500,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	7.236	6.422	(814)
(16)	Call auf Meta Platforms, Inc. Ausübungskurs 540,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(2.191)	(1.336)	855
16	Call auf Meta Platforms, Inc. Ausübungskurs 540,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	9.427	5.760	(3.667)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
15	Put auf Micron Technology, Inc. Ausübungskurs 105,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	2.779	6.900	4.121
(21)	Put auf Micron Technology, Inc. Ausübungskurs 76,00 Verfallstermin 04. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(1.755)	(21)	1.734
21	Put auf Micron Technology, Inc. Ausübungskurs 86,00 Verfallstermin 04. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7.509	31	(7.478)
(3)	Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 17.300,00 Verfallstermin 30. Sep. 2024	Morgan Stanley	USD	(17.126)	(150)	16.976
3	Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 18.075,00 Verfallstermin 30. Sep. 2024	Morgan Stanley	USD	37.837	278	(37.559)
2	Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 19.725,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	31.935	35.990	4.055
31	Call auf NVIDIA Corp. Ausübungskurs 109,00 Verfallstermin 25. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7.780	4.325	(3.455)
(31)	Call auf NVIDIA Corp. Ausübungskurs 95,00 Verfallstermin 25. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(1.520)	(915)	605
103	Put auf Ovintiv Inc. Ausübungskurs 33,00 Verfallstermin 16. Jan. 2026	Morgan Stanley	USD	37.177	36.565	(612)
238	Put auf Philadelphia Stock Exchange Ausübungskurs 4.200,00 Verfallstermin 21. Mrz. 2025	UBS	USD	38.009	31.849	(6.160)
118	Put auf Philadelphia Stock Exchange Ausübungskurs 4.600,00 Verfallstermin 20. Dez. 2024	UBS	USD	19.647	15.592	(4.055)
128	Put auf Qualcomm, Inc. Ausübungskurs 160,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	11.648	13.267	1.619
15	Put auf S&P 500 Index vs SOFR Ausübungskurs 5.185,42 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	5.385	2.805	(2.580)
182.872	Put auf S&P 500 Index vs SOFR Ausübungskurs 5.185,42 Verfallstermin 17. Jan. 2025	Goldman Sachs	USD	11.155	5.451	(5.704)
222.989	Put auf S&P 500 Index vs SOFR Ausübungskurs 5.185,42 Verfallstermin 21. Mrz. 2025	Goldman Sachs	USD	14.829	9.508	(5.321)
222.989	Put auf Spotify Technology S.A. Ausübungskurs 360,00 Verfallstermin 20. Jun. 2025	Goldman Sachs	USD	16.724	13.202	(3.522)
10	Put auf Suncor Energy, Inc. Ausübungskurs 30,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	5.096	6.250	1.154
218	Put auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 190,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	46.048	41.093	(4.955)
30	Put auf Uber Technologies, Inc. Ausübungskurs 230,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7.817	3.720	(4.097)
(5)	Put auf Uber Technologies, Inc. Ausübungskurs 65,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	(630)	(413)	217
5	Put auf Target Corp. Ausübungskurs 150,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	3.827	2.700	(1.127)
57	Put auf Target Corp. Ausübungskurs 150,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	7.646	1.283	(6.363)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
	Put auf Verizon Communications, Inc. Ausübungskurs 39,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	(1.798)	(1.408)	390
(88)	Put auf Verizon Communications, Inc. Ausübungskurs 43,00 Verfallstermin 15. Nov. 2024	Morgan Stanley	USD	8.520	6.732	(1.788)
88	Put auf Vertiv Holdings Co. Ausübungskurs 98,00 Verfallstermin 18. Okt. 2024	Morgan Stanley	USD	9.914	9.360	(554)
26			USD	520.956		(360.049)

Swaptions

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

Zum 30. September 2024 waren die folgenden Teilfonds in offenen Swaptions auf Finanzindizes und international notierte Aktien engagiert:

Schutz- position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf	CDX "iTraxx Europe Crossover Series 41 20/06/2029", Put, Ausübungskurs 325,00, 18. Dez. 2024	Morgan Stanley	EUR	88.208	7.295.000	42.851	(45.357)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 6,80 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TII E Feb. 2025“, Call; 6,80 %; 07. Feb. 2025	J.P. Morgan	MXN	541.676	228.495.000	27.814	(513.862)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 7,29 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TII E Mrz. 2026“, Call, 7,29 %, 05 Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	396.524	157.510.000	113.524	(283.000)
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 9,92 % Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR Mai 2025“, Call, 9,92 %, 02. Mai 2025	J.P. Morgan	ZAR	69.362	49.657.000	274.327	204.965
Kauf	SWP „Zahlt Festzinssatz 9,37 % Erhält variablen Zinssatz MXN TII E Jun 2029“, Call 9,37 %, 14. Jun. 2029	J.P. Morgan	MXN	499.060	157.510.000	211.482	(287.578)
Kauf	SWP „Zahlt Festzinssatz 9,74 % Erhält variablen Zinssatz MXN TII E Apr 2028“, Put; 9,74 %; 06. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	76.455	17.150.000	28.509	(47.946)
Kauf	SWP „Erhält Festzinssatz 7,33 % Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR Mrz. 2025“, Call, 7,33 %, 04. Mrz. 2025	Goldman Sachs	ZAR	43.607	70.032.000	36.731	(6.876)
Kauf	SWP „Erhält Festzinssatz 8,05 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TII E Apr. 2028“, Call, 8,05 %, 06. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	73.126	17.150.000	20.607	(52.519)
Kauf	SWP „Erhält Festzinssatz 8,50 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TII E Aug. 2025“, Call, 8,50 %, 06. Aug. 2025	J.P. Morgan	MXN	107.321	210.972.000	108.793	1.472
Verkauf	CDX "iTraxx Europe Crossover Series 41 20/06/2029", Put, Ausübungskurs 400,00, 18. Dez. 2024	Morgan Stanley	EUR	(37.861)	(7.295.000)	(18.010)	19.851

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Swaptions (Forts.)

Schutz-position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf	IRS „Erhält Festzinssatz 8,92 % Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR Mai 2025“, Call, 8,92 %, 02. Mai 2025	J.P. Morgan	ZAR	(14.672)	(49.657.000)	(117.448)	(102.776)
						USD 729.180	(1.113.626)

Total Return Swapkontrakte

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

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

Zum 30. September 2024 waren folgende Teilfonds in Total Return Swapkontrakten engagiert:

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity						
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	GBP	19.792.213	22. Sep. 2025	5.609.652
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	17.791.213	28. Feb. 2025	(613.858)
Kauf Long	Banken	Merrill Lynch	EUR	12.493.047	30. Apr. 2025	(507.308)
Kauf Long	Banken	Merrill Lynch	EUR	8.095.415	30. Mai 2025	272.377
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	GBP	8.286.124	28. Feb. 2025	139.331
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	GBP	3.769.513	30. Apr. 2025	291.416
Kauf Long	Bau- und Ingenieurswesen	Goldman Sachs	EUR	504.714	21. Jul. 2027	58.457
Kauf Long	Bau- und Ingenieurswesen	Morgan Stanley	EUR	4.820.773	28. Feb. 2025	(66.014)
Kauf Long	Lebensmittel	Goldman Sachs	GBP	3.370.917	30. Jun. 2027	702.740
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	GBP	5.806.537	09. Aug. 2027	(423.381)
Verkauf Short	Werbung	Merrill Lynch	USD	1.203.492	31. Okt. 2025	(52.051)
Verkauf Short	Werbung	Morgan Stanley	JPY	1.241.128	28. Feb. 2025	(47.551)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	GBP	1.226.437	02. Sep. 2027	80.141
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	2.444.025	21. Apr. 2025	347.495
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	2.002.245	31. Jul. 2025	(564.634)
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	USD	2.243.559	18. Okt. 2024	123.278
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	USD	1.017.516	03. Nov. 2025	4.011
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	USD	2.922.280	03. Jul. 2025	(136.708)
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	USD	1.255.553	20. Okt. 2025	50.856
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	443.951	28. Apr. 2026	(187.539)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1.464.386	23. Okt. 2025	(23.916)
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	CHF	1.740.959	20. Jan. 2027	(165.815)
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	SEK	1.753.134	12. Aug. 2026	366.081
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	JPY	1.446.497	28. Feb. 2025	(16.397)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	CHF	1.509.584	27. Sep. 2027	13.685
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	2.469.094	28. Feb. 2025	(340.749)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Merrill Lynch	USD	1.496.344	31. Okt. 2025	118.959
Verkauf Short	Elektrische Komponenten und Geräte	Morgan Stanley	USD	818.008	10. Okt. 2024	(205.779)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	USD	706.242	19. Aug. 2025	90.777
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	960.860	31. Jul. 2025	(89.123)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	743.975	28. Feb. 2025	(33.571)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)						
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Merrill Lynch	USD	1.916.214	31. Jul. 2025	(159.343)
Verkauf Short	Unterhaltung	Goldman Sachs	SEK	974.273	07. Sep. 2027	42.112
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	1.303.485	13. Jan. 2027	181.808
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	1.731.603	28. Feb. 2025	56.140
Verkauf Short	Gastronomie	Morgan Stanley	EUR	960.767	28. Feb. 2025	151.722
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	771.204	28. Apr. 2026	93.402
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	1.422.993	28. Feb. 2025	(42.500)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Merrill Lynch	USD	2.386.219	31. Jul. 2025	(438.855)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	2.105.204	08. Sep. 2025	(236.429)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	1.232.070	31. Okt. 2025	3.849
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	1.987.134	28. Feb. 2025	(69.729)
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	Goldman Sachs	EUR	133.827	14. Jul. 2027	2.941
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	12.284	28. Sep. 2027	181
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	EUR	1.026.470	15. Sep. 2027	(130.596)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	1.272.391	31. Okt. 2025	15.855
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1.955.298	10. Okt. 2024	(55.370)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	DKK	1.188.793	28. Jul. 2027	(53.334)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1.368.445	10. Dez. 2026	(271.401)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1.889.440	28. Jun. 2027	(186.849)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	CAD	1.159.478	23. Dez. 2024	(124.294)
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	GBP	964.508	29. Aug. 2025	47.650
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	8.618.489	31. Jul. 2025	1.379.352
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	2.163.341	02. Sep. 2025	(156.564)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	1.602.129	21. Okt. 2024	(308.828)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	2.089.545	08. Sep. 2025	(169.056)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	1.180.378	10. Aug. 2027	(18.007)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	1.706.532	21. Jul. 2025	184.028
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	950.158	20. Okt. 2025	4.130
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	1.260.618	31. Okt. 2025	(2.747)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	1.443.647	28. Feb. 2025	(122.734)
Verkauf Short	Transport	Merrill Lynch	USD	1.146.305	02. Sep. 2025	(78.873)
Verkauf Short	Diverse *	Morgan Stanley	EUR	3.726.996	28. Feb. 2025	(151.665)
Verkauf Short	Diverse *	Morgan Stanley	USD	31.724.778	28. Feb. 2025	(1.816.435)
			EUR			2.364.423
Schroder GAIA Helix						
Kauf Long	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	327.028	13. Dez. 2024	(33)
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	USD	8.990.589	18. Sep. 2025	(1.325.068)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	JPY	14.490.945	18. Sep. 2025	(1.915.144)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	12.122.568	18. Sep. 2025	(4.688.734)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	299.688	13. Dez. 2024	(30)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	10.069.507	18. Sep. 2025	(15.209.959)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	JPY	1.771.088	18. Sep. 2025	(51.903)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	9.198.067	18. Sep. 2025	0
			USD			(23.190.871)
Schroder GAIA Sirius US Equity						
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	2.981.598	12. Jun. 2025	(13.396)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	5.011.181	24. Jun. 2025	(358.671)
Kauf Long	Getränke	Merrill Lynch	USD	2.651.350	24. Dez. 2024	175.614
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	12.408.238	24. Jun. 2025	461.797

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)						
Kauf Long	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	192.940	24. Jul. 2025	16.471
Kauf Long	Private Equity	Merrill Lynch	USD	3.158.022	24. Apr. 2025	132.943
Kauf Long	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	8.557.097	24. Okt. 2025	(368.969)
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	USD	3.148.587	28. Okt. 2025	12.549
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Barclays Bank	USD	4.143.439	12. Nov. 2024	108.378
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	798.471	09. Apr. 2025	(7.298)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	1.256.841	07. Okt. 2024	(59.588)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	751.308	10. Feb. 2025	61.503
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	548.549	16. Okt. 2025	4.164
Verkauf Short	Fluggesellschaften	Merrill Lynch	USD	306.940	28. Jul. 2025	(64.047)
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	USD	294.753	30. Apr. 2025	(54.338)
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	882.124	03. Feb. 2025	16.300
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	1.048.055	24. Jun. 2025	(20.794)
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	822.059	22. Sep. 2025	16.010
Verkauf Short	Getränke	Merrill Lynch	USD	174.442	24. Feb. 2025	(7.816)
Verkauf Short	Getränke	Merrill Lynch	USD	80.076	02. Jun. 2025	8.938
Verkauf Short	Getränke	Merrill Lynch	USD	115.836	14. Jul. 2025	(11.981)
Verkauf Short	Getränke	Merrill Lynch	USD	203.160	01. Aug. 2025	6.412
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	508.443	17. Okt. 2025	39.626
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1.706.905	28. Okt. 2024	4.337
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	805.743	30. Sep. 2025	16.500
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	577.993	09. Okt. 2025	(31.024)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	947.772	11. Okt. 2024	(25.706)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	409.557	18. Nov. 2024	(9.549)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	208.526	11. Feb. 2025	7.800
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	718.238	24. Jun. 2025	(4.395)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	439.082	14. Jul. 2025	(21.236)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	284.721	02. Sep. 2025	10.960
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	559.135	08. Sep. 2025	145.233
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	169.384	12. Aug. 2025	(1.429)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	USD	118.685	12. Sep. 2025	(11.440)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Merrill Lynch	USD	204.467	10. Okt. 2025	(636)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.057.584	12. Mrz. 2025	(94.990)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	680.265	11. Dez. 2025	(27.889)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	143.728	28. Apr. 2025	4.089
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1.138.592	26. Sep. 2025	(57.601)
Verkauf Short	Elektrische Komponenten und Geräte	Goldman Sachs	USD	206.473	23. Apr. 2025	(16.355)
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	817.203	03. Feb. 2025	(91.755)
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	912.617	30. Mai 2025	11.777
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	537.224	17. Jul. 2025	50.898
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	453.096	28. Jul. 2025	(34.412)
Verkauf Short	Elektronik	Merrill Lynch	USD	847.479	24. Okt. 2025	(16.497)
Verkauf Short	Unterhaltung	Merrill Lynch	USD	463.601	10. Jul. 2025	(8.294)
Verkauf Short	Umweltschutz	Goldman Sachs	USD	573.076	12. Jun. 2025	(407.865)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	1.533.620	12. Dez. 2024	(171.430)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	3.440.631	12. Jun. 2025	(305.135)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	10.234.539	20. Okt. 2025	(387.744)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	5.024.380	11. Dez. 2025	(164.318)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	12.113.692	25. Jun. 2025	(619.168)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	3.809.882	26. Jun. 2025	4.767

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)						
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	936.394	21. Jan. 2025	(29.013)
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	126.276	24. Okt. 2025	(3.460)
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	738.424	24. Dez. 2024	(67.948)
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	1.121.772	24. Jun. 2025	(26.638)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	513.838	12. Sep. 2025	(93.227)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	112.881	15. Jan. 2025	716
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	116.999	26. Mrz. 2025	4.493
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	531.998	24. Jun. 2025	31.002
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	906.121	24. Okt. 2025	23.873
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.183.199	12. Dez. 2024	(61.241)
Verkauf Short	Internet	Barclays Bank	USD	2.004.276	12. Nov. 2024	7.795
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	1.478.209	16. Jan. 2025	(84.604)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	497.392	28. Apr. 2025	(24.546)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	368.803	22. Sep. 2025	6.675
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	USD	766.047	09. Apr. 2025	(169.350)
Verkauf Short	Medien	Merrill Lynch	USD	1.178.420	05. Mai 2025	97.613
Verkauf Short	Medien	Merrill Lynch	USD	533.232	24. Jun. 2025	(20.137)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	659.537	25. Nov. 2024	(47.852)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	313.982	28. Jan. 2025	28.257
Verkauf Short	Immobilien	Merrill Lynch	USD	632.105	29. Sep. 2025	40.377
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	845.755	24. Dez. 2024	(22.592)
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	1.004.220	24. Apr. 2025	(51.345)
Verkauf Short	Einzelhandel	Barclays Bank	USD	2.062.830	12. Nov. 2024	5.489
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	60.605	25. Nov. 2024	54.208
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	159.720	12. Aug. 2025	12.982
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	126.066	24. Okt. 2025	(1.035)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	79.002	14. Nov. 2024	(3.473)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	143.529	25. Nov. 2024	17.668
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	466.249	09. Jun. 2025	9.759
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	1.142.010	29. Sep. 2025	(123.446)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	367.347	15. Sep. 2025	(28.838)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	373.883	14. Okt. 2025	(36.737)
Verkauf Short	Telekommunikation	Merrill Lynch	USD	283.287	30. Sep. 2025	(114.874)
Verkauf Short	Transport	Merrill Lynch	USD	240.325	05. Nov. 2024	(16.956)
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	USD	263.911	26. Jun. 2025	1.905
			USD	(2.843.200)		
Schroder GAIA Two Sigma Diversified						
Kauf Long	Diverse *	Morgan Stanley	USD	316.176.916	18. Okt. 2024	(5.568.297)
			USD	(5.568.297)		
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
Kauf Long	Werbung	J.P. Morgan	EUR	432.652	05. Mai 2028	9.740
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	403.373	24. Mai 2033	(10.375)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	EUR	1.453.440	05. Mai 2028	(61.886)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	GBP	427.388	05. Mai 2028	(21.635)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	43.566	18. Mai 2033	(1.719)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	GBP	41.059	24. Mai 2033	3.542
Kauf Long	Agrarwirtschaft	J.P. Morgan	DKK	343.287	05. Mai 2028	(9.121)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	J.P. Morgan	GBP	1.332.398	05. Mai 2028	(58.600)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	GBP	14.334	18. Mai 2033	(1.204)
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	USD	236.962	05. Mai 2028	61.176
Kauf Long	Fluggesellschaften	Morgan Stanley	USD	177.462	17. Mai 2033	(808)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	979.926	24. Mai 2033	(9.110)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	HUF	245.853	24. Mai 2033	920
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	JPY	107.870	24. Mai 2033	(2.558)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	2.862.625	23. Mai 2033	(1.390)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	AUD	248.677	05. Mai 2028	14.448
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	3.760.040	05. Mai 2028	13.078
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	510.919	08. Mai 2028	(13.323)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	USD	2.195.849	05. Mai 2028	92.164
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	2.726.139	18. Mai 2033	70.552
Kauf Long	Getränke	J.P. Morgan	DKK	284.878	05. Mai 2028	(5.232)
Kauf Long	Getränke	J.P. Morgan	EUR	271.585	05. Mai 2028	(8.914)
Kauf Long	Getränke	Morgan Stanley	USD	220.037	18. Mai 2033	(18.549)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	13.312	24. Mai 2033	(738)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	567.209	23. Mai 2033	(17.233)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	755.354	24. Mai 2033	6.976
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	90.627	05. Mai 2028	(9.254)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	121.831	18. Mai 2033	(10.750)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	2.496.148	18. Mai 2033	(119.345)
Kauf Long	Baustoffe	Goldman Sachs	EUR	127.556	24. Mai 2033	(1.524)
Kauf Long	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	49.022	23. Mai 2033	306
Kauf Long	Baustoffe	J.P. Morgan	CHF	617.073	05. Mai 2028	23.150
Kauf Long	Baustoffe	J.P. Morgan	EUR	492.125	05. Mai 2028	26.762
Kauf Long	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	75.249	18. Mai 2033	4.499
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	EUR	41.064	24. Mai 2033	3.673
Kauf Long	Chemie	J.P. Morgan	EUR	496.340	05. Mai 2028	33.151
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	155.538	24. Mai 2033	(5.523)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	643.562	23. Mai 2033	(2.693)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	128.299	24. Mai 2033	(1.727)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	578.622	05. Mai 2028	(91.775)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	25.333	05. Mai 2028	(19)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.114.491	18. Mai 2033	(22.595)
Kauf Long	Computer	Goldman Sachs	USD	574.608	24. Mai 2033	12.086
Kauf Long	Computer	J.P. Morgan	GBP	350.412	05. Mai 2028	10.696
Kauf Long	Computer	Morgan Stanley	USD	382.021	18. Mai 2033	29.457
Kauf Long	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	GBP	32.251	24. Mai 2033	55
Kauf Long	Kosmetik und Körperpflege	J.P. Morgan	GBP	983.911	05. Mai 2028	(12.738)
Kauf Long	Vertrieb/Großhandel	Goldman Sachs	EUR	21.211	24. Mai 2033	1.475
Kauf Long	Vertrieb/Großhandel	J.P. Morgan	GBP	969.282	05. Mai 2028	18.173
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	4.586.895	23. Mai 2033	11.189
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	660.526	05. Mai 2028	(4.497)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	96.926	05. Mai 2028	1.829
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.260.796	18. Mai 2033	40.421
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	USD	177.428	05. Mai 2028	(7.149)
Kauf Long	Elektrik	Morgan Stanley	CAD	81.180	17. Mai 2033	517
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	322.747	24. Mai 2033	4.901
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	CHF	270.972	05. Mai 2028	15.540

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	GBP	439.229	05. Mai 2028	(14.445)
Kauf Long	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	335.157	05. Mai 2028	(27.545)
Kauf Long	Energie – Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	USD	36.680	18. Mai 2033	503
Kauf Long	Bau- und Ingenieurswesen	J.P. Morgan	EUR	1.277.409	05. Mai 2028	6.783
Kauf Long	Unterhaltung	Goldman Sachs	EUR	19.541	24. Mai 2033	630
Kauf Long	Unterhaltung	Goldman Sachs	USD	337.165	23. Mai 2033	3.914
Kauf Long	Unterhaltung	J.P. Morgan	EUR	67.264	05. Mai 2028	(2.623)
Kauf Long	Unterhaltung	J.P. Morgan	GBP	197.735	05. Mai 2028	16.276
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	EUR	200.327	18. Mai 2033	(6.409)
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	GBP	68.313	18. Mai 2033	(1.847)
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	2.905.896	18. Mai 2033	118.761
Kauf Long	Umweltschutz	J.P. Morgan	EUR	329.673	05. Mai 2028	33.402
Kauf Long	Aktienindex	Goldman Sachs	JPY	501.145	24. Mai 2033	6.134
Kauf Long	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	125.473	05. Mai 2028	607
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	460.126	18. Mai 2033	35.321
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	502.769	18. Mai 2033	(957)
Kauf Long	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	328.155	05. Mai 2028	28.757
Kauf Long	Gastronomie	J.P. Morgan	GBP	213.599	05. Mai 2028	(3.122)
Kauf Long	Gas	J.P. Morgan	USD	229.119	05. Mai 2028	12.123
Kauf Long	Gas	Morgan Stanley	HKD	33.660	18. Mai 2033	6.458
Kauf Long	Gas	Morgan Stanley	USD	41.112	18. Mai 2033	340
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	623.609	23. Mai 2033	1.391
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	724.041	24. Mai 2033	(737)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	EUR	544.371	05. Mai 2028	2.978
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	1.176.312	05. Mai 2028	29.072
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	1.998.784	18. Mai 2033	(10.733)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	178.270	23. Mai 2033	(6.929)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	175.975	24. Mai 2033	370
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	571.492	05. Mai 2028	(5.254)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	629.995	18. Mai 2033	(1.684)
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	279.544	24. Mai 2033	6.144
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	J.P. Morgan	GBP	535.901	05. Mai 2028	(46.316)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	J.P. Morgan	JPY	507.120	08. Mai 2028	12.887
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	317.375	18. Mai 2033	26.512
Kauf Long	Versicherung	Goldman Sachs	CHF	276.624	24. Mai 2033	1.498
Kauf Long	Versicherung	Goldman Sachs	EUR	264.521	24. Mai 2033	3.305
Kauf Long	Versicherung	Goldman Sachs	GBP	239.529	24. Mai 2033	25.862
Kauf Long	Versicherung	Goldman Sachs	HKD	246.903	24. Mai 2033	48.393
Kauf Long	Versicherung	Goldman Sachs	NOK	21.334	24. Mai 2033	(127)
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	CHF	69.162	05. Mai 2028	4.202
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	EUR	897.467	05. Mai 2028	(13.048)
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	GBP	783.188	05. Mai 2028	(15.310)
Kauf Long	Versicherung	Morgan Stanley	EUR	122.543	18. Mai 2033	(234)
Kauf Long	Versicherung	Morgan Stanley	USD	84.693	18. Mai 2033	(10.507)
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	EUR	41.561	24. Mai 2033	(1.159)
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	USD	733.543	23. Mai 2033	2.275
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	USD	278.257	24. Mai 2033	3.691
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	EUR	815.864	05. Mai 2028	79.386
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	GBP	39.521	05. Mai 2028	2.160

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	HKD	135.832	05. Mai 2028	51.536
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	USD	1.451.049	05. Mai 2028	65.082
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	EUR	10.208	18. Mai 2033	(243)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	HKD	264.102	18. Mai 2033	90.406
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	5.572.191	18. Mai 2033	244.486
Kauf Long	Investmentgesellschaften	Morgan Stanley	USD	147.703	18. Mai 2033	(1.274)
Kauf Long	Freizeit	Goldman Sachs	USD	240.015	23. Mai 2033	4.565
Kauf Long	Freizeit	Morgan Stanley	USD	472.217	18. Mai 2033	21.199
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	EUR	159.829	24. Mai 2033	(1.582)
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	USD	406.945	23. Mai 2033	(5.441)
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	HKD	134.944	18. Mai 2033	6.201
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	1.087.001	18. Mai 2033	142.694
Kauf Long	Maschinen – Bau und Bergbau	Goldman Sachs	USD	3.876	23. Mai 2033	203
Kauf Long	Maschinen – Bau und Bergbau	J.P. Morgan	USD	215.380	05. Mai 2028	69.758
Kauf Long	Maschinen – Bau und Bergbau	Morgan Stanley	USD	53.803	18. Mai 2033	4.217
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	GBP	579.533	05. Mai 2028	18.499
Kauf Long	Medien	Goldman Sachs	USD	469	23. Mai 2033	12
Kauf Long	Medien	Goldman Sachs	USD	561.832	24. Mai 2033	(2.168)
Kauf Long	Medien	Morgan Stanley	USD	256.911	18. Mai 2033	829
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	GBP	133.026	24. Mai 2033	12.514
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	GBP	342.749	05. Mai 2028	44.313
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	CHF	7.643	05. Mai 2028	735
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	GBP	614.713	05. Mai 2028	(24.456)
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	SEK	332.596	05. Mai 2028	7.920
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	257.628	05. Mai 2028	32.481
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	CHF	45.520	18. Mai 2033	3.854
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	GBP	61.206	18. Mai 2033	(1.207)
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	419.004	05. Mai 2028	19.053
Kauf Long	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	534.915	18. Mai 2033	17.841
Kauf Long	Öl- und Erdgasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	19.682	18. Mai 2033	(259)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	DKK	46.818	24. Mai 2033	(3.483)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	232.012	24. Mai 2033	(998)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	439.483	24. Mai 2033	(6.002)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	665.838	24. Mai 2033	(36.028)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	406.419	23. Mai 2033	1.680
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	321.854	24. Mai 2033	(6.075)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	28.544	05. Mai 2028	(505)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	DKK	56.802	05. Mai 2028	(1.357)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	470.508	05. Mai 2028	7.082
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	6.692	08. Mai 2028	(1.155)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	504.050	05. Mai 2028	8.872
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	DKK	850.958	18. Mai 2033	(121.780)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	71.681	18. Mai 2033	(3.693)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2.081.210	18. Mai 2033	(76.306)
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	601.317	05. Mai 2028	13.426
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	469.844	18. Mai 2033	(8.591)
Kauf Long	Private Equity	Goldman Sachs	USD	289.642	24. Mai 2033	(5.761)
Kauf Long	Private Equity	Morgan Stanley	USD	667.703	18. Mai 2033	17.711
Kauf Long	Immobilien	Morgan Stanley	USD	200.530	18. Mai 2033	(1.112)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	USD	438.152	23. Mai 2033	(4.660)
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	USD	33.250	05. Mai 2028	1.390
Kauf Long	REITS	Morgan Stanley	USD	646.712	18. Mai 2033	(9.912)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	CHF	200.244	24. Mai 2033	5.622
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	EUR	34.766	24. Mai 2033	3.016
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	GBP	15.476	24. Mai 2033	642
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1.962.026	23. Mai 2033	(10.493)
Kauf Long	Einzelhandel	J.P. Morgan	DKK	424.187	05. Mai 2028	(20.196)
Kauf Long	Einzelhandel	J.P. Morgan	EUR	497.196	05. Mai 2028	60.386
Kauf Long	Einzelhandel	J.P. Morgan	GBP	306.878	05. Mai 2028	15.615
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	17.721	18. Mai 2033	(128)
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	3.211.959	18. Mai 2033	(2.867)
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	EUR	262.975	24. Mai 2033	6.075
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	JPY	147.379	24. Mai 2033	(2.748)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	EUR	579.658	05. Mai 2028	(7.322)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	JPY	512.180	08. Mai 2028	(26.144)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	216.955	05. Mai 2028	16.560
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	2.617.192	18. Mai 2033	83.412
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	EUR	43.440	24. Mai 2033	(7.551)
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	285.251	23. Mai 2033	(7.348)
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	313.057	05. Mai 2028	(9.401)
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	1.843.246	18. Mai 2033	12.037
Kauf Long	Telekommunikation	J.P. Morgan	JPY	281.179	08. Mai 2028	20.616
Kauf Long	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	193.736	05. Mai 2028	12.752
Kauf Long	Telekommunikation	Morgan Stanley	SGD	355.119	18. Mai 2033	(5.441)
Kauf Long	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	876.064	18. Mai 2033	19.085
Kauf Long	Spielwaren/Spiele/Hobbys	Morgan Stanley	USD	326.827	18. Mai 2033	11.848
Kauf Long	Diverse *	Morgan Stanley	USD	10.787.183	25. Mai 2033	(51.961)
Verkauf Short	Werbung	Goldman Sachs	USD	132.785	23. Mai 2033	(1.415)
Verkauf Short	Werbung	J.P. Morgan	EUR	347.318	05. Mai 2028	(7.819)
Verkauf Short	Werbung	J.P. Morgan	USD	198.985	05. Mai 2028	(1.075)
Verkauf Short	Werbung	Morgan Stanley	USD	403.948	18. Mai 2033	(7.550)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	267.947	24. Mai 2033	(438)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	EUR	20.950	05. Mai 2028	83
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	EUR	182.505	24. Mai 2033	(9.046)
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	USD	46.123	24. Mai 2033	(2.668)
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	EUR	13.903	05. Mai 2028	(64)
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	PLN	145.894	05. Mai 2028	(10.046)
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	EUR	83.571	18. Mai 2033	776
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	USD	157.607	17. Mai 2033	(2.290)
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	USD	402.421	18. Mai 2033	(8.163)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	EUR	137.536	24. Mai 2033	470
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	SEK	41.307	24. Mai 2033	(1.061)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	14.533	23. Mai 2033	(1.426)
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	EUR	256.211	05. Mai 2028	(6.664)
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	SEK	233.586	05. Mai 2028	(10.623)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	SEK	14.882	18. Mai 2033	3
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	199.113	18. Mai 2033	(30.598)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	EUR	52.717	24. Mai 2033	(7.350)
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	EUR	56.571	18. Mai 2033	(2.058)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CHF	393.505	24. Mai 2033	(8.247)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CZK	220.042	24. Mai 2033	(6.793)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	1.228.039	24. Mai 2033	13.678
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	GBP	831.626	24. Mai 2033	(10.970)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SEK	575.426	24. Mai 2033	11.129
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	4.208.238	23. Mai 2033	(27.350)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	2.649.666	24. Mai 2033	21.469
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	AUD	288.464	05. Mai 2028	15.523
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	CHF	117.273	05. Mai 2028	(367)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	2.339.179	05. Mai 2028	(35.729)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	GBP	1.208.245	05. Mai 2028	(16.922)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	PLN	375.980	05. Mai 2028	21.256
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	651.385	05. Mai 2028	2.545
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	1.494.937	05. Mai 2028	(42.636)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	AUD	504.093	18. Mai 2033	7.740
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CAD	289.882	18. Mai 2033	(10.024)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CHF	339.203	18. Mai 2033	6.850
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CZK	109.748	18. Mai 2033	(4.123)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	DKK	385.928	18. Mai 2033	(3.098)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	EUR	586.730	18. Mai 2033	7.136
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	1.225.829	18. Mai 2033	(30.671)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	SEK	811.356	18. Mai 2033	8.043
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	4.749.848	18. Mai 2033	(66.325)
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	USD	13.181	24. Mai 2033	87
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	USD	1.078.229	18. Mai 2033	13.546
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	262.397	24. Mai 2033	2.026
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	118.805	05. Mai 2028	(1.849)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	1.288.778	18. Mai 2033	7.070
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	CHF	123.558	24. Mai 2033	(1.863)
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	SEK	15.736	24. Mai 2033	(2.270)
Verkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	CHF	48.275	05. Mai 2028	(445)
Verkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	SEK	124.086	05. Mai 2028	(21.345)
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	SEK	182.928	18. Mai 2033	(31.066)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	3.081	24. Mai 2033	(42)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	948.278	23. Mai 2033	7.808
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	548.578	24. Mai 2033	22.258
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	60.635	05. Mai 2028	(6.426)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	289.841	05. Mai 2028	4.360
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.764.164	18. Mai 2033	31.004
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	CHF	36.706	24. Mai 2033	(1.082)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	EUR	59.245	24. Mai 2033	(712)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	41.431	23. Mai 2033	(570)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	262.917	24. Mai 2033	(4.567)
Verkauf Short	Computer	J.P. Morgan	CHF	284.357	05. Mai 2028	(11.899)
Verkauf Short	Computer	J.P. Morgan	EUR	368.812	05. Mai 2028	(40.810)
Verkauf Short	Computer	J.P. Morgan	USD	67.797	05. Mai 2028	(2.266)
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	EUR	185.514	18. Mai 2033	(3.710)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	1.890.045	18. Mai 2033	(32.690)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	EUR	43.306	24. Mai 2033	(3.688)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	J.P. Morgan	EUR	238.899	05. Mai 2028	(6.155)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	56.579	18. Mai 2033	(5.593)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	USD	199.540	18. Mai 2033	1.057
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Goldman Sachs	EUR	61.474	24. Mai 2033	(7.472)
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Goldman Sachs	SEK	193.610	24. Mai 2033	1.016
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	J.P. Morgan	EUR	41.729	05. Mai 2028	(6.685)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.772.824	23. Mai 2033	(556)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	2.066.742	24. Mai 2033	(46.361)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	AUD	225.527	05. Mai 2028	(3.728)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	191.227	05. Mai 2028	7.303
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	112.033	05. Mai 2028	(3.929)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	262.814	08. Mai 2028	19.279
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	448.324	05. Mai 2028	(31.851)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	AUD	422.801	18. Mai 2033	540
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	162.373	18. Mai 2033	(12.414)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	232.565	18. Mai 2033	1.917
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	4.718.954	18. Mai 2033	(147.789)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	GBP	70.522	24. Mai 2033	(3.062)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	241.868	24. Mai 2033	(1.924)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	1.267.720	05. Mai 2028	(15.008)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	1.062.985	18. Mai 2033	11.920
Verkauf Short	Elektrische Komponenten und Geräte	Goldman Sachs	EUR	90.089	24. Mai 2033	(2.719)
Verkauf Short	Elektrische Komponenten und Geräte	J.P. Morgan	EUR	39.250	05. Mai 2028	0
Verkauf Short	Elektrische Komponenten und Geräte	J.P. Morgan	USD	119.056	05. Mai 2028	(12.020)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	EUR	390.465	24. Mai 2033	(35.991)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	JPY	337.146	24. Mai 2033	(12.375)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	SEK	82.349	24. Mai 2033	(9.177)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	174.456	23. Mai 2033	8.132
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	115.301	24. Mai 2033	(7.674)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	DKK	139.996	05. Mai 2028	(12.026)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	JPY	8.804	08. Mai 2028	(285)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	SEK	7.671	05. Mai 2028	(649)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	EUR	111.737	18. Mai 2033	(8.875)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	96.611	18. Mai 2033	(6.182)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	102.536	18. Mai 2033	(4.102)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	DKK	502.967	24. Mai 2033	32.871
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	NOK	41.136	24. Mai 2033	(539)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	NOK	123.079	05. Mai 2028	7.542
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	83.936	05. Mai 2028	5.752
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	NOK	11.573	19. Mai 2033	937
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurswesen	Goldman Sachs	EUR	200.115	24. Mai 2033	669
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurswesen	Goldman Sachs	SEK	28.425	24. Mai 2033	(870)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurswesen	J.P. Morgan	EUR	1.278	05. Mai 2028	2
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurswesen	J.P. Morgan	SEK	206.909	05. Mai 2028	(13.508)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurswesen	Morgan Stanley	EUR	96.531	18. Mai 2033	1.785
Verkauf Short	Unterhaltung	Goldman Sachs	SEK	61.193	24. Mai 2033	153
Verkauf Short	Unterhaltung	Goldman Sachs	USD	191.523	23. Mai 2033	(1.286)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Unterhaltung	J.P. Morgan	SEK	430.408	05. Mai 2028	6.835
Verkauf Short	Unterhaltung	J.P. Morgan	USD	161.763	05. Mai 2028	4.188
Verkauf Short	Unterhaltung	Morgan Stanley	SEK	29.094	18. Mai 2033	87
Verkauf Short	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	1.320.896	18. Mai 2033	6.411
Verkauf Short	Umweltschutz	J.P. Morgan	NOK	250.377	05. Mai 2028	(7.099)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	JPY	392.295	24. Mai 2033	(533)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	574.731	23. Mai 2033	(9.099)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	2.210.876	24. Mai 2033	33.143
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	689.670	05. Mai 2028	(12.484)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	1.254.502	18. Mai 2033	(5.198)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	1.558.256	17. Mai 2033	23.740
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	10.794.170	18. Mai 2033	(235.594)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	EUR	8.004	24. Mai 2033	(401)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	SEK	137.517	24. Mai 2033	(4.529)
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	CHF	166.800	05. Mai 2028	383
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	262.723	05. Mai 2028	(9.692)
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	SEK	115.418	05. Mai 2028	(2.823)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	43.843	18. Mai 2033	(94)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	329.542	18. Mai 2033	4.809
Verkauf Short	Gas	J.P. Morgan	USD	197.094	05. Mai 2028	(4.252)
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	USD	305.136	18. Mai 2033	5.086
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	CHF	608.911	24. Mai 2033	(34.861)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	DKK	1.302.130	24. Mai 2033	22.845
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	EUR	540.650	24. Mai 2033	(55.979)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	GBP	240.005	24. Mai 2033	(7.009)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	107.181	24. Mai 2033	(10.963)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	911.633	24. Mai 2033	(4.438)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	AUD	166.242	05. Mai 2028	11.582
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	CHF	119.735	05. Mai 2028	(21.516)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	DKK	200.109	05. Mai 2028	(7.649)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	EUR	118.971	05. Mai 2028	(5.440)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	JPY	183.940	08. Mai 2028	(13.145)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	2.897	05. Mai 2028	2.883
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	EUR	6.490	18. Mai 2033	249
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	1.478.702	18. Mai 2033	(1.931)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	CHF	317.022	24. Mai 2033	(2.033)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	502.815	24. Mai 2033	(34.149)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	37.846	05. Mai 2028	(3.097)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	310.443	18. Mai 2033	2.577
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.029.379	18. Mai 2033	41.199
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	453.445	18. Mai 2033	(21.300)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	J.P. Morgan	EUR	155.321	05. Mai 2028	(12.720)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	USD	262.382	18. Mai 2033	1.889
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	CHF	1.038.826	24. Mai 2033	(2.468)
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	EUR	117.587	24. Mai 2033	(493)
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	GBP	596.086	24. Mai 2033	(6.938)
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	JPY	115.659	24. Mai 2033	(158)
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	USD	218.882	23. Mai 2033	(1.989)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	CHF	1.328.992	05. Mai 2028	(8.670)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	EUR	1.918.934	05. Mai 2028	1.679
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	GBP	617.329	05. Mai 2028	(1.694)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	JPY	298.157	08. Mai 2028	(18.951)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	USD	30.771	05. Mai 2028	(184)
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	EUR	1.144.563	18. Mai 2033	(27.613)
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	USD	256.663	17. Mai 2033	(754)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	EUR	16.949	24. Mai 2033	(3.493)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	GBP	61.517	24. Mai 2033	(6.312)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	HKD	121.633	24. Mai 2033	(58.960)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	432.087	23. Mai 2033	3.821
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	255.832	24. Mai 2033	(4.221)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	EUR	27.944	05. Mai 2028	(7.428)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	GBP	638.997	05. Mai 2028	(32.558)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	HKD	11.108	05. Mai 2028	(6.705)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	277.600	05. Mai 2028	(25.137)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	EUR	9.412	18. Mai 2033	(2.839)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	3.497.864	18. Mai 2033	(211.716)
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Goldman Sachs	EUR	49.583	24. Mai 2033	(789)
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	J.P. Morgan	EUR	7.120	05. Mai 2028	358
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Morgan Stanley	EUR	93.857	18. Mai 2033	4.213
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	EUR	21.945	24. Mai 2033	(1.122)
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	USD	39.650	23. Mai 2033	(222)
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	EUR	268.017	05. Mai 2028	(9.235)
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	USD	134.711	05. Mai 2028	(3.959)
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	1.168.642	18. Mai 2033	(22.639)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	GBP	251.092	24. Mai 2033	1.818
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	USD	337.456	23. Mai 2033	(9.849)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	GBP	289.565	05. Mai 2028	(24.653)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	HKD	6.268	05. Mai 2028	(2.800)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	J.P. Morgan	SEK	40.633	05. Mai 2028	(2.761)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	HKD	131.201	18. Mai 2033	(55.617)
Verkauf Short	Beherbergungsunternehmen	Morgan Stanley	USD	945.643	18. Mai 2033	(107.938)
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	J.P. Morgan	SEK	85.190	05. Mai 2028	(4.311)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	EUR	6.922	24. Mai 2033	(922)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	GBP	13.956	24. Mai 2033	(693)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	SEK	173.249	24. Mai 2033	100
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	EUR	54.298	05. Mai 2028	(10.861)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	GBP	44.036	05. Mai 2028	(1.347)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	SEK	166.499	05. Mai 2028	(15.358)
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	USD	344.387	23. Mai 2033	(3.955)
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	USD	1.074.388	24. Mai 2033	13.974
Verkauf Short	Medien	J.P. Morgan	USD	163.584	05. Mai 2028	1.016
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	1.408.749	18. Mai 2033	(11.295)
Verkauf Short	Metallprodukte/Eisenwaren	Goldman Sachs	CHF	85.732	24. Mai 2033	(7.265)
Verkauf Short	Metallprodukte/Eisenwaren	J.P. Morgan	CHF	18.355	05. Mai 2028	(1.590)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	EUR	434.118	24. Mai 2033	(27.583)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	EUR	147.374	05. Mai 2028	(13.646)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	EUR	36.027	18. Mai 2033	(824)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	AUD	290.966	24. Mai 2033	3.309

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	CAD	38.073	24. Mai 2033	(841)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	CAD	3.620	25. Mai 2033	11
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	EUR	54.989	24. Mai 2033	(801)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	GBP	89.222	24. Mai 2033	1.098
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	NOK	120.597	24. Mai 2033	800
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	AUD	245	05. Mai 2028	0
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	CAD	476.015	05. Mai 2028	30.509
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	EUR	43.229	05. Mai 2028	380
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	GBP	8.859	05. Mai 2028	27
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	2.515.949	05. Mai 2028	(62.975)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	AUD	320.304	18. Mai 2033	(14.512)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	1.479.617	18. Mai 2033	(7.982)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	GBP	10.174	18. Mai 2033	115
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	JPY	61.318	18. Mai 2033	(3.342)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	NOK	189.663	19. Mai 2033	2.981
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	1.967.604	18. Mai 2033	(1.777)
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	40.168	24. Mai 2033	572
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	464.374	05. Mai 2028	(2.629)
Verkauf Short	Öl- und Erdgasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	317.975	18. Mai 2033	3.616
Verkauf Short	Verpackung und Container	Goldman Sachs	EUR	60.785	24. Mai 2033	11.715
Verkauf Short	Verpackung und Container	J.P. Morgan	EUR	26.242	05. Mai 2028	5.786
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	51.097	24. Mai 2033	1.585
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	DKK	135.867	24. Mai 2033	7.547
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	755.291	24. Mai 2033	(9.205)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	47.462	24. Mai 2033	(858)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	464.732	05. Mai 2028	11.604
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	140.865	08. Mai 2028	9.740
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	645.126	18. Mai 2033	(8.860)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	124.129	18. Mai 2033	3.754
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2.090.574	18. Mai 2033	27.838
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	118.063	24. Mai 2033	(1.183)
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	906.111	05. Mai 2028	(11.599)
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	USD	382.961	18. Mai 2033	(8.209)
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	CHF	7.212	24. Mai 2033	(278)
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	SEK	109.974	24. Mai 2033	5.288
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	USD	220.671	23. Mai 2033	3.132
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	CHF	241.777	05. Mai 2028	(36.953)
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	SEK	529.904	05. Mai 2028	(42.691)
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	USD	212.012	05. Mai 2028	(27.789)
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	SEK	691.464	18. Mai 2033	12.539
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	USD	1.529.901	18. Mai 2033	(73.739)
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	NOK	21.947	24. Mai 2033	158
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	SEK	71.799	24. Mai 2033	(2.379)
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	USD	74.540	23. Mai 2033	4.735
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	EUR	453.353	05. Mai 2028	(8.263)
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	NOK	48.568	05. Mai 2028	(3.035)
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	SEK	488.910	05. Mai 2028	(28.031)
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	USD	25.542	05. Mai 2028	(6.598)
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	EUR	104.905	18. Mai 2033	(874)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	SEK	42.745	18. Mai 2033	(1.571)
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	USD	116.238	18. Mai 2033	6.550
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	138.704	23. Mai 2033	(2.736)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	EUR	218.684	05. Mai 2028	(3.022)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	GBP	434.891	05. Mai 2028	(4.703)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	USD	220.558	05. Mai 2028	(3.806)
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	1.102.748	18. Mai 2033	(16.831)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	EUR	321.529	24. Mai 2033	(29.721)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	SEK	267.942	24. Mai 2033	11.641
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	807.605	23. Mai 2033	(5.093)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	EUR	505.738	05. Mai 2028	(44.209)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	GBP	25.226	05. Mai 2028	(6.515)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	SEK	34.116	05. Mai 2028	(2.718)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	37.023	18. Mai 2033	(3.780)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	GBP	77.481	18. Mai 2033	(17.377)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	2.810.639	18. Mai 2033	(34.993)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	EUR	99.677	24. Mai 2033	(5.523)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	337.616	23. Mai 2033	(10.500)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	103.524	24. Mai 2033	(3.452)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	EUR	165.909	05. Mai 2028	(7.615)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	222.851	05. Mai 2028	(23.267)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	EUR	22.424	18. Mai 2033	(801)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	JPY	90.611	18. Mai 2033	(6.596)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	2.142.900	18. Mai 2033	(74.044)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	CHF	161.174	24. Mai 2033	(3.057)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	EUR	169.530	24. Mai 2033	(5.846)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	PLN	55.062	24. Mai 2033	484
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	5.286	24. Mai 2033	409
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	339.096	23. Mai 2033	(962)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	265.387	24. Mai 2033	(7.926)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	CHF	86.134	05. Mai 2028	(17)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	EUR	318.220	05. Mai 2028	(2.050)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	PLN	89.157	05. Mai 2028	(1.431)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	SEK	597.500	05. Mai 2028	(42.028)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	8.168	05. Mai 2028	(438)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	CHF	20.980	18. Mai 2033	141
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	SEK	37.826	18. Mai 2033	60
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	3.073.733	18. Mai 2033	(26.996)
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	374.706	23. Mai 2033	(8.425)
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	JPY	132.779	08. Mai 2028	516
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	36.972	05. Mai 2028	(3.222)
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	789.674	18. Mai 2033	(5.132)
Verkauf Short	Spielwaren/Spiele/Hobbys	J.P. Morgan	JPY	39.440	08. Mai 2028	480
Verkauf Short	Spielwaren/Spiele/Hobbys	Morgan Stanley	JPY	102.547	18. Mai 2033	(1.209)
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	EUR	133.726	24. Mai 2033	1.251
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	EUR	254.643	05. Mai 2028	(10.580)
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	USD	40.119	18. Mai 2033	26
Verkauf Short	Wasser	Goldman Sachs	GBP	173.492	24. Mai 2033	732
Verkauf Short	Wasser	J.P. Morgan	GBP	441.378	05. Mai 2028	9.964

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short Wasser		J.P. Morgan	USD	80.953	05. Mai 2028	228
Verkauf Short Wasser		Morgan Stanley	GBP	35.836	18. Mai 2033	(51)
					USD	(1.341.744)

Differenzkontrakte

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

Zum 30. September 2024 wiesen die folgenden Teilfonds Differenzkontrakte auf Finanzindizes und Futures-Kontrakte auf:

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short				
CFD auf australische Aktien	UBS	1.558.004	1.159.123	1.153.670
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	(416.875)	(404.565)	(519.218)
CFD auf chinesische Aktien	UBS	1.532.367	8.264.176	7.857.915
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	(222.000)	19.990	(24.702)
CFD auf Aktien aus Hongkong	UBS	1.992.800	1.696.944	1.767.250
CFD auf indonesische Aktien	UBS	(989.300)	(5.014)	(23.613)
CFD auf Aktien aus Macau	UBS	350.000	473.521	441.605
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	(30.811)	1.957	(12.435)
CFD auf neuseeländische Aktien	UBS	509.065	(134.407)	(261.041)
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P.Morgan	(7.424)	13.914	2.902
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P.Morgan	541.230	13.260	243.532
CFD auf taiwanesische Aktien	UBS	(1.764.000)	(30.663)	(30.663)
CFD auf britische Aktien	UBS	171.300	133.686	178.650
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(67.184)	(1.402)	1.683
CFD auf US-Aktien	UBS	281.057	(425.181)	(205.275)
CFD auf den MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	UBS	(84.264)	(14.365.826)	(14.216.980)
		USD	(3.590.487)	(3.646.720)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD auf den Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Bank of America	(421)	(267.633)	2.203
CFD auf Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Bank of America	4.929	1.115.065	11.531
CFD auf den Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Bank of America	(488)	(314.697)	(13.244)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Bank of America	1.478	2.204.681	92.811
CFD auf Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Bank of America	1.364	1.095.692	18.049
CFD auf den Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Bank of America	665	597.563	10.954
CFD auf Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Bank of America	(750)	(587.944)	(1.383)
CFD auf Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Bank of America	359	479.969	(25.173)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Index	Bank of America	1.397	1.375.258	37.825
CFD auf den Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Bank of America	1.968	886.809	22.240
CFD auf den Stoxx Europe 600 Media Price Index	Bank of America	2.414	1.227.917	701
CFD auf den Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Bank of America	1.334	497.322	(7.542)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Bank of America	226	268.893	(2.809)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Retail Price Index	Bank of America	1.256	668.957	34.086
CFD auf Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Bank of America	341	313.627	(2.397)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Bank of America	4.038	1.026.365	23.329
CFD auf den Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Bank of America	4.668	1.302.216	9.992
CFD auf den Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Bank of America	2.598	1.193.022	40.979

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)				
CFD auf den S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	1.926	3.092.024	173.398
CFD auf den S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	949	842.503	4.916
CFD auf den S&P 500 Energy Sector Index	Goldman Sachs	404	273.294	(9.631)
CFD auf den S&P 500 Financials Sector Index	Goldman Sachs	1.933	1.457.791	6.127
CFD auf den S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	402	722.185	(13.358)
CFD auf den S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	1.293	1.483.149	46.910
CFD auf den S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	594	2.615.810	56.828
CFD auf den S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	5.261	3.197.110	88.724
CFD auf den S&P 500 Utilities Sector Index	Goldman Sachs	1.966	806.610	48.698
		USD	27.573.558	654.764
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
CFD auf australische Aktien	Morgan Stanley	(24.739)	10.946	10.946
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	529.102	(334.189)	(334.189)
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	38.245	350.252	350.252
CFD auf kanadische Aktien	Morgan Stanley	(303.210)	(15.633)	(15.633)
CFD auf niederländische Aktien	Morgan Stanley	(191.685)	(33.575)	(33.575)
CFD auf finnische Aktien	Morgan Stanley	1.408.000	(22.951)	(22.951)
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	(41.509)	(6.849)	(6.849)
CFD auf französische Aktien	Morgan Stanley	(22.273)	(35.914)	(35.914)
CFD auf deutsche Aktien	Morgan Stanley	212.727	686.075	686.075
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	(857.027)	500.161	500.161
CFD auf indische Aktien	Morgan Stanley	(27.199)	120.492	120.492
CFD auf irische Aktien	Morgan Stanley	(23.836)	15.255	15.255
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	(22.273)	(202.623)	(202.623)
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	(561.600)	(191.235)	(191.235)
CFD auf norwegische Aktien	Morgan Stanley	365.000	(835.263)	(835.263)
CFD auf taiwanesische Aktien	Morgan Stanley	412.225	279.404	279.404
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(1.081.110)	(2.854.658)	(2.854.658)
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(1.604.230)	(2.559.159)	(2.559.159)
		USD	(5.129.464)	(5.129.464)
Schroder GAIA Helix				
CFD auf argentinische Aktien	Goldman Sachs	1.746	3.143	3.143
CFD auf argentinische Aktien	J.P. Morgan	6.730	(27.189)	(27.189)
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	914.595	334.561	334.891
CFD auf australische Aktien	J.P. Morgan	1.256.886	502.884	502.884
CFD auf österreichische Aktien	Goldman Sachs	29.242	13.106	13.106
CFD auf österreichische Aktien	J.P. Morgan	16.511	25.061	25.061
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	2.978	(37.982)	(37.982)
CFD auf brasilianische Aktien	Goldman Sachs	(17.090)	2.042	2.042
CFD auf brasilianische Aktien	J.P. Morgan	50.002	(80.933)	(80.933)
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	12.604.258	(496.983)	(496.983)
CFD auf britische Aktien	J.P. Morgan	1.251.606	(30.607)	(30.607)
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	5.735	11.419	11.419
CFD auf chilenische Aktien	Goldman Sachs	13.146	30.481	30.481
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	5.951.395	4.189.737	4.193.088
CFD auf chinesische Aktien	J.P. Morgan	1.525.494	6.483.991	6.483.991
CFD auf dänische Aktien	Goldman Sachs	20.050	(188.901)	(188.901)
CFD auf dänische Aktien	J.P. Morgan	45.506	(242.793)	(242.793)
CFD auf niederländische Aktien	Goldman Sachs	73.424	(79.714)	(79.714)
CFD auf niederländische Aktien	J.P. Morgan	1.840	62.838	62.838
CFD auf finnische Aktien	Goldman Sachs	(3.298)	(2.632)	(2.632)
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	50.348	(12.928)	(13.103)
CFD auf französische Aktien	J.P. Morgan	37.330	(24.917)	(24.917)
CFD auf georgische Aktien	Goldman Sachs	20.414	(76.670)	(76.670)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	125.385	237.175	236.975
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	39.726	188.502	188.502
CFD auf griechische Aktien	Goldman Sachs	(36.926)	865	865
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	1.882.225	675.225	675.149
CFD auf Aktien aus Hongkong	J.P. Morgan	1.003.500	938.102	938.102
CFD auf indische Aktien	J.P. Morgan	35.316	(65.704)	(65.704)
CFD auf indonesische Aktien	J.P. Morgan	(798.600)	8.611	8.611
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	7.184	35.038	35.038
CFD auf irische Aktien	J.P. Morgan	1.625	7.248	7.248
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	29.482	(18.576)	(18.576)
CFD auf italienische Aktien	J.P. Morgan	65.801	(41.712)	(41.712)
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	497.200	(224.609)	(224.609)
CFD auf japanische Aktien	J.P. Morgan	7.409.900	2.686.121	2.686.121
CFD auf kasachische Aktien	Goldman Sachs	40.138	(447.094)	(447.094)
CFD auf Aktien aus Macau	Goldman Sachs	324.000	22.220	22.220
CFD auf Aktien aus Macau	J.P. Morgan	177.000	200.528	200.528
CFD auf mexikanische Aktien	Goldman Sachs	(15.478)	(7.746)	(7.746)
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	(24.941)	34.435	34.435
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P. Morgan	338.331	(52.739)	(52.739)
CFD auf nigerianische Aktien	Goldman Sachs	171.676	(26)	(26)
CFD auf norwegische Aktien	Goldman Sachs	121.908	126.597	126.597
CFD auf norwegische Aktien	J.P. Morgan	88.258	29.982	29.982
CFD auf peruanische Aktien	Goldman Sachs	2.374	2.652	2.652
CFD auf polnische Aktien	Goldman Sachs	57.014	24.660	24.660
CFD auf portugiesische Aktien	Goldman Sachs	82.619	66.244	66.244
CFD auf portugiesische Aktien	J.P. Morgan	36.621	(8.174)	(8.174)
CFD auf saudi-arabische Aktien	J.P. Morgan	36.839	(7.977)	(7.977)
CFD auf Aktien aus Singapur	Goldman Sachs	1.149.847	127.333	127.503
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	292.380	9.811	9.811
CFD auf slowenische Aktien	Goldman Sachs	6.532	(105)	(105)
CFD auf südafrikanische Aktien	Goldman Sachs	92.087	376.801	376.801
CFD auf spanische Aktien	Goldman Sachs	143.479	132.625	132.597
CFD auf spanische Aktien	J.P. Morgan	216.275	44.475	44.475
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	(56.027)	48.609	48.609
CFD auf schwedische Aktien	J.P. Morgan	73.902	(2.574)	(2.574)
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	(561.909)	103.963	103.963
CFD auf Schweizer Aktien	J.P. Morgan	6.677	99.561	99.561
CFD auf taiwanesische Aktien	Goldman Sachs	(24.237)	(267.936)	(267.936)
CFD auf taiwanesische Aktien	J.P. Morgan	(830.000)	(14.726)	(14.726)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	636.972	2.667.591	2.377.356
CFD auf US-Aktien	J.P. Morgan	503.582	(185.867)	(185.867)
CFD auf den FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(365)	(108.371)	(108.371)
CFD auf den FTSE UK MC Tradable Plus Index	Goldman Sachs	(278)	153	153
CFD auf den GSCBTUK3 Index	Goldman Sachs	(33.319)	(21.452)	(21.452)
CFD auf den GSHEJVL2 Index	Goldman Sachs	25.696.182	298.997	(82.758)
CFD auf den GSHEJVS2 Index	Goldman Sachs	(25.625.853)	(513.235)	(135.152)
CFD auf den GSXAMFSS Clone Index	Goldman Sachs	(2.451.572)	(181.419)	(181.419)
CFD auf den HXE Chemicals Hedge Index	Goldman Sachs	(40.073)	(144.010)	(144.010)
CFD auf den HXE Chemicals Index	Goldman Sachs	42.121	390.608	332.886
CFD auf den HXE Defence Index	Goldman Sachs	51.841	(123.352)	(123.352)
CFD auf den HXE ER Index	J.P. Morgan	(2.082)	(375.975)	(375.975)
CFD auf den HXE EU Value Long Index	Goldman Sachs	52.788	207.788	185.306
CFD auf den HXE EU Value Short Index	Goldman Sachs	(50.790)	(306.833)	(256.829)
CFD auf den HXE Japan Banks Index	Goldman Sachs	4.981.652	(398.421)	(398.421)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf den HXE TSMC Hedge Index	Goldman Sachs	30.624	258.466	258.466
CFD auf den HXE US Value Long Index	Goldman Sachs	84.919	480.962	342.384
CFD auf den HXE US Value Short Index	Goldman Sachs	(84.919)	(523.956)	(527.350)
CFD auf den MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(43.067)	(7.096.580)	(7.096.580)
CFD auf den MSCI EM Latin America 10/40 Gross Total Return Index	Goldman Sachs	(1.923)	(5.315)	(5.315)
CFD auf den MSCI USA Equal Weighted Gross Total Return USD Index	Goldman Sachs	681	47.184	47.184
CFD auf den MSCI World Equal Weighted Index	Goldman Sachs	(750)	(188.823)	(188.823)
		USD	9.602.839	9.140.132
Schroder GAIA SEG US Equity				
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	(51.999)	(403.385)	(394.674)
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	(25.429)	(121.512)	(120.915)
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	136.543	708.446	711.457
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	6.312	41.710	42.122
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	(58.106)	(210.001)	(300.057)
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	(8.459)	(76.794)	(141.005)
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	86.029	1.059.825	1.328.913
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	209.477	1.165.350	1.748.172
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(122.983)	(336.389)	4.436.811
CFD auf GS Commercial Real Estate Basket	Goldman Sachs	(11.469)	(175.205)	(257.126)
CFD auf den GS CORD Index	Goldman Sachs	(35.183)	(347.842)	(424.301)
CFD auf GS CSDN Basket	Goldman Sachs	(19.038)	(164.354)	(129.900)
CFD auf GS Healthcare Basket	Goldman Sachs	(20.261)	(15.803)	(45.735)
CFD auf GS Info Tech Basket	Goldman Sachs	(5.983)	(8.737)	(7.312)
CFD auf GS NRSI Basket	Goldman Sachs	(14.643)	(176.136)	(302.514)
CFD auf den GS OZVT Index	Goldman Sachs	(83.775)	(497.124)	(757.967)
CFD auf GS PEVC Basket	Goldman Sachs	(23.632)	(158.173)	(133.495)
CFD auf GS SCHN Basket	Goldman Sachs	(37.937)	28.057	(94.471)
CFD auf den GS SHIF Index	Goldman Sachs	(8.903)	(60.032)	(87.266)
CFD auf GS SPAC Basket	Goldman Sachs	(19.488)	(152.936)	(150.666)
CFD auf GS STHK Basket	Goldman Sachs	(11.254)	(266.832)	(266.832)
CFD auf JP Energy Basket	J.P. Morgan	(18.578)	101.352	101.542
CFD auf JP Flagship Basket	J.P. Morgan	(89.888)	(126.297)	(418.412)
CFD auf JP Utilities Basket	J.P. Morgan	(15.675)	(98.355)	(143.528)
		USD	(291.167)	4.192.841

Credit Default Index-Swapkontrakte

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

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

Am 30. September 2024 waren die folgenden Teifonds in Credit Default Index Swapkontrakten auf Finanzindizes engagiert:

Schutz-position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/erhalten %	Fälligkeits-datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(-Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 42 20/12/2029	J.P. Morgan	EUR	35.000.000	5,00	20. Dez. 2029	3.267.039

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Credit Default Index-Swapkontrakte (Forts.)

Schutz-position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten %	Fälligkeits-datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 42 20/12/2029	J.P. Morgan	EUR	139.000.000	1,00	20. Dez. 2029	3.139.942
Verkauf	CDX North America High Yield Series 42 20/06/2029	J.P. Morgan	USD	47.000.000	5,00	20. Jun. 2029	3.696.327
Kauf	CDX North America High Yield Series 42 20/06/2029	J.P. Morgan	USD	47.000.000	5,00	20. Jun. 2029	34.766
Verkauf	CDX North America High Yield Series 43 20/12/2029	J.P. Morgan	USD	47.000.000	5,00	20. Dez. 2029	(12.573)
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 43 20/12/2029	J.P. Morgan	USD	213.000.000	1,00	20. Dez. 2029	4.809.440
						USD	14.934.941
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 42 20/12/2029	Citi Bank	EUR	26.000.000	1,00	20. Dez. 2029	(29.735)
Kauf	CDX North America Investment Grade Series 43 20/12/2029	Citi Bank	USD	10.000.000	1,00	20. Dez. 2029	1.623
						USD	(28.112)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf	CDX Emerging Markets Series 41 20/06/2029	Morgan Stanley	USD	4.527.000	1,00	20. Jun. 2029	(38.584)
Kauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 41 20/06/2029	Morgan Stanley	EUR	4.129.000	1,00	20. Jun. 2029	(19.236)
Kauf	CDX North America High Yield Series 43 20/12/2029	Morgan Stanley	USD	1.960.000	5,00	20. Dez. 2029	1.111
						USD	(56.709)

Credit Default Swapkontrakte

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

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

Zum 30. September 2024 waren keine Teilfonds in Credit Default Swap-Kontrakten engagiert.

Cross-Currency Swapkontrakte

Die Cross-Currency Swaps wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Cross-Currency Swapkontrakten“ aufgeführt. Ein Cross-Currency Swap ist ein Vertrag, mit dem sich zwei Parteien dazu verpflichten, in einem bestimmten Jahr auf zwei verschiedene Währungen lautende Zinszahlungen auszutauschen.

Zum 30. September 2024 war der folgende Teilfonds in Cross-Currency Swapkontrakten engagiert:

Kontrahent	Zu zahlende Währung	Nennwert	Erhaltene Währung	Nennwert	Fälligkeit	Zu zahlender Satz	Erhaltener Satz	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa								
Bank of America	USD	11.346.865	AUD	17.022.000	19. Mrz. 2030	USD SOFR 1 Tag	AUD BBR 3 Monate	3.900
Bank of America	USD	11.363.460	NOK	122.764.000	19. Mrz. 2030	USD SOFR 1 Tag	NOK NIBOR 3 Monate	6.689
Bank of America	USD	11.373.479	SEK	117.703.000	19. Mrz. 2030	USD SOFR 1 Tag	SEK STIBOR 3 Monate	6.741
Morgan Stanley	USD	11.328.918	CAD	15.396.000	19. Mrz. 2030	USD SOFR 1 Tag	CAD CORRA OIS 1 Tag	(12)
Morgan Stanley	USD	11.307.402	NZD	18.392.000	19. Mrz. 2030	USD SOFR 1 Tag	NZD BBR 3 Monate	(4.327)
							USD	12.991

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Inflations-Swapkontrakte

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

Zum 30. September 2024 war der folgende Teilfonds in Swaps auf Inflationsraten engagiert:

Nennbetrag	Währung	Kontrahent	Wertpapierbeschreibung	Fälligkeits-datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
1.945.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,45 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	(105.438)
5.529.000	USD	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,63 %, erhält variablen Zinssatz auf USCPI, 10 Jahre	15. Sep. 2033	(99.139)
3.785.000	EUR	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,48 %, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	117.345
263.000	USD	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,60 %, zahlt variablen Zinssatz auf USCPI, 5 Jahre	15. Sep. 2028	(2.007)
5.406.000	USD	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,61 %, zahlt variablen Zinssatz auf USCPI, 5 Jahre	15. Sep. 2028	43.769
6.463.000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,40 %, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	(310.909)
6.463.000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,40 %, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	172.623
					USD
					(183.756)

Zins-Swaps

Zur Absicherung gegen Zinsschwankungen kann die Gesellschaft Zins-Swapkontrakte abschließen, sofern:

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

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

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

Zum 30. September 2024 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Zinssätze engagiert:

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Zahlt Festzinssatz 9,72 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	170.000.000	MXN	16. Dez. 2026	(158.521)
Erhält Festzinssatz 9,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	170.000.000	MXN	16. Dez. 2026	77.298
Erhält Festzinssatz 7,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	300.000.000	ZAR	18. Dez. 2026	(1.601)
Zahlt Festzinssatz 12,09 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	87.584.337	BRL	04. Jan. 2027	131.174
Erhält Festzinssatz 8,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	23.946.154	MXN	06. Dez. 2034	9.734
Zahlt Festzinssatz 11,83 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	126.202.523	BRL	02. Jan. 2026	170.146
Zahlt Festzinssatz 9,20 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	53.797.477	BRL	02. Jan. 2026	305.211
Erhält Festzinssatz 9,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J. P. Morgan	7.584.337	BRL	04. Jan. 2027	(75.300)
Erhält Festzinssatz 9,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	40.000.000	ZAR	18. Dez. 2034	133.858
Erhält Festzinssatz 9,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	40.000.000	ZAR	18. Dez. 2034	120.223

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 8,46 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	140.000.000	ZAR	18. Dez. 2029	333.145
Erhält Festzinssatz 8,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	70.000.000	ZAR	18. Dez. 2029	154.886
Erhält Festzinssatz 9,10 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	40.000.000	ZAR	18. Dez. 2034	98.463
Erhält Festzinssatz 1,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J. P. Morgan	16.000.000	CHF	18. Dez. 2034	1.277.005
Erhält Festzinssatz 2,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	100.000.000	SEK	18. Dez. 2034	174.545
Erhält Festzinssatz 1,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J. P. Morgan	6.000.000	CHF	18. Dez. 2029	212.746
Erhält Festzinssatz 1,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J. P. Morgan	12.000.000	CHF	18. Dez. 2029	425.492
Erhält Festzinssatz 2,17 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	20.000.000	SEK	18. Dez. 2034	(7.719)
Erhält Festzinssatz 3,89 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J. P. Morgan	9.270.976	NZD	18. Dez. 2034	8.475
Zahlt Festzinssatz 4,24 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	1.447.030	USD	18. Dez. 2049	(214.308)
Erhält Festzinssatz 3,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	8.647.030	USD	18. Dez. 2049	(288.947)
Erhält Festzinssatz 3,18 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	9.025.939	USD	18. Dez. 2044	(290.363)
Erhält Festzinssatz 2,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	180.000.000	SEK	18. Dez. 2029	40.535
Zahlt Festzinssatz 4,99 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J. P. Morgan	270.976	NZD	18. Dez. 2034	(16.024)
Zahlt Festzinssatz 4,86 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J. P. Morgan	1.118.899	NZD	18. Dez. 2029	(43.917)
Erhält Festzinssatz 3,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J. P. Morgan	19.118.899	NZD	18. Dez. 2029	(17.223)
Erhält Festzinssatz 7,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J. P. Morgan	150.000.000	ZAR	18. Dez. 2026	(800)
Erhält Festzinssatz 1,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J. P. Morgan	2.084.302.402	JPY	18. Dez. 2044	(798.349)
Zahlt Festzinssatz 1,88 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J. P. Morgan	1.244.302.402	JPY	18. Dez. 2044	(654.455)
Zahlt Festzinssatz 4,76 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	33.715.619	USD	18. Dez. 2026	(965.937)
Erhält Festzinssatz 3,30 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	41.715.619	USD	18. Dez. 2026	34.222
Erhält Festzinssatz 1,85 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	467.416.286	SEK	18. Dez. 2026	(62.684)
Zahlt Festzinssatz 3,36 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J. P. Morgan	123.416.286	SEK	18. Dez. 2026	(339.191)
Zahlt Festzinssatz 3,45 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J. P. Morgan	16.646.672	EUR	18. Dez. 2026	(468.032)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,38 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	4.943.594	USD	18. Dez. 2031	(355.944)
Erhält Festzinssatz 3,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	18.943.594	USD	18. Dez. 2031	(246.505)
Zahlt Festzinssatz 4,33 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	2.025.939	USD	18. Dez. 2044	(271.249)
Zahlt Festzinssatz 4,48 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	11.443.005	USD	18. Dez. 2028	(554.744)
Erhält Festzinssatz 2,95 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	27.443.005	USD	18. Dez. 2028	(224.908)
Erhält Festzinssatz 2,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J. P. Morgan	32.646.672	EUR	18. Dez. 2026	(8.977)
Zahlt Festzinssatz 3,34 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J. P. Morgan	900.000	USD	18. Dez. 2049	1.876
Zahlt Festzinssatz 9,41 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	23.946.154	MXN	06. Dez. 2034	(63.578)
Zahlt Festzinssatz 9,60 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	8.321.136	MXN	12. Dez. 2029	(19.764)
Erhält Festzinssatz 8,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J. P. Morgan	8.321.136	MXN	12. Dez. 2029	4.283
					USD
					(2.435.723)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Zahlt Festzinssatz 8,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	67.600.000	MXN	19. Jul. 2028	20.432
Erhält Festzinssatz 8,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	16.155.000	MXN	21. Nov. 2033	5.363
Zahlt Festzinssatz 8,79 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	92.095.000	MXN	27. Nov. 2028	(30.486)
Zahlt Festzinssatz 7,17 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.713.496.000	COP	17. Jun. 2029	1.077
Zahlt Festzinssatz 2,22 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.042.000	EUR	17. Sep. 2026	(19.517)
Erhält Festzinssatz 7,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.987.912.000	COP	19. Sep. 2034	(7.902)
Erhält Festzinssatz 8,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	5.456.049.000	COP	20. Jun. 2034	7.075
Erhält Festzinssatz 8,58 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	4.218.195.000	COP	19. Sep. 2034	14.914
Erhält Festzinssatz 8,62 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.503.840.000	COP	19. Sep. 2034	13.290
Zahlt Festzinssatz 3,91 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	2.121.000	MYR	17. Sept. 2029	(6.033)
Zahlt Festzinssatz 6,47 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	67.151.000	INR	16. Sept. 2029	(9.295)
Zahlt Festzinssatz 10,74 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	10.495.187	BRL	02. Jan. 2026	33.493
Zahlt Festzinssatz 3,41 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 6 Months	Morgan Stanley	2.362.000	CAD	19. Sep. 2034	(32.770)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 3,88 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6.061.000	USD	17. Dez. 2026	(58.759)
Zahlt Festzinssatz 10,93 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	6.218.066	BRL	02. Jan. 2026	16.642
Zahlt Festzinssatz 3,28 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	10.129.885.000	KRW	18. Dez. 2034	(315.690)
Zahlt Festzinssatz 11,54 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	45.000.000	ZAR	19. Sep. 2034	(116.076)
Erhält Festzinssatz 8,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.759.926.000	COP	19. Dez. 2034	12.418
Zahlt Festzinssatz 6,44 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	201.722.000	HUF	19. Dez. 2034	(3.341)
Erhält Festzinssatz 6,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	59.260.000	INR	18. Dez. 2029	7.035
Erhält Festzinssatz 6,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	75.421.000	INR	18. Dez. 2029	8.961
Zahlt Festzinssatz 4,94 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	955.000	PLN	18. Dez. 2034	(10.131)
Erhält Festzinssatz 4,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	126.112.427	NOK	18. Dez. 2026	48.483
Erhält Festzinssatz 7,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.914.223.000	COP	18. Dez. 2029	31.774
Erhält Festzinssatz 5,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.404.000	PLN	18. Dez. 2025	1.143
Erhält Festzinssatz 7,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.969.563.000	COP	18. Dez. 2029	19.914
Erhält Festzinssatz 2,85 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	4.755.554.000	KRW	18. Dez. 2026	6.792
Zahlt Festzinssatz 9,53 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	92.917.000	MXN	11. Aug. 2026	(38.735)
Zahlt Festzinssatz 3,35 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.776.000	CZK	18. Dez. 2034	(2.391)
Zahlt Festzinssatz 3,36 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.886.000	CZK	18. Dez. 2034	(3.151)
Erhält Festzinssatz 2,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.823.000	EUR	18. Sep. 2026	27.520
Zahlt Festzinssatz 4,46 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.824.000	PLN	18. Dez. 2029	(11.641)
Zahlt Festzinssatz 8,39 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	5.331.418.000	COP	19. Dez. 2034	(10.284)
Zahlt Festzinssatz 11,92 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	7.021.528	BRL	04. Jan. 2027	10.173
Zahlt Festzinssatz 11,94 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	6.898.950	BRL	04. Jan. 2027	9.712
Zahlt Festzinssatz 7,58 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10.501.000	ZAR	04. Mrz. 2030	(2.061)
Erhält Festzinssatz 8,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	14.619.000	ZAR	02. Mai 2035	10.811

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 8,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	14.779.000	ZAR	18. Dez. 2031	7.070
Zahlt Festzinssatz 5,63 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.763.435.000	HUF	18. Dez. 2025	(10.554)
Erhält Festzinssatz 5,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	498.910.000	HUF	18. Dez. 2031	5.086
Zahlt Festzinssatz 7,28 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	25.932.811.000	COP	18. Dez. 2029	(80.522)
Erhält Festzinssatz 7,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	4.890.822.000	COP	18. Dez. 2034	29.646
Zahlt Festzinssatz 7,34 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	10.552.524.000	COP	18. Dez. 2026	(20.817)
Zahlt Festzinssatz 11,71 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	4.347.905	BRL	04. Jan. 2027	10.103
Erhält Festzinssatz 5,18 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	60.296.000	PLN	18. Dez. 2025	(3.983)
Erhält Festzinssatz 7,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	22.367.325.000	COP	18. Dez. 2027	46.134
Zahlt Festzinssatz 5,42 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	142.564.000	HUF	19. Mrz. 2030	(3.263)
Erhält Festzinssatz 3,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	21.012.000	NOK	19. Mrz. 2035	(9.981)
Erhält Festzinssatz 4,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	9.201.000	ILS	19. Mrz. 2030	(1.007)
Zahlt Festzinssatz 4,82 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.086.390.000	CLP	18. Dez. 2034	(10.044)
Zahlt Festzinssatz 10,48 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	6.768.000	ZAR	20. Mrz. 2035	(3.455)
Erhält Festzinssatz 8,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	238.221.000	ZAR	19. Mrz. 2035	105.664
Erhält Festzinssatz 3,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	18.656.000	GBP	19. Mrz. 2027	(41.703)
Erhält Festzinssatz 2,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	64.793.000	CAD	19. Mrz. 2027	80.018
Zahlt Festzinssatz 2,81 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	3.701.000	CAD	19. Mrz. 2035	12.530
Zahlt Festzinssatz 4,20 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.699.328.000	CLP	18. Dez. 2026	15
Erhält Festzinssatz 1,98 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	9.468.000	SGD	19. Mrz. 2027	(28.132)
Erhält Festzinssatz 1,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	45.018.000	SEK	19. Mrz. 2027	(4.832)
Zahlt Festzinssatz 3,59 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.181.000	AUD	19. Mrz. 2030	4.337
Zahlt Festzinssatz 5,99 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	121.915.000	INR	19. Mrz. 2027	(1.332)
Erhält Festzinssatz 6,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.696.641.000	COP	18. Dez. 2029	(4.875)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 6,70 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	15.958.473.000	COP	18. Dez. 2026	13.490
Erhält Festzinssatz 2,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	15.630.000	USD	19. Mrz. 2027	(40.429)
Erhält Festzinssatz 3,54 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.324.000	USD	18. Sep. 2025	(761)
Erhält Festzinssatz 3,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.324.000	USD	18. Sep. 2025	(1.196)
Erhält Festzinssatz 3,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.290.000	USD	18. Sep. 2025	(1.344)
Zahlt Festzinssatz 3,07 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	105.020.000	CZK	18. Dez. 2026	(1.463)
Zahlt Festzinssatz 3,22 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	381.000	USD	18. Dez. 2034	2.476
Zahlt Festzinssatz 4,59 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	385.000	ILS	18. Dez. 2034	(1.215)
Erhält Festzinssatz 3,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 3 Months	Morgan Stanley	205.230.000	CZK	18. Dez. 2025	4.016
Zahlt Festzinssatz 7,48 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.087.973.000	COP	18. Dez. 2034	(1.682)
Erhält Festzinssatz 3,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.289.000	USD	18. Sep. 2025	(1.291)
Erhält Festzinssatz 2,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2.138.000	SGD	18. Dez. 2026	16
Erhält Festzinssatz 8,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	5.834.000	ZAR	18. Dez. 2034	(123)
Zahlt Festzinssatz 5,99 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	66.256.000	INR	18. Dez. 2026	(1.151)
Zahlt Festzinssatz 6,92 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	8.995.114.000	COP	18. Dez. 2026	(1.094)
Zahlt Festzinssatz 9,33 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIE 28 Days	Morgan Stanley	15.290.000	MXN	24. Feb. 2028	(15.621)
Zahlt Festzinssatz 8,76 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIE 28 Days	Morgan Stanley	39.665.000	MXN	11. Apr. 2028	(7.229)
Zahlt Festzinssatz 8,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIE 28 Days	Morgan Stanley	36.765.000	MXN	14. Jun. 2028	10.890
Erhält Festzinssatz 9,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE 28 Days	Morgan Stanley	13.340.000	MXN	31. Aug. 2033	26.298
Zahlt Festzinssatz 9,38 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIE 28 Days	Morgan Stanley	52.500.000	MXN	06. Sep. 2028	(69.070)
Erhält Festzinssatz 9,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE 28 Days	Morgan Stanley	20.725.000	MXN	01. Sep. 2033	23.565
Erhält Festzinssatz 9,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE 28 Days	Morgan Stanley	42.185.000	MXN	16. Sep. 2033	127.981
Erhält Festzinssatz 9,43 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE 28 Days	Morgan Stanley	17.665.000	MXN	03. Okt. 2033	43.841
Erhält Festzinssatz 9,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIE 28 Days	Morgan Stanley	8.700.000	MXN	24. Okt. 2033	18.405

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 3,53 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.714.000	ILS	17. Jun. 2029	14.972
Zahlt Festzinssatz 6,41 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	444.215.000	INR	17. Jun. 2029	(55.795)
Erhält Festzinssatz 2,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	9.947.000	CNY	17. Jun. 2029	30.511
Erhält Festzinssatz 3,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4.684.000	USD	17. Jun. 2029	58.977
Erhält Festzinssatz 4,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4.143.000	NZD	17. Jun. 2029	67.366
Erhält Festzinssatz 8,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIIE 28 Days	Morgan Stanley	7.605.000	MXN	08. Dez. 2033	(4.258)
Zahlt Festzinssatz 3,56 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	5.771.000	ILS	17. Jun. 2029	22.267
Erhält Festzinssatz 8,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIIE 28 Days	Morgan Stanley	6.712.500	MXN	04. Jan. 2034	(4.741)
Zahlt Festzinssatz 3,73 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	5.348.000	ILS	17. Jun. 2029	14.351
Erhält Festzinssatz 9,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIIE 28 Days	Morgan Stanley	27.864.000	MXN	15. Jan. 2027	6.785
Zahlt Festzinssatz 3,28 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	1.677.000	GBP	17. Jun. 2029	8.620
Erhält Festzinssatz 2,86 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	803.000	SGD	20. Jun. 2034	8.671
Erhält Festzinssatz 2,91 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	580.000	SGD	20. Jun. 2034	7.187
Erhält Festzinssatz 5,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	231.805.000	CLP	21. Jun. 2034	2.495
Zahlt Festzinssatz 2,47 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.170.000	EUR	17. Jun. 2029	(12.982)
Zahlt Festzinssatz 0,34 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	9.970.497.000	JPY	19. Jun. 2026	60.808
Erhält Festzinssatz 5,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.059.055.000	CLP	21. Jun. 2034	62.768
Zahlt Festzinssatz 8,76 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIIE 28 Days	Morgan Stanley	12.235.000	MXN	27. Feb. 2029	(3.967)
Zahlt Festzinssatz 3,84 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.646.000	AUD	16. Sept. 2029	(44.044)
Erhält Festzinssatz 4,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	4.595.000	AUD	19. Sep. 2034	40.075
Erhält Festzinssatz 3,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	4.483.000	GBP	17. Sep. 2026	34.026
Erhält Festzinssatz 3,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	1.002.000	GBP	19. Sep. 2034	(4.594)
Zahlt Festzinssatz 3,44 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 3 Months	Morgan Stanley	54.481.000	NOK	17. Sep. 2026	(8.438)
Zahlt Festzinssatz 3,38 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	51.941.000	NOK	19. Sep. 2034	(12.611)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 3,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	6.980.023.000	KRW	17. Sep. 2026	25.505
Zahlt Festzinssatz 3,76 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	1.065.000	MYR	17. Sept. 2029	(2.003)
Erhält Festzinssatz 2,83 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	1.231.000	SGD	16. Sept. 2029	13.975
Erhält Festzinssatz 5,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	253.841.000	CLP	20. Sep. 2034	2.995
Zahlt Festzinssatz 4,19 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	20.276.000	NZD	17. Sep. 2026	(147.758)
Zahlt Festzinssatz 8,36 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	281.032.000	MXN	16. Sep. 2026	(12.605)
Erhält Festzinssatz 9,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	35.615.000	MXN	24. Mrz. 2027	18.017
Zahlt Festzinssatz 8,92 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	42.805.000	MXN	27. Mrz. 2029	(27.579)
Erhält Festzinssatz 3,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.478.000	CZK	19. Sep. 2034	5.025
Zahlt Festzinssatz 6,97 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	528.389.000	HUF	16. Sept. 2029	(62.620)
Zahlt Festzinssatz 6,91 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	459.766.000	HUF	16. Sept. 2029	(52.726)
Erhält Festzinssatz 4,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.293.000	PLN	16. Sept. 2029	33.741
Erhält Festzinssatz 4,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.500.000	PLN	16. Sept. 2029	19.339
Zahlt Festzinssatz 11,78 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16.640.000	ZAR	19. Sep. 2034	(49.427)
Erhält Festzinssatz 9,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	21.270.000	MXN	12. Mai 2027	25.452
Erhält Festzinssatz 5,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	703.158.000	CLP	20. Sep. 2034	6.600
Erhält Festzinssatz 2,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	4.375.000	CNY	16. Sept. 2029	4.631
Zahlt Festzinssatz 11,79 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	9.323.000	ZAR	19. Sep. 2034	(27.841)
Zahlt Festzinssatz 3,95 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	19.999.000	CZK	18. Dez. 2034	(51.997)
Erhält Festzinssatz 4,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	68.090.000	CZK	18. Dez. 2026	55.365
Erhält Festzinssatz 3,91 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	59.987.000	CZK	18. Dez. 2029	104.674
Erhält Festzinssatz 3,98 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14.844.000	CZK	19. Dez. 2034	11.908
Zahlt Festzinssatz 6,26 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.908.327.000	HUF	18. Dez. 2025	(43.318)
Erhält Festzinssatz 6,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.384.159.000	HUF	17. Dez. 2026	74.210

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 6,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.182.838.000	HUF	18. Dez. 2026	157.163
Zahlt Festzinssatz 4,40 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	9.415.000	ILS	18. Dez. 2025	(1.126)
Zahlt Festzinssatz 4,36 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	28.738.000	ILS	17. Dez. 2026	(27.309)
Erhält Festzinssatz 4,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	28.814.000	ILS	18. Dez. 2026	33.558
Erhält Festzinssatz 9,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	32.928.000	MXN	04. Jun. 2027	42.755
Zahlt Festzinssatz 4,16 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5.569.000	AUD	18. Dez. 2025	(15.552)
Zahlt Festzinssatz 6,35 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	410.495.000	INR	18. Dez. 2026	(32.066)
Erhält Festzinssatz 6,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	294.403.000	INR	18. Dez. 2029	45.120
Zahlt Festzinssatz 5,09 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	15.647.000	PLN	18. Dez. 2034	(213.787)
Zahlt Festzinssatz 4,75 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	17.178.000	PLN	17. Dez. 2026	(36.235)
Erhält Festzinssatz 5,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.599.000	PLN	18. Dez. 2026	8.514
Erhält Festzinssatz 3,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	4.472.555.000	KRW	18. Dez. 2026	34.574
Erhält Festzinssatz 3,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	9.486.609.000	KRW	18. Dez. 2029	169.247
Zahlt Festzinssatz 3,10 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	5.554.000	SGD	18. Dez. 2025	(32.373)
Erhält Festzinssatz 3,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	7.493.000	USD	19. Dez. 2034	74.436
Zahlt Festzinssatz 9,37 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	8.888.000	MXN	12. Dez. 2029	(16.647)
Erhält Festzinssatz 9,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	52.789.000	MXN	06. Dez. 2034	122.477
Zahlt Festzinssatz 5,23 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	709.589.000	CLP	18. Dez. 2034	(32.714)
Zahlt Festzinssatz 11,69 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	53.628.000	ZAR	19. Sep. 2034	(151.380)
Erhält Festzinssatz 3,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	7.324.000	MYR	18. Dez. 2029	22.783
Zahlt Festzinssatz 3,62 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	4.952.000	MYR	18. Dez. 2026	(5.375)
Zahlt Festzinssatz 11,62 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	27.466.000	ZAR	19. Sep. 2034	(74.572)
Zahlt Festzinssatz 3,16 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	21.676.000	SEK	18. Dez. 2025	(22.145)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 2,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	66.385.000	SEK	16. Dez. 2029	84.931
Erhält Festzinssatz 2,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	37.778.000	SEK	18. Dez. 2029	77.966
Erhält Festzinssatz 2,91 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.208.000	EUR	18. Dez. 2029	322.513
Zahlt Festzinssatz 4,25 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 3 Months	Morgan Stanley	81.606.000	NOK	18. Dez. 2025	(26.126)
Erhält Festzinssatz 4,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.147.000	NZD	19. Dez. 2034	7.848
Erhält Festzinssatz 4,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.715.000	NZD	18. Dez. 2034	15.842
Erhält Festzinssatz 10,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	2.260.000	MXN	01. Jun. 2034	11.363
Erhält Festzinssatz 10,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	2.260.000	MXN	01. Jun. 2034	11.402
Erhält Festzinssatz 10,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	3.145.000	MXN	01. Jun. 2034	16.572
Zahlt Festzinssatz 10,81 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	8.239.000	ZAR	19. Sep. 2034	(11.656)
Erhält Festzinssatz 2,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	14.372.000	SEK	19. Sep. 2034	13.122
Zahlt Festzinssatz 4,99 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	994.000	PLN	18. Dez. 2029	(8.239)
Zahlt Festzinssatz 11,05 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	12.342.000	ZAR	19. Dez. 2034	(19.524)
Erhält Festzinssatz 4,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	8.685.000	AUD	17. Dez. 2026	48.648
Erhält Festzinssatz 10,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	85.685.000	MXN	15. Jul. 2025	23.867
Erhält Festzinssatz 9,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29.465.000	MXN	13. Jul. 2027	33.435
Zahlt Festzinssatz 6,37 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	274.854.000	HUF	19. Dez. 2034	(2.783)
Zahlt Festzinssatz 3,78 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	5.592.000	GBP	18. Sept. 2029	(19.883)
Erhält Festzinssatz 4,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	316.507.000	CLP	18. Dez. 2029	9.659
Erhält Festzinssatz 10,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	135.455.000	MXN	18. Jul. 2025	43.861
Erhält Festzinssatz 9,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	46.790.000	MXN	16. Jul. 2027	60.741
Erhält Festzinssatz 10,82 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	90.120.000	MXN	21. Jul. 2025	31.189
Erhält Festzinssatz 3,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	20.947.300	NZD	18. Dez. 2026	123.075

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,95 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	944.000	PLN	18. Dez. 2034	(10.167)
Zahlt Festzinssatz 4,96 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.625.000	PLN	18. Dez. 2034	(17.667)
Zahlt Festzinssatz 5,28 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	741.850.000	CLP	18. Dez. 2034	(37.329)
Zahlt Festzinssatz 5,27 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	961.270.000	CLP	18. Dez. 2034	(47.901)
Erhält Festzinssatz 4,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.363.711.000	CLP	18. Dez. 2026	38.656
Erhält Festzinssatz 5,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.739.151.000	CLP	18. Dez. 2026	29.251
Zahlt Festzinssatz 5,27 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	386.598.000	CLP	18. Dez. 2034	(19.248)
Erhält Festzinssatz 3,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14.765.000	CZK	18. Dez. 2029	6.029
Erhält Festzinssatz 5,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	632.321.000	CLP	18. Dez. 2029	20.923
Erhält Festzinssatz 5,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	603.487.000	CLP	18. Dez. 2029	21.113
Zahlt Festzinssatz 2,97 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	4.908.000	CAD	17. Dez. 2026	(19.761)
Zahlt Festzinssatz 6,27 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	266.061.000	HUF	19. Dez. 2034	(248)
Erhält Festzinssatz 6,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	102.655.000	INR	18. Dez. 2029	5.644
Zahlt Festzinssatz 2,45 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	566.000	SGD	18. Dez. 2034	(997)
Erhält Festzinssatz 2,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	3.422.000	SGD	18. Dez. 2026	2.475
Erhält Festzinssatz 2,82 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.918.725.000	KRW	18. Dez. 2026	1.739
Erhält Festzinssatz 2,85 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.582.598.000	KRW	18. Dez. 2026	2.202
Erhält Festzinssatz 2,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.575.000	EUR	18. Sept. 2029	21.636
Erhält Festzinssatz 9,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	6.923.000	MXN	09. Aug. 2027	2.884
Erhält Festzinssatz 10,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	139.380.000	MXN	11. Aug. 2025	20.034
Erhält Festzinssatz 10,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	92.808.000	MXN	12. Aug. 2025	15.863
Erhält Festzinssatz 5,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	135.756.000	HUF	18. Dez. 2034	5.222
Erhält Festzinssatz 5,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	80.160.000	HUF	18. Dez. 2034	3.084
Erhält Festzinssatz 5,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	27.357.000	PLN	18. Dez. 2025	1.190

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 5,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	27.388.000	PLN	18. Dez. 2025	(9.312)
Zahlt Festzinssatz 4,68 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.423.000	PLN	19. Dez. 2034	(2.455)
Zahlt Festzinssatz 4,68 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.455.000	PLN	19. Dez. 2034	(2.332)
Erhält Festzinssatz 3,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	45.573.000	CZK	18. Dez. 2026	9.010
Erhält Festzinssatz 3,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	40.139.000	CZK	18. Dez. 2026	7.249
Zahlt Festzinssatz 9,59 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	46.105.000	MXN	18. Aug. 2026	(22.115)
Zahlt Festzinssatz 2,13 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	17.787.000	SEK	18. Sept. 2029	(11.155)
Zahlt Festzinssatz 2,28 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	43.322.000	SEK	18. Sep. 2026	(13.759)
Erhält Festzinssatz 2,96 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.943.586.000	KRW	19. Dez. 2034	5.004
Erhält Festzinssatz 7,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	69.604.930.000	COP	18. Dez. 2025	44.855
Erhält Festzinssatz 3,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 3 Months	Morgan Stanley	251.981.000	CZK	18. Dez. 2025	11.572
Zahlt Festzinssatz 3,13 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	284.557.000	CZK	18. Dez. 2026	(19.774)
Zahlt Festzinssatz 5,25 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.033.651.000	HUF	18. Dez. 2026	(29.029)
Erhält Festzinssatz 5,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.682.753.000	HUF	18. Dez. 2029	36.703
Erhält Festzinssatz 6,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	278.528.000	INR	18. Dez. 2026	2.508
Zahlt Festzinssatz 6,00 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	228.732.000	INR	18. Dez. 2029	2.058
Zahlt Festzinssatz 4,27 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	55.800.000	PLN	18. Dez. 2029	(11.358)
Erhält Festzinssatz 4,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.696.000	PLN	18. Dez. 2034	(2.708)
Zahlt Festzinssatz 7,08 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	22.316.000	ZAR	18. Dez. 2026	(699)
Erhält Festzinssatz 10,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	35.784.000	ZAR	19. Dez. 2034	22.391
Erhält Festzinssatz 8,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	78.885.000	ZAR	18. Dez. 2034	57.337
Zahlt Festzinssatz 7,54 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	217.690.000	ZAR	18. Dez. 2029	(43.843)
Zahlt Festzinssatz 8,67 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	158.876.000	ZAR	18. Dez. 2034	(121.731)
Erhält Festzinssatz 5,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	280.067.000	HUF	18. Dez. 2031	10.421

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 2,23 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	358.000	SGD	18. Dez. 2029	(764)
Erhält Festzinssatz 2,23 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	615.000	SGD	18. Dez. 2029	(1.460)
Zahlt Festzinssatz 3,25 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	55.319.000	CZK	19. Mrz. 2035	4.229
Erhält Festzinssatz 3,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	126.714.000	CZK	19. Mrz. 2027	6.224
Erhält Festzinssatz 3,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	22.514.000	CZK	19. Mrz. 2030	1.050
Erhält Festzinssatz 5,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	153.223.000	HUF	19. Mrz. 2027	1.451
Zahlt Festzinssatz 4,38 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.409.000	PLN	19. Mrz. 2035	(35)
Erhält Festzinssatz 4,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	56.028.000	PLN	19. Mrz. 2027	16.397
Zahlt Festzinssatz 4,20 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.399.000	PLN	19. Mrz. 2030	(1.410)
Zahlt Festzinssatz 4,41 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.361.000	ILS	19. Mrz. 2035	888
Zahlt Festzinssatz 4,10 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	16.488.000	ILS	19. Mrz. 2026	5.138
Zahlt Festzinssatz 6,95 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	194.724.000	ZAR	19. Mrz. 2027	4.933
Zahlt Festzinssatz 7,53 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	208.599.000	ZAR	19. Mrz. 2030	(10.074)
Zahlt Festzinssatz 6,93 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	108.177.000	ZAR	18. Mrz. 2027	1.321
Zahlt Festzinssatz 3,22 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	85.175.000	NOK	17. Mrz. 2030	26.830
Erhält Festzinssatz 7,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	124.973.000	ZAR	18. Dez. 2025	(2.387)
Erhält Festzinssatz 10,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	29.260.000	ZAR	19. Dez. 2034	13.517
Erhält Festzinssatz 4,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	748.169.000	CLP	18. Dez. 2029	(3.903)
Erhält Festzinssatz 4,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.157.994.000	CLP	18. Dez. 2029	(696)
Zahlt Festzinssatz 4,19 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.780.884.000	CLP	18. Dez. 2026	387
Zahlt Festzinssatz 9,11 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	336.022.000	MXN	18. Mrz. 2026	(47.751)
Erhält Festzinssatz 8,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	533.468.000	MXN	17. Mrz. 2027	117.201
Zahlt Festzinssatz 8,55 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	204.743.000	MXN	13. Mrz. 2030	(75.512)
Erhält Festzinssatz 8,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	42.311.000	MXN	07. Mrz. 2035	18.710

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 7,24 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	11.711.578.000	COP	18. Dez. 2025	6.034
Zahlt Festzinssatz 3,29 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	6.060.000	MYR	19. Mrz. 2027	2.166
Erhält Festzinssatz 3,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	14.257.000	MYR	19. Mrz. 2030	(6.870)
Zahlt Festzinssatz 3,50 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	9.984.000	MYR	17. Mrz. 2030	1.204
Erhält Festzinssatz 2,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.219.242.000	KRW	19. Mrz. 2027	1.195
Erhält Festzinssatz 2,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	509.325.000	KRW	17. Mrz. 2030	11
Erhält Festzinssatz 1,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	17.936.000	CNY	19. Mrz. 2027	(2.349)
Erhält Festzinssatz 6,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	243.122.000	INR	19. Mrz. 2030	(1.063)
Erhält Festzinssatz 0,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	27.245.000	JPY	19. Mrz. 2035	(170)
Zahlt Festzinssatz 1,28 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	24.216.000	JPY	21. Mrz. 2035	216
Zahlt Festzinssatz 2,23 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2.778.000	SGD	19. Mrz. 2035	37.040
Zahlt Festzinssatz 2,38 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.462.000	EUR	19. Mrz. 2035	(54.745)
Erhält Festzinssatz 2,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10.090.000	EUR	19. Mrz. 2027	35.270
Zahlt Festzinssatz 2,75 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	9.572.000	CAD	19. Mrz. 2026	(11.269)
Zahlt Festzinssatz 2,53 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	11.101.000	CAD	19. Mrz. 2030	(555)
Zahlt Festzinssatz 3,47 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	5.794.000	GBP	19. Mrz. 2035	78.059
Erhält Festzinssatz 3,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	5.604.000	GBP	19. Mrz. 2030	(42.842)
Zahlt Festzinssatz 1,78 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	59.654.000	SEK	18. Mrz. 2027	4.844
Zahlt Festzinssatz 2,16 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	36.173.000	SEK	19. Mrz. 2035	22.961
Erhält Festzinssatz 2,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	17.674.000	USD	19. Mrz. 2030	(100.958)
Zahlt Festzinssatz 3,13 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	13.154.000	USD	19. Mrz. 2035	138.287
Erhält Festzinssatz 3,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	5.879.000	AUD	19. Mrz. 2035	(41.030)
Erhält Festzinssatz 3,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	8.274.000	AUD	19. Mrz. 2027	(10.717)
Zahlt Festzinssatz 3,41 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4.234.000	NZD	19. Mrz. 2030	4.298

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,19 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.383.000	PLN	18. Dez. 2029	1.485
Zahlt Festzinssatz 3,31 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	71.734.000	GBP	17. Sep. 2026	108.118
Erhält Festzinssatz 4,07 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	5.818.603.000	CLP	17. Dez. 2026	(4.095)
Erhält Festzinssatz 4,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	5.632.511.000	CLP	19. Mrz. 2030	(5.540)
Zahlt Festzinssatz 4,66 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3.922.416.000	CLP	19. Mrz. 2035	20.559
Zahlt Festzinssatz 8,21 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	85.211.000	MXN	17. Mrz. 2027	(6.197)
Erhält Festzinssatz 3,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	63.852.000	NOK	19. Mrz. 2030	(34.271)
Erhält Festzinssatz 2,17 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2.404.000	SGD	17. Mrz. 2030	(9.598)
Erhält Festzinssatz 3,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.597.000	USD	19. Mrz. 2026	(2.155)
Erhält Festzinssatz 3,08 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	45.968.000	CZK	18. Dez. 2029	978
Zahlt Festzinssatz 3,11 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	64.426.000	CZK	18. Dez. 2026	(3.100)
Zahlt Festzinssatz 9,13 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	49.932.000	MXN	15. Sep. 2026	(5.008)
Zahlt Festzinssatz 4,60 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.969.000	ILS	18. Dez. 2034	(6.714)
Zahlt Festzinssatz 7,79 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16.362.000	ZAR	17. Dez. 2029	(159)
Zahlt Festzinssatz 7,48 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10.178.000	ZAR	18. Dez. 2029	(573)
Zahlt Festzinssatz 9,98 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	30.856.000	ZAR	19. Dez. 2034	2.568
Erhält Festzinssatz 2,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	1.205.000	SGD	18. Dez. 2029	891
Zahlt Festzinssatz 0,47 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	588.065.000	JPY	18. Dez. 2026	(564)
Zahlt Festzinssatz 2,83 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.802.437.000	KRW	18. Dez. 2034	(2.330)
				USD	1.092.413

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

Zum 30. September 2024 bestand das folgende Risiko bei in Bezug auf Derivatkontrakte einzufordernden/(zahlbare) Sicherheiten je Kontrahent:

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene/ (gezahlte) Sicherheiten
Schroder GAIA Asian Equity Long Short				
	HSBC	Barmittel	USD	660.000
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	140.000

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene/ (gezahlte) Sicherheiten
Schroder GAIA Asian Equity Long Short (Forts.)	UBS	Barmittel	AUD USD	54.447 837.642
Schroder GAIA BlueTrend	HSBC J.P. Morgan J.P. Morgan J.P. Morgan J.P. Morgan	Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel	USD CHF EUR USD ZAR USD	2.690.000 1.404.422 5.416.557 28.002.542 13.828.168 39.181.726
Schroder GAIA Cat Bond	HSBC	Barmittel	USD USD	(6.080.000) (6.080.000)
Schroder GAIA Contour Tech Equity	HSBC	Barmittel	USD USD	610.000 610.000
Schroder GAIA Egerton Equity	HSBC Morgan Stanley	Barmittel Barmittel	EUR CAD EUR	426.196 3 426.198
Schroder GAIA Helix	Goldman Sachs Goldman Sachs Goldman Sachs Goldman Sachs HSBC J.P. Morgan J.P. Morgan	Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel	EUR GBP JPY USD USD AUD CAD CHF EUR GBP HKD JPY USD USD	103.138 1.761.997 40.424.790 3.682.592 550.000 797.240 14.306 131.541 2.702.720 170.500 2.683.871 153.091.673 30.505.119 42.853.554
Schroder GAIA Oaktree Credit	HSBC	Barmittel	USD USD	40.000 40.000
Schroder GAIA SEG US Equity	HSBC	Barmittel	USD USD	210.000 210.000
Schroder GAIA Sirios US Equity	HSBC	Barmittel	USD USD	90.000 90.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank HSBC Morgan Stanley Morgan Stanley Morgan Stanley Morgan Stanley Morgan Stanley Morgan Stanley	Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel Barmittel	EUR USD AUD CAD EUR GBP JPY SGD	1.870.405 380.000 586.000 1.193.956 17.725.229 148.000 89.241.459 310.597

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene/ (gezahlte) Sicherheiten
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)				
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	132.930
	Société Générale	Barmittel	CAD	55
	Société Générale	Barmittel	CHF	15
	Société Générale	Barmittel	CZK	2
	Société Générale	Barmittel	EUR	47
	Société Générale	Barmittel	JPY	4.857
	Société Générale	Barmittel	MXN	1
	Société Générale	Barmittel	SEK	1.838.244
	Société Générale	Barmittel	USD	17.883.002
	Société Générale	Barmittel	ZAR	3.070.840
			USD	42.916.086
Schroder GAIA Wellington Pagosa				
	Barclays Bank	Barmittel	USD	670.000
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	253.047
	HSBC	Barmittel	USD	2.300.000
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	146.000
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	213
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	11.078
	Morgan Stanley	Barmittel	CZK	2.621
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	423
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	19.876
	Morgan Stanley	Barmittel	ILS	222
	Morgan Stanley	Barmittel	NOK	153
	Morgan Stanley	Barmittel	NZD	237
	Morgan Stanley	Barmittel	SEK	1.603
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	330.000
	UBS	Barmittel	USD	80.000
			USD	3.814.928

Ausweis von Transaktionskosten

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

Die Transaktionskosten für das Berichtsjahr fielen wie folgt aus:

Teilfonds	Währung	Transaktionskosten
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	USD	81.401
Schroder GAIA BlueTrend	USD	145.088
Schroder GAIA Cat Bond	USD	46.886
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	461.862
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	192.070
Schroder GAIA Helix	USD	845.380
Schroder GAIA Oaktree Credit	USD	5.685
Schroder GAIA SEG US Equity	USD	112.670
Schroder GAIA Sirios US Equity	USD	182.180
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	125.176
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	747.633

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Dividenden

Während des Berichtsjahres haben die folgenden Teilfonds Dividendenausschüttungen vorgenommen:

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungs-datum	Teilfonds	Bruttoaus-schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
13. Okt. 2023	20. Okt. 2023	27. Okt. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	1.050,67	USD	4,040275
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	1.550,34	SGD	5,345083
10. Nov. 2023	17. Nov. 2023	24. Nov. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2.229,41	USD	8,572672
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	3.599,90	SGD	11,250747
08. Dez. 2023	15. Dez. 2023	22. Dez. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2.095,20	USD	8,056288
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	3.868,74	SGD	10,579876
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF Aussch.	303.962,29	USD	25,794514
28. Dez. 2023	29. Dez. 2023	08. Jan. 2024	Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch.	23,82	USD	1,479462
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in CHF-abgesichert	137,99	CHF	1,289272
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in EUR-abgesichert	151,87	EUR	1,428726
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in GBP-abgesichert	148,10	GBP	1,383172
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch.	26,09	USD	1,609750
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in CHF-abgesichert	150,73	CHF	1,398655
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in EUR-abgesichert	165,93	EUR	1,551357
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in GBP-abgesichert	161,97	GBP	1,501928
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch.	26,23	USD	1,614408
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in CHF-abgesichert	154,79	CHF	1,433196
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in EUR-abgesichert	170,07	EUR	1,587250
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in GBP-abgesichert	28.026,76	GBP	1,536468
12. Jan. 2024	19. Jan. 2024	26. Jan. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch.	12,09	USD	8,060000
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2.638,74	USD	9,516507
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	4.576,63	SGD	12,509577
09. Feb. 2024	16. Feb. 2024	23. Feb. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch.	1.314,81	USD	6,569136
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2.148,09	USD	7,746725
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	3.901,15	SGD	10,222345
08. Mrz. 2024	15. Mrz. 2024	22. Mrz. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch.	1.267,99	USD	6,334874
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch.	2.139,26	USD	7,484116
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	3.708,88	SGD	9,713934
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF Aussch.	442.610,60	USD	31,065015
28. Mrz. 2024	02. Apr. 2024	09. Apr. 2024	Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch.	24,54	USD	1,502583
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in CHF-abgesichert	155,75	CHF	1,435754
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in EUR-abgesichert	164,13	EUR	1,523088
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in GBP-abgesichert	159,36	GBP	1,468059
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch.	27,35	USD	1,660721
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in CHF-abgesichert	170,88	CHF	1,562691
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in EUR-abgesichert	179,97	EUR	1,657785
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in GBP-abgesichert	174,71	GBP	1,596070
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch.	27,62	USD	1,673068
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in CHF-abgesichert	175,37	CHF	1,599784
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in EUR-abgesichert	184,76	EUR	1,698320
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in GBP-abgesichert	28.685,37	GBP	1,638163
12. Apr. 2024	19. Apr. 2024	26. Apr. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch.	5.221,39	USD	7,362155

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Ausschüttungen (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungs-datum	Teilfonds	Bruttoaus-schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
10 Mai 2024	17 Mai 2024	24 Mai 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch. Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch. Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch. Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	2.505,04 5.117,58 5.292,82 2.516,20 5.054,30	USD SGD USD USD SGD	8,763484 11,616090 7,462773 8,802211 11,467240
14. Jun. 2024	21. Jun. 2024	28. Jun. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch. Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch. Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF Aussch.	7.774,64 2.886,04 5.821,29 497.994,30	USD USD SGD USD	8,552201 10,095642 13,201398 34,724391
27. Jun. 2024	28. Jun. 2024	05. Jul. 2024	Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch. Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in CHF-abgesichert Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in EUR-abgesichert Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in GBP-abgesichert Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch. Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in CHF-abgesichert Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in EUR-abgesichert Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in GBP-abgesichert Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch. Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in CHF-abgesichert Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in EUR-abgesichert Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in GBP-abgesichert	23,92 143,18 158,41 153,26 26,19 157,75 174,33 168,84 1.547,12 162,45 179,19 25.697,34	USD CHF EUR GBP USD CHF EUR GBP USD CHF EUR GBP	1,443647 1,300301 1,448930 1,391588 1,564348 1,419411 1,580837 1,518454 1,600277 1,457489 1,620780 1,558127
12. Jul. 2024	19. Jul. 2024	26. Jul. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch. Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch. Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	7.821,25 2.373,68 4.729,53	USD USD SGD	7,046109 8,303079 10,719700
09. Aug. 2024	16. Aug. 2024	23. Aug. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch. Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch. Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	19.668,83 2.540,23 5.045,51	USD USD SGD	7,538087 8,885354 11,430707
13. Sep. 2024	20. Sep. 2024	27. Sep. 2024	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse A Aussch. Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch. Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F Aussch., in SGD abgesichert Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF Aussch. Schroder GAIA Cat Bond, Klasse PI Aussch. Schroder GAIA Cat Bond, Klasse PI, Aussch., in GBP-abgesichert	36.322,51 3.003,94 6.329,06 483.282,00 4.668.631,13 2.770.922,11	USD USD SGD USD USD GBP	8,896230 10,506948 13,532894 34,648490 90,810690 8,662257
27. Sep. 2024	30. Sep. 2024	07. Okt. 2024	Schroder GAIA BlueTrend, Klasse C, Aussch., in GBP-abgesichert Schroder GAIA BlueTrend, Klasse E, Aussch., in GBP-abgesichert Schroder GAIA Helix, Klasse S, Aussch. Schroder GAIA Helix, Klasse S, Aussch., in EUR abgesichert Schroder GAIA Helix, Klasse S, Aussch., in GBP abgesichert Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch. Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in CHF-abgesichert Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in EUR-abgesichert Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2 Aussch., in GBP-abgesichert Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch. Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in CHF-abgesichert	56.559,91 279.806,57 126,37 733,84 5.010,18 25,16 146,21 162,75 157,22 27,40 161,14	GBP GBP USD EUR GBP USD CHF EUR GBP USD CHF	2,280214 2,341818 8,561766 7,066298 7,250412 1,497527 1,310007 1,468341 1,408246 1,612652 1,428530

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Ausschüttungen (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungs-datum	Teilfonds	Bruttoaus-schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in EUR-abgesichert	179,44	EUR	1,603013
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C Aussch., in GBP-abgesichert	173,38	GBP	1,536416
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch.	2.509,77	USD	1,648290
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in CHF-abgesichert	165,83	CHF	1,465311
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in EUR-abgesichert	184,43	EUR	1,642767
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E Aussch., in GBP-abgesichert	22.903,19	GBP	1,572788

Gegenseitige Anlagen der Teilfonds

Zum 30. September 2024 belaufen sich die gegenseitigen Anlagen der Teilfonds auf insgesamt 10.499.933 EUR, daher würde der kombinierte Gesamt-NIW am Jahresende ohne gegenseitige Anlagen 5.750.293.556 EUR betragen. Die Einzelheiten zu den gegenseitigen Anlagen der Teilfonds sind in der folgenden Tabelle angegeben:

Anlage	Währung des Teilfonds	Marktwert	% des Nettovermögens
Schroder GAIA Helix		11.688.000	3,81
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	USD	11.688.000	3,81

Änderungen in den Teilfonds

Eine Auflistung sämtlicher Käufe und Verkäufe aller Teilfonds, die während des Berichtsjahres durchgeführt wurden, ist auf Anfrage kostenlos beim Sitz der Gesellschaft erhältlich.

Wechselkurs

Der folgende Wechselkurs wurde für die Berechnung des im Abschluss zum 30. September 2024 in EUR ausgewiesenen Gesamtbetrags verwendet:

1 Euro = 1,11315 US-Dollar

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

1. Neue Anteilklassen

Nach dem Berichtsjahr wurden die folgenden Anteilklassen aufgelegt:

Teilfonds und Anteilkasse	Währung der Anteilkasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Cat Bond			
Klasse Y5 Thes.	USD	USD	25. Oktober 2024
Klasse Y5 Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	25. Oktober 2024
Klasse Y5 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	25. Oktober 2024
Klasse Y5 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	25. Oktober 2024
Klasse Y5 Aussch.	USD	USD	25. Oktober 2024
Klasse Y5 Aussch., in GBP abgesichert	GBP	USD	25. Oktober 2024

2. Auflösungen von Anteilklassen

Nach dem Berichtsjahr wurden die folgenden Anteilklassen aufgelöst:

Teilfonds und Anteilkasse	Währung der Anteilkasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflösungsdatum
Schroder GAIA Helix			
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	28. Oktober 2024
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	SGD	USD	28. Oktober 2024
Klasse C1 Thes.	USD	USD	28. Oktober 2024
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	JPY	USD	28. Oktober 2024

3. Wesentliche Ereignisse nach dem Geschäftsjahr

Der Hurrikan Milton („Milton“) bildete sich im westlichen Golf von Mexiko und zog als Kategorie-5-Sturm nach Osten, bevor er nach Nordosten in Richtung Florida und der Tampa Bay Area drehte. Milton traf am 9. Oktober 2024 als Kategorie-3-Sturm in der Nähe von Siesta Key in Florida an Land und durchquerte die Florida-Halbinsel in nordöstlicher Richtung als Kategorie-1-Sturm. Die Auswirkungen von Milton auf den Teilfonds GAIA Cat Bond waren unerheblich, mit einem Rückgang des Anlagewerts um weniger als 1 %.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW	Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Asian Equity Long Short					
Klasse A Thes.	11	0,66 %	Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse C Thes.	3.748	0,58 %	Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse E Thes.	0	0,00 %	Klasse IF Aussch.	n. z. #	n. z. #
Klasse E Thes. EUR	0	0,00 %	Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	247.710	0,90 %
Klasse I Thes.	n. z. #	n. z. #	Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	557.356	1,13 %
Klasse IZ Thes.	15	0,89 %	Klasse PI Aussch.	682.919	1,27 %
Klasse IZ Thes. EUR	1	0,04 %	Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	472.351	1,33 %
Klasse X1 Thes.	239	0,02 %	Klasse X Thes.	n. z. #	n. z. #
Klasse X1 Thes. EUR	4	0,03 %	Klasse X Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse X1 Thes. GBP	6	0,00 %	Klasse X Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse X1 Thes., in GBP abgesichert	3.645	0,02 %	Klasse Y Thes.	n. z. #	n. z. #
Schroder GAIA BlueTrend					
Klasse A Thes.	0	0,00 %	Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse Y1 Thes.	n. z. #	n. z. #
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse C Thes.	0	0,00 %	Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	5.461	0,02 %	Klasse Y2 Thes.	n. z. #	n. z. #
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	n. z. #	n. z. #
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00 %			
Klasse E Thes.	0	0,00 %			
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %			
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00 %			
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %			
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %			
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	0	0,00 %			
Schroder GAIA Cat Bond					
Klasse A Thes.	n. z. #	n. z. #			
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse A Aussch.	n. z. #	n. z. #			
Klasse C Thes.	n. z. #	n. z. #			
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse F Thes.	n. z. #	n. z. #			
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse F Aussch.	n. z. #	n. z. #			
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse I Thes.	n. z. #	n. z. #			
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse IF Thes.	n. z. #	n. z. #			
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)					
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse IF Aussch.	n. z. #	n. z. #			
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	247.710	0,90 %			
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	557.356	1,13 %			
Klasse PI Aussch.	682.919	1,27 %			
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	472.351	1,33 %			
Klasse X Thes.	n. z. #	n. z. #			
Klasse X Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse Y Thes.	n. z. #	n. z. #			
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse Y1 Thes.	n. z. #	n. z. #			
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse Y2 Thes.	n. z. #	n. z. #			
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	n. z. #	n. z. #			
Schroder GAIA Contour Tech Equity					
Klasse A Thes.	758.865	5,43 %			
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	17.195	4,13 %			
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	158.791	4,53 %			
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	34.438	5,48 %			
Klasse A1 Thes.	32.560	4,65 %			
Klasse C Thes.	4.864.520	6,20 %			
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	163.969	0,82 %			
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	113.822	4,15 %			
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1.971.363	5,05 %			
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	2.720.960	5,56 %			
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	361.171	5,31 %			
Klasse E Thes.	38.334	6,54 %			
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	5.588	3,53 %			
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	161.411	5,27 %			
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	1.194	5,63 %			
Schroder GAIA Egerton Equity					
Klasse A Thes.	1.434.478	2,61 %			
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	58.798	2,71 %			
Klasse A Thes., in USD abgesichert	2.061.343	2,87 %			
Klasse A Aussch. GBP	11.339	2,41 %			
Klasse A1 Thes.	40.307	2,43 %			
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	501.666	2,64 %			
Klasse C Thes.	4.667.079	3,00 %			
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	721.890	3,10 %			
Klasse C Thes., in USD abgesichert	3.656.866	3,32 %			
Klasse C Aussch.	40.759	3,08 %			

Performancegebühr wird der Anteilsklasse nicht berechnet.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2024 (Forts.)

An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren pro Anteilsklasse (Forts.)

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performance-gebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW	Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performance-gebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)					
Klasse C Aussch. GBP	24.540	3,00 %	Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	11.694	0,55 %
Klasse E Thes.	74	2,52 %	Klasse R3 Thes.	799.576	1,07 %
Klasse X Thes.	52.692	2,07 %	Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Schroder GAIA Helix					
Klasse A Thes.	0	0,00 %	Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	654	0,00 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	60.038	0,73 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	587	0,15 %
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	0	0,00 %	Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	4.611	0,07 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	0	0,00 %			
Klasse C Thes.	0	0,00 %			
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %			
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %			
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %			
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	0	0,00 %			
Klasse C1 Thes.	0	0,00 %			
Klasse E Thes.	0	0,00 %			
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %			
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %			
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %			
Klasse I Thes.	n. z.*	n. z.*			
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	n. z.*	n. z.*			
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %			
Klasse S Aussch.	0	0,00 %			
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0	0,00 %			
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00 %			
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %			
Schroder GAIA SEG US Equity					
Klasse C Thes.	64.456	3,33 %			
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	2.671	3,18 %			
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	59.908	3,05 %			
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	210.165	3,65 %			
Klasse IZ Thes.	280.424	6,32 %			
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	3.422	2,75 %			
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	183.315	6,07 %			
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	549	3,97 %			
Klasse K Thes.	62	3,79 %			
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	341	2,83 %			
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	394	3,38 %			
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	519	3,77 %			
Klasse R1 Thes.	64.652	0,93 %			
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	237	0,00 %			
Klasse R2 Thes.	557.399	1,28 %			
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %			
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	42.116	0,04 %			
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Klasse A Thes.	0	0,00 %			
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %			
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %			
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	0	0,00 %			
Klasse C Thes.	0	0,00 %			
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	0	0,00 %			
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %			
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %			
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %			
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %			
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %			
Klasse E Thes.	0	0,00 %			
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %			
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %			
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %			

Für den Schroder GAIA Oaktree Credit wird keine Performancegebühr erhoben.

Performancegebühr wird der Anteilsklasse nicht berechnet.

Gesamtkostenquote („TER“) für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Asian Equity Long Short		Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)	
Klasse A Thes.	2,33 %	Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	1,33 %
Klasse C Thes.	1,39 %	Klasse IF Aussch.	1,33 %
Klasse E Thes.	1,20 %	Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	0,62 %
Klasse E Thes. EUR	1,16 %	Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	0,62 %
Klasse I Thes.	0,15 %	Klasse PI Aussch.	0,60 %
Klasse IZ Thes.	1,14 %	Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	0,62 %
Klasse IZ Thes. EUR	1,09 %	Klasse X Thes.	0,90 %
Klasse X1 Thes.	1,00 %	Klasse X Thes., in CHF abgesichert	0,91 %
Klasse X1 Thes. EUR	0,99 %	Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0,91 %
Klasse X1 Thes. GBP	1,00 %	Klasse Y Thes.	1,07 %
Klasse X1 Thes., in GBP abgesichert	1,01 %	Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	1,11 %
		Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	1,10 %
		Klasse Y1 Thes.	1,46 %
Schroder GAIA BlueTrend		Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	1,51 %
Klasse A Thes.	2,00 %	Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	1,51 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,03 %	Klasse Y2 Thes.	0,50 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,03 %	Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	0,53 %
Klasse C Thes.	1,40 %	Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	0,53 %
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,43 %	Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	0,53 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,43 %		
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,43 %		
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,43 %		
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,43 %		
Klasse E Thes.	1,40 %		
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,43 %		
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	1,43 %		
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	1,43 %		
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	1,43 %		
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	1,46 %		
Schroder GAIA Cat Bond		Schroder GAIA Contour Tech Equity	
Klasse A Thes.	1,78 %	Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	1,82 %	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,47 %
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	1,83 %	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,46 %
Klasse A Aussch.	1,96 %	Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,46 %
Klasse C Thes.	1,38 %	Klasse A1 Thes.	2,93 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,40 %	Klasse C Thes.	1,68 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,41 %	Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,78 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,40 %	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,72 %
Klasse F Thes.	1,73 %	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,71 %
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	1,74 %	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,72 %
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	1,74 %	Klasse C Thes., in SEK abgesichert	1,71 %
Klasse F Aussch.	1,73 %	Klasse E Thes.	1,43 %
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	1,74 %	Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,47 %
Klasse I Thes.	0,15 %	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,46 %
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	0,16 %	Klasse E Thes., in SEK abgesichert	1,47 %
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	0,16 %		
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,15 %		
Klasse IF Thes.	1,33 %		
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	1,32 %		
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	1,34 %		
Schroder GAIA Egerton Equity			
Klasse A Thes.	2,44 %		
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	2,47 %		
Klasse A Thes., in USD abgesichert	2,47 %		
Klasse A Aussch. GBP	2,45 %		
Klasse A1 Thes.	2,94 %		
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	2,97 %		
Klasse C Thes.	1,69 %		
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,72 %		
Klasse C Thes., in USD abgesichert	1,72 %		
Klasse C Aussch.	1,69 %		
Klasse C Aussch. GBP	1,69 %		
Klasse E Thes.	1,63 %		
Klasse X Thes.	1,59 %		

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

Gesamtkostenquote („TER“) für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Helix		Schroder GAIA SEG US Equity	
Klasse A Thes.	2,44 %	Klasse C Thes.	1,70 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,47 %	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,70 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,47 %	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,70 %
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	2,45 %	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,70 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,48 %	Klasse IZ Thes.	1,40 %
Klasse C Thes.	1,39 %	Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	1,44 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,43 %	Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	1,43 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,42 %	Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	1,43 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,42 %	Klasse K Thes.	2,14 %
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	1,12 %	Klasse K Thes., in CHF abgesichert	2,20 %
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	1,41 %	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	2,20 %
Klasse C1 Thes.	1,35 %	Klasse K Thes., in GBP abgesichert	2,20 %
Klasse E Thes.	1,00 %	Klasse R1 Thes.	2,00 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0,97 %	Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	2,00 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,00 %	Klasse R2 Thes.	1,45 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	1,00 %	Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	1,45 %
Klasse I Thes.	0,16 %	Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	1,45 %
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,11 %	Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	1,45 %
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	1,16 %	Klasse R3 Thes.	1,56 %
Klasse S Aussch.	0,59 %	Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	1,59 %
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0,64 %	Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	1,57 %
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0,63 %	Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	1,56 %
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0,78 %	Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	2,60 %
		Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	1,32 %
Schroder GAIA Oaktree Credit		Schroder GAIA Sirios US Equity	
Klasse A2 Thes.	1,56 %	Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	1,59 %	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,47 %
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	1,59 %	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,46 %
Klasse A2 Aussch.	1,53 %	Klasse C Thes.	1,68 %
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	1,58 %	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,71 %
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	1,58 %	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,71 %
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	1,58 %	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes.	1,06 %	Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,09 %	Klasse E Thes.	1,38 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,08 %	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,41 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,07 %	Klasse X Thes.	1,50 %
Klasse C Aussch.	1,02 %	Klasse X Thes., in EUR abgesichert	1,60 %
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	1,08 %		
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	1,07 %		
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,08 %		
Klasse E Thes.	0,90 %		
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0,94 %		
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0,93 %		
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0,96 %		
Klasse E Aussch.	0,95 %		
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	0,93 %		
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	0,92 %		
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	0,93 %		
Klasse I Thes.	0,15 %		
		Schroder GAIA Two Sigma Diversified	
		Klasse C Thes.	1,83 %
		Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,91 %
		Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,86 %
		Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,86 %
		Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,86 %
		Klasse K Thes.	2,33 %
		Klasse K Thes., in CHF abgesichert	2,36 %
		Klasse K Thes., in EUR abgesichert	2,36 %

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

Gesamtkostenquote („TER“)[▲] für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Wellington Pagosa	
Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,47 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,47 %
Klasse C Thes.	1,68 %
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,71 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,71 %
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	1,72 %
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	1,71 %
Klasse E Thes.	1,18 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,22 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,22 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	1,21 %

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

Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)

1. Commitment-Ansatz

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

Fonds

Schroder GAIA Sirios US Equity

Schroder GAIA Cat Bond

Schroder GAIA Oaktree Credit

2. Absoluter VaR-Ansatz

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

Fonds

Schroder GAIA Asian Equity Long Short

Schroder GAIA BlueTrend

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Schroder GAIA Egerton Equity

Schroder GAIA Helix

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Schroder GAIA SEG US Equity

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Ausschöpfung des regulatorischen VaR-Limits

Teilfonds	Niedrigstes	Höchstes	Durchschnitt	Durchschnittliche Hebelung
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	7,17 %	17,80 %	13,36 %	215,42 %
Schroder GAIA BlueTrend	15,49 %	55,14 %	34,94 %	1603,20 %
Schroder GAIA Contour Tech Equity	25,05 %	39,94 %	33,03 %	145,84 %
Schroder GAIA Egerton Equity	25,70 %	34,18 %	30,01 %	133,16 %
Schroder GAIA Helix	8,33 %	15,03 %	11,13 %	604,99 %
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	23,05 %	39,15 %	28,03 %	703,19 %
Schroder GAIA SEG US Equity	35,92 %	52,93 %	44,77 %	127,83 %
Schroder GAIA Wellington Pagosa	5,63 %	9,67 %	7,03 %	816,40 %

Angaben zum VaR-Modell

Teilfonds	Modelltyp	Konfidenzintervall	Haltestdauer	Beobachtungszeitraum
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	Parameter-Simulation	99 %	1 Monat	1 Jahr
Schroder GAIA BlueTrend	MonteCarlo-Simulation	99 %	1 Monat	1 Jahr
Schroder GAIA Contour Tech Equity	MonteCarlo-Simulation	99 %	1 Monat	3 Jahre
Schroder GAIA Egerton Equity	MonteCarlo-Simulation	99 %	1 Monat	3 Jahre
Schroder GAIA Helix	Parameter-Simulation	99 %	1 Monat	1 Jahr
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	MonteCarlo-Simulation	99 %	1 Monat	3 Jahre
Schroder GAIA SEG US Equity	MonteCarlo-Simulation	99 %	1 Monat	3 Jahre
Schroder GAIA Wellington Pagosa	MonteCarlo-Simulation	99 %	1 Monat	3 Jahre

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

OGAW-Vergütungsangaben für die Schroder Investment Management Europe S.A. („SIM Europe“) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023

Diese Angaben sind Bestandteil des ungeprüften Teils dieses Jahresberichts und sollten in Verbindung mit dem Vergütungsbericht der Schroders plc auf den Seiten 74 bis 93 des Jahresberichts und Abschlusses für 2023 (verfügbar auf der Website – www.schroders.com/ir) gelesen werden, der weitere Informationen zu den Aktivitäten unseres Vergütungsausschusses und zu unseren Vergütungsgrundsätzen und -richtlinien bietet.

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

Der Vergütungsausschuss der Schroders plc hat eine Vergütungsrichtlinie aufgestellt, um sicherzustellen, dass die Anforderungen der OGAW-Richtlinie für alle OGAW-MRTs eingehalten werden. Der Vergütungsausschuss und der Verwaltungsrat der Schroders plc prüfen die Vergütungsstrategie mindestens jährlich. Der Verwaltungsrat der SIM Europe ist für die Verabschiedung der Vergütungspolitik und die regelmäßige Überprüfung ihrer Umsetzung in Bezug auf die SIM Europe verantwortlich. Die Vergütungspolitik wurde im Jahr 2023 überprüft, um sicherzustellen, dass sie mit den OGAW/AIFMD-Vergütungsanforderungen konform ist, und es wurden keine erheblichen Änderungen vorgenommen.

Die Umsetzung der Vergütungsrichtlinie unterliegt mindestens einmal jährlich einer unabhängigen internen Prüfung der Einhaltung der vom Verwaltungsrat der SIM Europe und vom Vergütungsausschuss eingeführten Vergütungsrichtlinien und -verfahren. Die letzte Überprüfung ergab keine grundlegenden Probleme, aber es wurden kleinere Empfehlungen zur Richtliniendokumentation ausgesprochen.

Unser Verhältnis zwischen den operativen Vergütungskosten und dem Nettobetriebsergebnis gibt die jährlichen Gesamtausgaben für Vergütungen vor. Dies empfiehlt der Vergütungsausschuss dem Verwaltungsrat von Schroders plc. Dieser Ansatz richtet die Vergütung an der finanziellen Performance von Schroders aus. Im Rahmen der Bestimmung der Vergütungsausgaben für jedes Jahr werden die zugrunde liegende Stärke und Nachhaltigkeit des Unternehmens sowie Berichte zu Risiko und Compliance sowie Rechts- und Innenrevisionsangelegenheiten von den Leitern dieser Bereiche berücksichtigt.

Die nachstehenden Vergütungsdaten spiegeln die im Jahr 2023 gezahlten leistungsabhängigen Vergütungen wider.

- Der Gesamtbetrag der von der SIM Europe an ihre 342 Mitarbeiter gezahlten Vergütung belief sich auf 57,71 Mio. EUR, wovon 40,07 Mio. EUR auf Festvergütungen (z. B. Gehälter, Sachleistungen) und 17,64 Mio. EUR auf variabel Vergütungen (z. B. Jahresbonuszahlungen oder aufgeschobene Bonuszahlungen) entfielen. Mitarbeiter anderer Unternehmen der Schroders-Gruppe, die im Verwaltungsrat der SIM Europe sitzen, erhalten für ihre Rolle als Verwaltungsratsmitglieder der SIM Europe keine zusätzliche Vergütung.
- Die nachstehenden Angaben beziehen sich auf OGAW-MRTs der SIM Europe. Die meisten dieser OGAW-MRTs waren bei anderen Unternehmen der Schroders-Gruppe beschäftigt. Dazu gehören auch Anlageverwaltungsdienste oder andere Aufgaben, die von der SIM Europe an andere Unternehmen der Schroders-Gruppe oder Dritte übertragen wurden. Viele dieser OGAW-MRTs erbringen Leistungen für andere Unternehmen der Schroders-Gruppe und andere Kunden. Im Interesse der Transparenz spiegeln die nachstehenden Gesamtvergütungszahlen die vollständige Vergütung für jeden OGAW-MRT der SIM Europe wider. Die an die 237 OGAW-MRTs der SIM Europe in Bezug auf das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2023 gezahlte und der SIM Europe oder den von ihr verwalteten OGAW-Fonds zugerechnete Gesamtvergütung beträgt 177,70 Mio. EUR, wovon 51,24 Mio. EUR an Mitglieder der oberen Führungsebene, 123,80 Mio. EUR an MRTs, die Risiken für die SIM Europe oder die von ihr verwalteten OGAW-Fonds übernehmen, und 2,64 Mio. EUR an andere OGAW-MRTs, einschließlich MRTs mit Kontrollfunktionen, gezahlt wurden. Diese Gesamtvergütungswerte umfassen Beträge, die ggf. von Beauftragten gezahlt wurden.

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

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)

Die Teilfonds gehen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte ein (Securities Financing Transactions, SFT) (gemäß Definition in Artikel 3 der EU-Verordnung 2015/2365; hiernach umfassen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte unter anderem Pensionsgeschäfte, das Ver- oder Entleihen von Wertpapieren oder Rohstoffen, Buy-Sell-Back-Geschäfte oder Sell-Buy-Back-Geschäfte sowie Lombardgeschäfte). Gemäß Artikel 13 der Verordnung ist die Beteiligung der Teilfonds in Verbindung mit ihrem Engagement in Total-Return-Swaps für das Geschäftsjahr zum 30. September 2024 nachfolgend detailliert aufgeführt:

Schroder GAIA Egerton Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
6.977.364	1,42 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
8.703.382	1,77 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt EUR	% des verwalteten Vermögens
15.680.746	3,19 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2024 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen EUR
Morgan Stanley	5.754.213
Merrill Lynch	4.293.397
J.P. Morgan	2.932.378
Goldman Sachs	2.700.758
	15.680.746

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen EUR	Short-Positionen EUR	Summe EUR
Weniger als 1 Tag	–	–	–
1 bis 7 Tage	–	–	–
1 bis 4 Wochen	–	572.975	572.975
1 bis 3 Monate	–	166.445	166.445
3 bis 12 Monate	5.805.418	6.158.775	11.964.193
Mehr als 1 Jahr	1.171.946	1.805.187	2.977.133
Unbegrenzte Laufzeit	–	–	–
	6.977.364	8.703.382	15.680.746

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert EUR
Getrennt	14.306.902
Gepoolt	-
Andere	-
14.306.902	

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

Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Nettogewinne aus Swaps“, „Nettoverluste aus Swaps“, „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps“ ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teifonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut - in Teifondswährung
An den Teifonds	16.033.326

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Helix

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
33	0,00 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
20.518.371	6,68 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
20.518.404	6,68 %

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2024 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
J.P. Morgan	13.131.307
Goldman Sachs	6.475.211
Barclays Bank	859.983
Morgan Stanley	51.903
	20.518.404

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	33	30	63
3 bis 12 Monate	-	20.518.341	20.518.341
Mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	33	20.518.371	20.518.404

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	6.180.000
Gepoolt	-
Andere	-
	6.180.000

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

Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Nettогewinne aus Swaps“, „Nettoverluste aus Swaps“, „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps“ ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teifonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut – in Teifondswährung
An den Teifonds	103.847.144

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Sirios US Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
1.540.410	0,73 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
4.864.134	2,32 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
6.404.544	3,05 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2024 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Merrill Lynch	3.374.701
Goldman Sachs	2.114.284
Morgan Stanley	639.818
Barclays Bank	275.741
	6.404.544

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

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	132.801	132.801
1 bis 3 Monate	175.614	748.658	924.272
3 bis 12 Monate	995.827	3.207.880	4.203.707
Mehr als 1 Jahr	368.969	774.795	1.143.764
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	1.540.410	4.864.134	6.404.544

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	770.000
Gepoolt	-
Andere	-
770.000	

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

Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Nettogewinne aus Swaps“, „Nettoverluste aus Swaps“, „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps“ ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teilfonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut – in Teifondswährung
An den Teilfonds	8.354.417

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
5.568.297	1,53 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
-	-
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
5.568.297	1,53 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2024 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	5.568.297
	5.568.297

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	5.568.297	-	5.568.297
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	-	-	-
Mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	5.568.297	-	5.568.297

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Morgan Stanley	USA

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	1.240.214
Gepoolt	-
Andere	-
1.240.214	

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

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

Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Nettогewinne aus Swaps“, „Nettoverluste aus Swaps“, „Realisierter Nettогewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps“ ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teilfonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut – in Teilfondswährung
An den Teilfonds	89.447.839

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
4.204.550	1,41 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
4.712.975	1,58 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
8.917.525	2,99 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2024 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	4.186.091
J.P. Morgan	3.226.308
Goldman Sachs	1.505.126
8.917.525	

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

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	-	-	-
Mehr als 1 Jahr	4.204.550	4.712.975	8.917.525
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	4.204.550	4.712.975	8.917.525

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Gestellte Sicherheiten

Zum 30. September 2024 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

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

Rendite und Kosten

Die nachstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung sowie in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens unter „Nettogewinne aus Swaps“, „Nettoverluste aus Swaps“, „Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps“ und „Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps“ ausgewiesen. Alle Renditen aus Total Return Swaps sind dem Teilfonds zurechenbar und unterliegen keinen Vereinbarungen über die Verteilung von Renditen.

	Total Return Swaps Absolut – in Teilvermögenswährung
An den Teilfonds	11.643.078

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft)

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

Name des Produkts: Schroder GAIA Cat Bond

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300MYKDUYVX3W6F39

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder sozialen Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?			
• •	□ Ja	• •	□ Nein
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: __ %	<input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben , und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es __ % an nachhaltigen Investitionen		
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind		
<input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind	<input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind		
	<input type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel		
<input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: __ %	<input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt		

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

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



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

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

- mindestens 80 % seines Vermögens in Anlagen im Zusammenhang mit Naturkatastrophen und/oder Lebensrisiken mit dem Ziel, die negativen Folgen solcher Ereignisse zu verringern, zum Wiederaufbau von Volkswirtschaften und Gesellschaften nach einem solchen Ereignis beizutragen und damit deren künftige Widerstandsfähigkeit zu erhöhen;
- mindestens 50 % seines Vermögens in Anlagen im Zusammenhang mit meteorologischen Risiken, um die negativen Folgen solcher Ereignisse zu verringern, zum Wiederaufbau von Volkswirtschaften und Gesellschaften nach einem solchen Ereignis beizutragen und damit deren künftige Widerstandsfähigkeit zu erhöhen sowie möglicherweise die negativen Folgen des Klimawandels zu mildern;
- mindestens 5 % seines Vermögens in Anlagen, die dazu bestimmt sind, die Nichtverfügbarkeit eines bezahlbaren Versicherungsschutzes gegen Naturkatastrophen zu beheben.

Der Fonds wies außerdem basierend auf dem Ratingsystem des Anlageverwalters einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert auf.

Der Nachhaltigkeitswert wird von einem proprietären Tool von Schroders gemessen, das eine aggregierte Schätzung der sozialen oder ökologischen Kosten und des sozialen oder ökologischen Nutzens bietet, die ein Emittent verursachen könnte. Dazu wird der Emittent anhand einer Liste von Indikatoren bewertet – die Bewertungen können positiv sein (z. B. wenn ein Emittent mehr als den durchschnittlichen existenzsichernden Lohn zahlt) oder negativ (z. B. wenn ein Emittent Kohlenstoff emittiert). Dabei werden sowohl Daten Dritter als auch eigene Schätzungen und Annahmen von Schroders verwendet, und das Ergebnis kann von anderen Nachhaltigkeitstools und -kennzahlen abweichen.

Das Ergebnis wird als Gesamtwert der Nachhaltigkeitsindikatoren für jeden Emittenten ausgedrückt, konkret als fiktiver Prozentsatz (positiv oder negativ) des Umsatzes oder des BIP des jeweiligen Emittenten. Ein Wert von +2 % würde beispielsweise bedeuten, dass je 100 US-Dollar Umsatz oder BIP, die der Emittent generiert, ein positiver Nettobeitrag für die Gesellschaft und/oder die Umwelt von 2 US-Dollar erbracht würde. Der Nachhaltigkeitswert des Fonds ergibt sich aus den Bewertungen aller zulässigen Emittenten im Portfolio des Fonds, die anhand des proprietären Tools von Schroders ermittelt werden.

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

Der Referenzzeitraum für diesen Fonds ist der Zeitraum zwischen 1. Oktober 2023 und 30. September 2024.

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

• **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Der Anlageverwalter überwachte die Einhaltung des Merkmals, um mindestens wie folgt zu investieren: 80 % seines Vermögens in mit Naturkatastrophen und/oder Lebensrisiken verbundene Anlagen; 50 % seines Vermögens in mit meteorologischen Risiken verbundene Anlagen; und 5 % seines Vermögens in Anlagen, die dazu bestimmt sind, die Nichtverfügbarkeit eines bezahlbaren Versicherungsschutzes gegen Naturkatastrophen zu beheben, durch den Einsatz eines Betriebssystems eines Drittanbieters für Anlageexperten, das von einem internen Portfolio-Compliance-Team überwacht wird.

Der positive absolute Nachhaltigkeitswert des Fonds für den Referenzzeitraum betrug 0,7 %. Dies bedeutet, dass der gewichtete Durchschnittswert des Fonds auf Basis der zum Monatsende verfügbaren Daten über einen gleitenden Sechsmonatszeitraum bis zum Ende des Referenzzeitraums höher als null war.

Der Nachhaltigkeitswert wird wie oben beschrieben berechnet.

Während des Referenzzeitraums handelte es sich bei den Top-5-Indikatoren im proprietären Tool von Schroders, die positiv zum Nachhaltigkeitswert des Fonds beitrugen, um folgende:

- Bildung: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen der Bildungsausgaben eines Landes pro Kind im Schulalter;
- Finanzielle Inklusion: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen der Bereitstellung von Finanzdienstleistungen für die lokale Bevölkerung. Zuweisung im Verhältnis zum Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz;
- Hohe Löhne/Gehälter: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen durch Bezahlung des Personals über dem örtlichen existenzsichernden Lohn (in den Regionen, in denen die Unternehmen tätig sind). Zuweisung im Verhältnis zum Differenzbetrag zwischen den von den Unternehmen gezahlten Löhnen und den durchschnittlichen existenzsichernden Löhnen vor Ort;
- Medizin: geschätzter gesellschaftlicher und gesamtwirtschaftlicher Nutzen durch das Angebot von medizinischen Produkten und Dienstleistungen. Berechnung nach dem Stellenwert des betreffenden Unternehmens innerhalb der Wertschöpfungskette des Gesundheitswesens und seinem weltweiten Marktanteil innerhalb des Teilesktors; und
- Gesellschaftspolitische Stabilität: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen, den ein politisch und sozial stabiles Land durch Unterstützung eines günstigen Umfelds für Unternehmen und eines attraktiven Investitionsklimas bieten kann, womit die Voraussetzungen für langfristiges Wirtschaftswachstum geschaffen werden.

Der Fonds wandte auch bestimmte Ausschlüsse an, deren Einhaltung der Anlageverwalter über seinen Portfolio-Compliance-Rahmen laufend überwachte.

• **... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?**

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

Nachhaltigkeitswert

Diese Tabelle zeigt die Entwicklung des Nachhaltigkeitswerts des Fonds gegenüber dem Vorjahr

Zeitraum	Fonds (%)
Okt. 2023 - Sep. 2024	0,7
Okt. 2022 - Sep. 2023	0,9
Okt. 2021 - Sep. 2022	0,8

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

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet, ist die Frage für diesen Fonds nicht relevant.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen** handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

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

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet, ist die Frage für diesen Fonds nicht relevant.

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

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

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

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

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

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

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

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



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

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

Aufgrund der Art der Vermögenswerte des Fonds, bei denen es sich um versicherungsgebundene Wertpapiere und derivative Finanzinstrumente handelt, die Katastrophenrisiken ausgesetzt sind, könnte der Anlageverwalter nur nachteilige Auswirkungen berücksichtigen, die für diese Anlageklasse maßgeblich sind. Der Anlageverwalter hat bestimmte Transaktionssponsoren und bestimmte Risikoklassen, die nach Ansicht des Anlageverwalters das Potenzial haben, erhebliche nachteilige Auswirkungen auf die Gesellschaft zu haben, von der Aufnahme in seine Portfolios ausgeschlossen.

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

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

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



Welche waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die 15 wichtigsten Investitionen im Bezugszeitraum waren:

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

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil der Investitionen** entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigten wurden: **1. Okt. 2023 bis 30. Sep. 2024**

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermögenswerte	Land
NAKAMA RE LTD 1 FRN 144A 6,5961 % 13. Okt. 2026	Finanzwesen	1,67	Singapur
TREASURY BILL SR GOVT 0 % 25. Apr. 2024	Treasuries	1,60	USA
YoussouRe_Jul_2023_Sidecar	Finanzwesen	1,55	Bermuda
TREASURY BILL SR GOVT 0% 15. Okt. 2024	Treasuries	1,39	USA
SUSSEX CAP UK PCC LTD 12,9619 % 08. Jan. 2025	Finanzwesen	0,95	Vereinigtes Königreich
LIGHTNING RE SERIES 2023 15,5461 % 31. Mrz. 2026	Finanzwesen	0,91	USA
FLOODSMART RE LTD 18,5461 % 12. Mrz. 2027	Finanzwesen	0,89	Bermuda
KILIMANJARO III RE LTD A FRN 144A 10,3883 % 25. Jun. 2025	Finanzwesen	0,84	Bermuda
FLOODSMART RE LTD 11,25% 25. Feb. 2025	Finanzwesen	0,82	Bermuda
MYSTIC RE IV LTD 16,5409 % 08. Jan. 2027	Finanzwesen	0,81	Bermuda
TREASURY BILL SR GOVT 0 % 23. Mai 2024	Treasuries	0,80	USA
SANDERS RE III LTD 10,2909 % 07. Apr. 2031	Finanzwesen	0,80	Bermuda
GATEWAY RE LTD 18,4983 % 24. Feb. 2026	Finanzwesen	0,79	USA
QUEEN STREET 2023 RE DAC A FRN 144A 12,1019 % 08. Dez. 2025	Finanzwesen	0,79	Irland
MERNA REINSURANCE II LTD 12,0683 % 07. Jul. 2025	Finanzwesen	0,76	Bermuda

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

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

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

Die Daten zu den größten Investitionen und Prozentanteilen der oben genannten Vermögenswerte stammen aus dem Schroders Investment Book of Record (IBOR). Die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht genannten größten Investitionen und prozentualen Anteile an Vermögenswerten sind dem Accounting Book of Record (ABoR) des Administrators entnommen. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen mit unterschiedlichen Berechnungsmethoden können Angaben zu den größten Investitionen und Prozentsätzen der Vermögenswerte geringfügig voneinander abweichen.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

• Wie sah die Vermögensallokation aus?

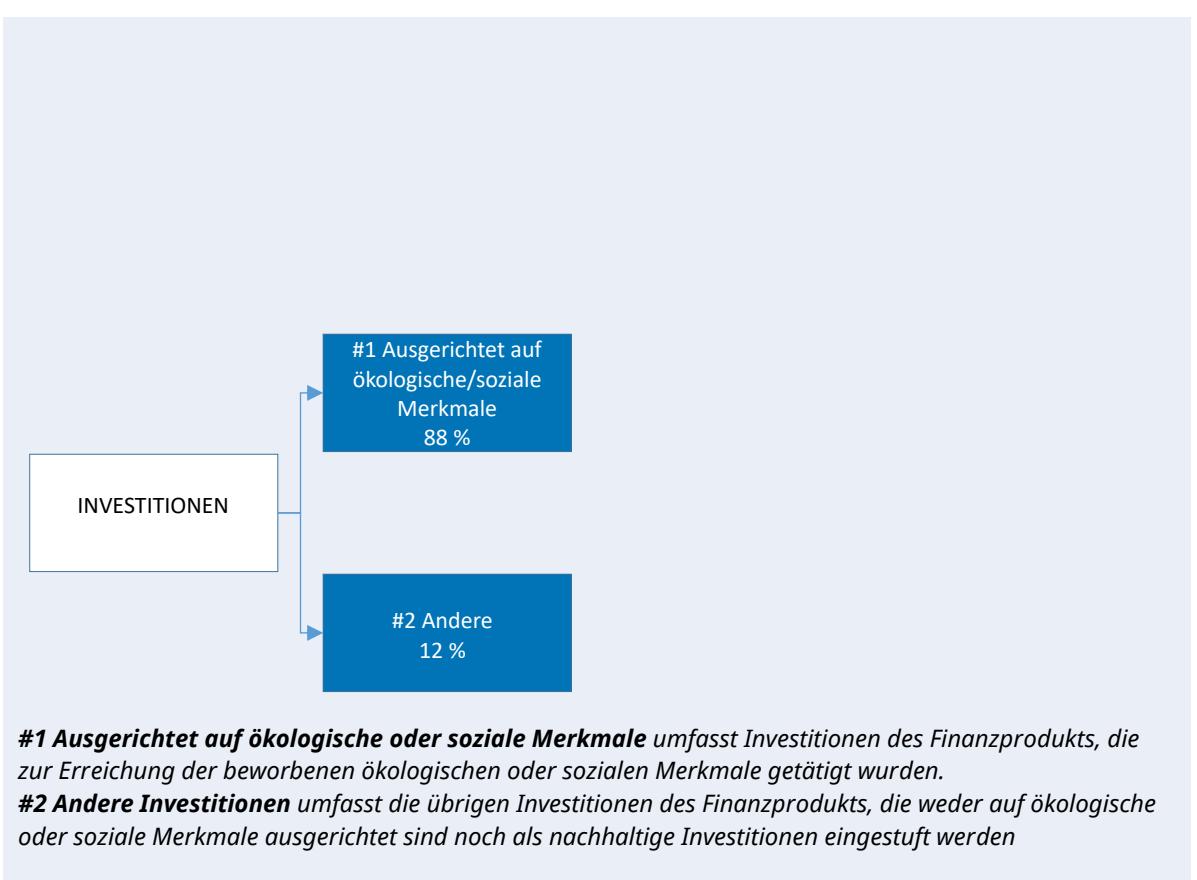
Die Anlagen des Fonds, die genutzt werden, um seine ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen, sind nachstehend zusammengefasst.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst den Anteil des Fondsvermögens, der zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale eingesetzt wird. Dieser Anteil beträgt 88 %. Dieser Prozentsatz entspricht dem Anteil der Vermögenswerte in Anlagen, die mit Naturkatastrophen und/oder Lebensrisiken verbunden sind, Anlagen, die mit meteorologischen Risiken verbunden sind, und Anlagen, die dazu bestimmt sind, die Nichtverfügbarkeit eines bezahlbaren Versicherungsschutzes gegen Naturkatastrophen zu beheben. Er basiert auf dem Durchschnitt der Bestände an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums.

Die **Vermögensallokation** definiert den Anteil der Anlagen in bestimmten Vermögenswerten.

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

#2 Andere Investitionen umfasst Barmittel, die nicht in Bezug auf Nachhaltigkeit bewertet werden. Zu #2 Andere Investitionen gehörten auch Investitionen, die nicht mit dem eigenen Nachhaltigkeitstool von Schroders bewertet wurden und somit nicht zum Nachhaltigkeitsscore des Fonds beitrugen.



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigten wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden

• In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigten?

Im Referenzzeitraum wurden Investitionen in folgenden Wirtschaftssektoren getätigten:

Sektor	Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Finanzwesen	Versicherung	86,43
Barmittel	Barmittel	8,61
Treasuries	Treasuries	3,79
Supranational	Supranational	1,18
Derivate	Devisenderivate	-0,01

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

Die obigen Angaben zu den auf die Sektoren entfallenden Prozentanteilen des Vermögens sind dem Schroders Investment Book of Record (IBOR) entnommen. Die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht genannten Prozentanteile des Vermögens an den Sektoren sind dem Accounting Book of Record (ABoR) des Administrators entnommen. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen mit unterschiedlichen Berechnungsmethoden können Angaben zu Prozentanteilen des Vermögens an einzelnen Sektoren geringfügig voneinander abweichen.

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



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

Es gab keine definierte Mindest-Taxonomieausrichtung der Anlagen des Fonds (einschließlich Übergangs- und ermögliche Tätigkeiten) mit Umweltziel. Die Taxonomieausrichtung der Investitionen dieses Fonds wurde daher nicht berechnet und wird mit 0 % des Fondspportfolios angegeben.

- **Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert¹?**

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Aktivitäten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*

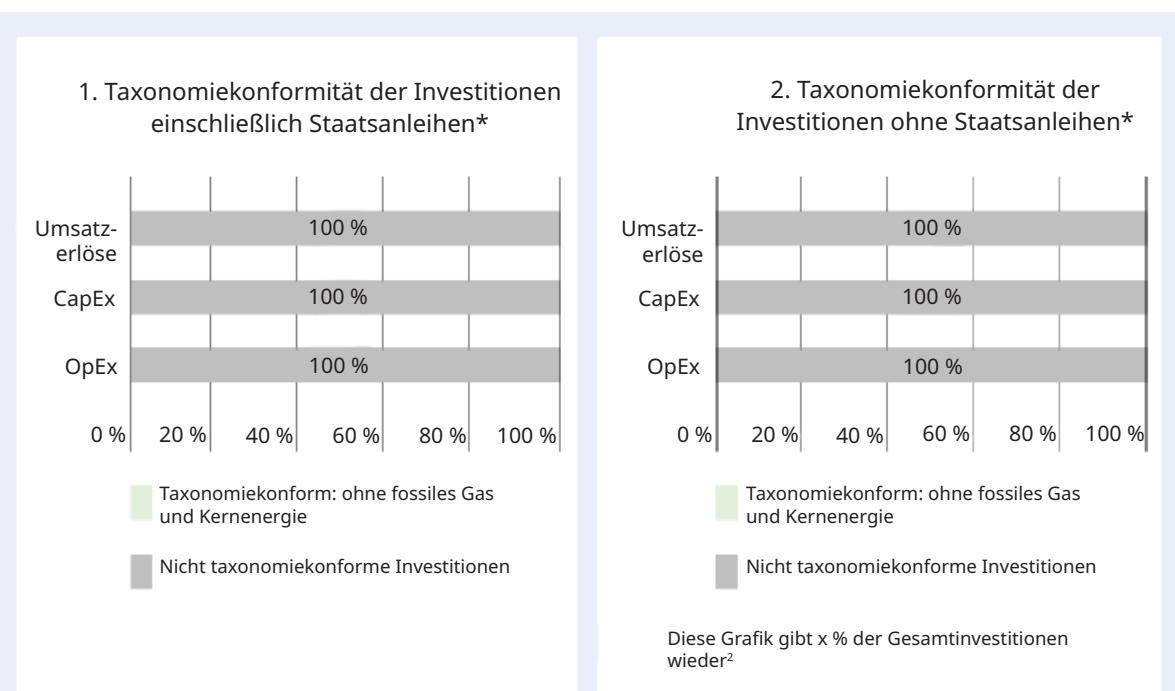
Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

- Investitionsausgaben

(CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

- Betriebsausgaben

(OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.



* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

²Da keine Taxonomiekonformität besteht, hat der Ausschluss von Staatsanleihen keine Auswirkungen auf das Diagramm (d. h. der Prozentsatz der Investitionen, die der Taxonomie entsprechen, bleibt bei 0 %) und die Verwaltungsgesellschaft ist daher der Ansicht, dass es nicht notwendig ist, diese Information anzugeben.

Ermöglichte Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichtend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten

Übergangstätigkeiten sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

• Wie hoch ist der Anteil der Investitionen, die in Übergangstätigkeiten und ermöglichte Tätigkeiten geflossen sind?

Wie oben beschrieben, wird der Anteil der Anlagen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichten Tätigkeiten mit 0 % des Fondsportfolios angenommen.

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

Diese Frage ist nicht relevant.

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



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



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

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet, ist die Frage für diesen Fonds nicht relevant.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Da sich der Fonds nicht zu nachhaltigen Investitionen verpflichtet, ist die Frage für diesen Fonds nicht relevant.



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

#2 Andere Investitionen umfasst Barmittel, die nicht in Bezug auf Nachhaltigkeit bewertet werden. Zu #2 Andere Investitionen gehörten auch Investitionen, die nicht mit dem eigenen Nachhaltigkeitstool von Schroders bewertet wurden und somit nicht zum Nachhaltigkeitsscore des Fonds beitrugen.

Mindestschutzregelungen wurden gegebenenfalls auf Geldmarktinstrumente und Derivate angewandt, die zur Risikominderung (Absicherung) verwendet wurden, oder auf andere Anlagen, indem (gegebenenfalls) Anlagen in Gegenparteien eingeschränkt wurden, die mit Ländern mit höherem Risiko (im Hinblick auf Geldwäsche, Terrorismusfinanzierung, Bestechung, Korruption, Steuerhinterziehung und Sanktionsrisiken) verbunden oder dort engagiert waren. Bei einer unternehmensweiten Risikobewertung wird die Risikoeinstufung der einzelnen Länder berücksichtigt; dabei wird auf eine Reihe von öffentlichen Erklärungen, Indizes und globale Staatsführungsindikatoren Bezug genommen, die von den Vereinten Nationen, der Europäischen Union, der britischen Regierung, der Financial Action Task Force und mehreren Nichtregierungsorganisationen (NRO) wie Transparency International und dem Basler Ausschuss herausgegeben wurden.

Darüber hinaus wurden neue Kontrahenten durch das Kreditrisikoteam von Schroders überprüft und die Zulassung eines neuen Kontrahenten basierte auf einer ganzheitlichen Prüfung der verschiedenen verfügbaren Informationsquellen, insbesondere zur Qualität des Managements, zur Eigentümerstruktur, zum Standort, zum aufsichtsrechtlichen und gesellschaftlichen Umfeld eines jeden Kontrahenten und zum Entwicklungsgrad des örtlichen Bankensystems sowie dessen aufsichtsrechtlichen Rahmenbedingungen. Die laufende Überwachung erfolgte über ein firmeneigenes Tool von Schroders, das die Analyse des Managements ökologischer, sozialer und unternehmensführungsbezogener Trends und Herausforderungen durch die Kontrahenten unterstützt.

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

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



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

Im Bezugszeitraum wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen:

- Der Anlageverwalter wandte bei der Auswahl der Anlagen für den Fonds Nachhaltigkeitskriterien an;
- Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Auswahl der vom Fonds gehaltenen Vermögenswerte die Nachhaltigkeitswerte des Fonds und der einzelnen Anlagen; und
- Der Anlageverwalter beurteilte die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung der Anlagen des Fonds.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Referenzbenchmarks sind Indizes, die messen, ob Finanzprodukte die ökologischen oder sozialen Merkmale, auf die sie abzielen, tatsächlich fördern.

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

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

Diese Frage ist nicht relevant.

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

Diese Frage ist nicht relevant.

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

Diese Frage ist nicht relevant.

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

Diese Frage ist nicht relevant.

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

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

Name des Produkts: Schroder GAIA Helix

Unternehmenskennung (LEI-Code): 549300HTRQHGX6XKWC51

Ökologische und/oder soziale Merkmale

Eine nachhaltige Investition ist eine Investition in eine Wirtschaftstätigkeit, die zur Erreichung eines Umweltziels oder sozialen Ziels beiträgt, vorausgesetzt, dass diese Investition keine Umweltziele oder soziale Ziele erheblich beeinträchtigt und die Unternehmen, in die investiert wird, Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?	
<input type="radio"/> ● <input type="checkbox"/> Ja	<input type="radio"/> ● <input checked="" type="checkbox"/> Nein
<p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: __ %</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: __ %</p>	
<p><input checked="" type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 63 % an nachhaltigen Investitionen</p> <p><input type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem Umweltziel in Wirtschaftstätigkeiten, die nach der EU-Taxonomie nicht als ökologisch nachhaltig einzustufen sind</p> <p><input checked="" type="checkbox"/> mit einem sozialen Ziel</p> <p><input type="checkbox"/> Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt</p>	

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

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



Der ausgewiesene Prozentsatz nachhaltiger Investitionen (bei denen es sich ausschließlich um Long-Positionen handelt, da Short-Positionen nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden) entspricht dem Anteil der nachhaltigen Anlagen am Long-Engagement des Fonds am Ende des Referenzzeitraums. Dies steht im Einklang mit den vorvertraglichen Informationen zu dem Fonds, in denen die Verpflichtung des Fonds festgelegt ist, mindestens 35 % seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen zu investieren.

Für zusätzlichen Kontext: Im Verhältnis zum Bruttoengagement des Fonds betrug der Anteil nachhaltiger Investitionen zum Ende des Bezugszeitraums 31 %. Das Bruttoengagement umfasst sowohl Kauf- als auch Verkaufspositionen, und dieser Wert wird aus Gründen der Kohärenz mit den anderen Berechnungen im nachstehenden Abschnitt über die Vermögensallokation angegeben.

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

Die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale wurden erfüllt. Der Fonds wies basierend auf dem Ratingsystem des Anlageverwalters einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert auf.

Der Nachhaltigkeitswert wird von einem proprietären Tool von Schroders gemessen, das eine aggregierte Schätzung der sozialen oder ökologischen Kosten und des sozialen oder ökologischen Nutzens bietet, die ein Emittent verursachen könnte. Dazu wird der Emittent anhand einer Liste von Indikatoren bewertet – die Bewertungen können positiv sein (z. B. wenn ein Emittent mehr als den durchschnittlichen existenzsichernden Lohn zahlt) oder negativ (z. B. wenn ein Emittent Kohlenstoff emittiert). Dabei werden sowohl Daten Dritter als auch eigene Schätzungen und Annahmen von Schroders verwendet, und das Ergebnis kann von anderen Nachhaltigkeitstools und -kennzahlen abweichen.

Das Ergebnis wird als Gesamtwert der Nachhaltigkeitsindikatoren für jeden Emittenten ausgedrückt, konkret als fiktiver Prozentsatz (positiv oder negativ) des Umsatzes oder des BIP des jeweiligen Emittenten. Ein Wert von +2 % würde beispielsweise bedeuten, dass je 100 US-Dollar Umsatz oder BIP, die der Emittent generiert, ein positiver Nettobeitrag für die Gesellschaft und/oder die Umwelt von 2 US-Dollar erbracht würde. Der Nachhaltigkeitswert des Fonds ergibt sich aus den Bewertungen aller zulässigen Emittenten im Portfolio des Fonds, die anhand des proprietären Tools von Schroders ermittelt werden. Die Long- und Short-Positionen des Fonds tragen unterschiedlich zum Gesamtwert bei. Long-Positionen mit positivem Wert und Short-Positionen mit negativem Wert tragen beide positiv zum Gesamtwert bei, während Long-Positionen mit negativem Wert und Short-Positionen mit positivem Wert beide dem Gesamtwert abträglich sind.

Der Fonds verwendete Derivate in großem Umfang, um seine Anlagestrategie umzusetzen und die vom Fonds beworbenen ökologischen und/oder sozialen Merkmale zu erfüllen. Long- und Short-Derivatepositionen trugen in unterschiedlicher Weise zum Gesamtnachhaltigkeitswert des Fonds bei. Aktien- und Indexderivate (ohne Optionen) werden in derselben Weise wie physische Positionen auf Look-through-Basis bewertet und trugen ebenfalls zum Gesamtnachhaltigkeitswert des Fonds bei.

Der Fonds investierte während des Referenzzeitraums außerdem mindestens 35 % seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen.

Der Referenzzeitraum für diesen Fonds ist der Zeitraum zwischen 1. Oktober 2023 und 30. September 2024.

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

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

• Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?

Der positive absolute Nachhaltigkeitswert für den Bezugszeitraum betrug 7,1 %. Dies bedeutet, dass der gewichtete Durchschnittswert des Fonds auf Basis der zum Monatsende verfügbaren Daten über einen gleitenden Sechsmonatszeitraum bis zum Ende des Referenzzeitraums höher als null war.

Der Nachhaltigkeitswert wird wie oben beschrieben berechnet.

Während des Referenzzeitraums handelte es sich bei den Top-5-Indikatoren im proprietären Tool von Schroders, die positiv zum Nachhaltigkeitswert des Fonds beitrugen, um folgende:

- Vermiedene Emissionen: geschätzter ökologischer Nutzen durch Unternehmen, die zu einer kohlenstoffärmeren Wirtschaft beitragen;
- CO2-Emissionen Scope 1: die geschätzten Umweltkosten von Scope-1-Treibhausgasemissionen (THG) in Bezug auf den Klimawandel. Scope-1-Emissionen stellen die direkten Emissionen innerhalb des Verantwortungsbereichs eines Unternehmens dar;
- Bereitstellung von Empfängnisverhütungsmitteln: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen der Herstellung und des Angebots von Empfängnisverhütungsmitteln. Berechnung nach Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz; und
- Höhere Gehälter: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen von Unternehmen, die ihr Personal über dem örtlichen existenzsichernden Lohn bezahlen (in den Regionen, in denen die Unternehmen tätig sind). Zuweisung im Verhältnis zum Differenzbetrag zwischen den von den Unternehmen gezahlten Löhnen und den durchschnittlichen existenzsichernden Löhnen vor Ort;
- Tabak: geschätzte gesellschaftliche Kosten des Rauchens (wird Tabakherstellern zugeordnet). Berechnung nach Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz.

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

Der Fonds verpflichtete sich, mindestens 35 % seiner Long-Positionen nachhaltig zu investieren, wobei der Nachhaltigkeitswert jedes Vermögenswerts durch das proprietäre Tool von Schroders definiert wird. Gemäß dieser Vorgabe entfielen während des Bezugszeitraums auf der Grundlage von Daten zum jeweiligen Quartalsende 63 % des Long-Engagements auf nachhaltige Investitionen (bei denen es sich ausschließlich um Long-Positionen handelt, da Short-Positionen nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden).

Für zusätzlichen Kontext: Der Anlageverwalter investierte während des Referenzzeitraums auf der Grundlage von Daten zum jeweiligen Quartalsende 31 % des Bruttoengagements des Fonds in nachhaltige Investitionen. Dieser Wert entspricht dem prozentualen Anteil nachhaltiger Investitionen am Bruttoengagement des Fonds. Das Bruttoengagement umfasst sowohl Kauf- als auch Verkaufspositionen, und dieser Wert wird aus Gründen der Kohärenz mit den Berechnungen im nachstehenden Abschnitt über die Vermögensallokation angegeben.

Der Fonds wandte auch bestimmte Ausschlüsse an, deren Einhaltung der Anlageverwalter über seinen Portfolio-Compliance-Rahmen laufend überwachte.

• ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

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

Nachhaltige Investitionen

Diese Tabelle zeigt den prozentualen Anteil des Vermögens, der in nachhaltige Anlagen investiert wurde, im Jahresvergleich.

Zeitraum	Fonds % (Brutto)	Fonds % (Long)
Okt. 2023 - Sep. 2024	31	63
Okt. 2022 - Sep. 2023	28	55
Okt. 2021 - Sep. 2022	26	52

Nachhaltigkeitswert

Diese Tabelle zeigt die Entwicklung des Nachhaltigkeitswerts des Fonds gegenüber dem Vorjahr

Zeitraum	Fonds (%)
Okt. 2023 - Sep. 2024	7,1
Okt. 2022 - Sep. 2023	9,8
Okt. 2021 - Sep. 2022	8,8

Für den ersten Berichtszeitraum wurde der Prozentsatz der nachhaltigen Investitionen zum Ende des Referenzzeitraums berechnet. Ab Oktober 2022 wurde der Prozentsatz als Durchschnitt auf der Grundlage von Quartalsenddaten berechnet.

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

In Bezug auf den nachhaltig investierten Anteil des Long-Portfolios des Fonds wies jede nachhaltige Investition eine positive Nettoauswirkung auf ein oder mehrere ökologische oder soziale Ziele auf, wie anhand des proprietären Tools von Schroders bewertet.

Die Ziele der vom Fonds getätigten nachhaltigen Investitionen bestanden unter anderem in:

- Vermiedene Emissionen: geschätzter ökologischer Nutzen durch Unternehmen, die eine systemische oder gesamtwirtschaftliche Verringerung der CO2-Emissionen ermöglichen.
- Konnektivität: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen von Unternehmen, die durch Telekommunikationsdienste die Vernetzung von Gemeinden ermöglichen und/oder unterstützen; Berechnung im Verhältnis zum geschätzten globalen Nutzen des Zugangs zu globalen Kommunikationstechnologien und Zuweisung dieses Nutzens zu einzelnen Unternehmen auf der Grundlage ihres Anteils an den weltweiten Einnahmen aus Telekommunikations- und Internetkonnektivitätsmärkten, einschließlich Social-Media-Unternehmen;
- Bereitstellung von Empfängnisverhütungsmitteln: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen der Herstellung und des Angebots von Empfängnisverhütungsmitteln. Zuweisung im Verhältnis zum Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz;
- Höhere Gehälter: geschätzter gesellschaftlicher Nutzen von Unternehmen, die ihr Personal über dem örtlichen existenzsichernden Lohn bezahlen (in den Regionen, in denen die Unternehmen tätig sind). Zuweisung im Verhältnis zum Differenzbetrag zwischen den von den Unternehmen gezahlten Löhnen und den durchschnittlichen existenzsichernden Löhnen vor Ort; und

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

- Medizin: geschätzter gesellschaftlicher und gesamtwirtschaftlicher Nutzen durch das Angebot von medizinischen Produkten und Dienstleistungen. Zuweisung im Verhältnis zum Stellenwert des betreffenden Unternehmens innerhalb der Wertschöpfungskette des Gesundheitswesens und seinem Gesamtmarktanteil innerhalb des Teilssektors.

Die vorstehenden Beispiele für die Ziele der vom Fonds während des Bezugszeitraums getätigten nachhaltigen Investitionen beruhen auf den wichtigsten Zielen zum jeweiligen Quartalsende. Möglicherweise waren für den Referenzzeitraum weitere Ziele definiert.

Bei den **wichtigsten nachteiligen Auswirkungen**

handelt es sich um die bedeutendsten nachteiligen Auswirkungen von Investitionsent-scheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren in den Bereichen Umwelt, Soziales und Beschäftigung, Achtung der Menschenrechte und Bekämpfung von Korruption und Bestechung.

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

Der Ansatz des Anlageverwalters, kein ökologisch oder sozial nachhaltiges Investitionsziel erheblich zu beeinträchtigen, umfasste Folgendes:

Über alle Berichtszeiträume hinweg

- Unternehmensweite Ausschlüsse galten für Schroders-Fonds. Diese betreffen internationale Übereinkommen über Streumunition, Antipersonenminen sowie chemische und biologische Waffen. Eine detaillierte Liste aller ausgeschlossener Unternehmen ist unter <https://www.schroders.com/en/sustainability/activeownership/group-exclusions/> verfügbar.

Weitere Informationen zu allen Ausschlüssen des Fonds finden Sie unter „Nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungen“ auf der Website des Fonds unter <https://www.schroders.com/en-lu/lu/individual/fundcentre>.

Vom 1. Oktober 2023 bis zum 21. November 2023

- Schroders hat am 6. Januar 2020 die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC) unterzeichnet. Der Fonds schloss Unternehmen, die gegen die UNGC-Prinzipien verstößen, aus dem Teil des Portfolios aus, der in nachhaltige Anlagen investiert ist, da Schroders der Auffassung ist, dass solche Unternehmen einem oder mehreren ökologischen oder sozialen nachhaltigen Anlagezielen erheblich schaden. Die Bereiche, die dafür verantwortlich sind, ob ein Emittent Verstöße gegen den UNGC bezieht, umfassen Aspekte, die von den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte abgedeckt werden, beispielsweise Menschenrechte, Bestechung und Korruption, Arbeitsrechte, Kinderarbeit, Diskriminierung, Gesundheit und Sicherheit sowie Tarifverhandlungen. Die Liste der Unternehmen, die gegen den UNGC verstößen, wurde durch einen Drittanbieter bereitgestellt, und die Compliance mit der Liste wurde mittels unserer automatisierten Compliance-Kontrollen überwacht. Ausnahmen können gelten, wenn es Nachweise gab, dass das Unternehmen den Verstoß angegangen hat und keinen erheblichen Schaden verursacht, wie vorstehend beschrieben.

- Gegebenenfalls wurden auf Ebene der zugrunde liegenden Strategie, nicht jedoch auf Fondsebene, Unternehmen vom Long-Engagement ausgeschlossen, deren Einnahmen aus Aktivitäten im Zusammenhang mit Kraftwerkskohle, dem Abbau von Kraftwerkskohle und der Kohleverstromung bestimmte Schwellenwerte überschreiten.

Vom 22. November 2023 bis zum 16. Juli 2024

- Der Fonds schließt Unternehmen von nachhaltigen Investitionen aus, die nach Einschätzung von Schroders gegen eine oder mehrere „globale Normen“ verstößen und dadurch erhebliche ökologische oder soziale Schäden verursacht haben; diese Unternehmen sind auf der von Schroders geführten Liste von Verstößen gegen „globale Normen“ aufgeführt. Bei der Beurteilung, ob ein Unternehmen an einem solchen Verstoß beteiligt war, berücksichtigt Schroders einschlägige Grundsätze wie die im UN Global Compact (UNGC) enthaltenen Prinzipien, die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die UN-Leitprinzipien für Wirtschaft und Menschenrechte. Die Liste der Verstöße gegen „globale Normen“ kann auf der Grundlage von Bewertungen durch Drittanbieter und eigenen Untersuchungen erstellt werden, wenn dies für eine bestimmte Situation relevant ist.

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

- Der Fonds schloss Unternehmen, die Umsätze oberhalb bestimmter Schwellenwerte aus Tätigkeiten im Zusammenhang mit Tabak und Kraftwerkskohle erzielen, von nachhaltigen Investitionen aus.

Vom 17. Juli 2024 bis zum 30. September 2024

- Entsprechend der unternehmensweiten Ausschlüsse und ihren Schwellenwerten schloss der Fonds Unternehmen aus seinem Long-Engagement aus, die einen erheblichen Teil ihrer Einnahmen aus der Förderung von Kraftwerkskohle erwirtschaften.

- Der Fonds schloss schrittweise Unternehmen aus seinem Long-Engagement aus, die Umsätze oberhalb bestimmter Schwellenwerte aus Tätigkeiten im Zusammenhang mit Tabak und Kraftwerkskohle erzielen.

- Der Fonds schloss Unternehmen aus seinem Long-Engagement aus, die nach Einschätzung von Schroders gegen eine oder mehrere „globale Normen“ verstoßen und dadurch erhebliche ökologische oder soziale Schäden verursacht haben; diese Unternehmen waren auf der von Schroders geführten Liste von Verstößen gegen „globale Normen“ aufgeführt. Bei der Beurteilung, ob ein Unternehmen an einem solchen Verstoß beteiligt war, berücksichtigte Schroders einschlägige Grundsätze wie die UNGC-Grundsätze (UN Global Compact), die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte. Die Liste der Verstöße gegen „globale Normen“ kann auf der Grundlage von Bewertungen durch Drittanbieter und eigenen Untersuchungen erstellt werden, wenn dies für eine bestimmte Situation relevant ist.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Bei der Identifizierung erheblicher Beeinträchtigungen umfasste der Ansatz von Schroders zur Berücksichtigung der Indikatoren für die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen (Principal Adverse Impacts, PAI) sowohl eine quantitative als auch eine qualitative Bewertung. Unternehmen, in die investiert wird, und von denen angenommen wird, dass sie die quantitativen Schwellenwerte nicht erfüllen, wären im Allgemeinen ausgeschlossen worden, es sei denn, die Daten wurden im Einzelfall als nicht repräsentativ für die Leistung eines Unternehmens in dem betreffenden Bereich angesehen. Wurde die Festlegung quantitativer Schwellenwerte nicht für angemessen oder machbar erachtet, so hat der Anlageverwalter gegebenenfalls entsprechend den im „Engagement Blueprint“ und/oder in den Abstimmungsrichtlinien von Schroders dokumentierten Prioritäten mitgewirkt.

Dieser Rahmen unterliegt einer kontinuierlichen Überprüfung, insbesondere angesichts der Entwicklung der Verfügbarkeit und Qualität der Daten.

Unser Ansatz umfasste:

1. Quantitativ: hierzu gehörten Indikatoren, für die bestimmte Schwellenwerte festgelegt wurden:

- Durch die Anwendung von Ausschlüssen. Dieser Ansatz ist relevant für PAI 4 (Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind), PAI 5 (Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen) für das Long-Engagement des Fonds und PAI 14 (Engagement in umstrittenen Waffen) für das Long- und Short-Engagement des Fonds. Darüber hinaus wurden die folgenden PAIs im Rahmen des Ausschlusses gemäß der von Schroders geführten Liste der Verstöße gegen „globale Normen“ bewertet (die darauf abzielt, Unternehmen auszuschließen, die erhebliche Beeinträchtigungen verursachen), die für das Long-Engagement des Fonds angewendet wird: PAI 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), PAI 8 (Emissionen in Wasser), PAI 9 (Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle), PAI 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die Leitsätze der Organisation für wirtschaftliche Zusammenarbeit und Entwicklung für multinationale Unternehmen), PAI 11 (Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und freiwillig) und PAI 3 in Tabelle 3 (Anzahl identifizierter Fälle von schweren Menschenrechtsfragen und -vorfällen).

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

– Über die Anwendung einer Warnsystemkennzeichnung, wenn der oder die relevanten Indikatoren einen Schwellenwert überschritten. Diese quantitativen Schwellenwerte zur Beurteilung erheblicher Beeinträchtigungen werden von unserem Team für nachhaltige Investitionen zentral festgelegt und systematisch überwacht. Dieser Ansatz gilt für Indikatoren, bei denen wir die Grundgesamtheit in Beeinträchtigungsgruppen unterteilt haben, um einen Schwellenwert festzulegen, wie z. B. die kohlenstoffbezogenen PAI-Kennzahlen, PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO2-Fußabdruck) und der freiwillige PAI 4 in Tabelle 2 (Investitionen in Unternehmen ohne Initiativen zur Verringerung der CO2-Emissionen). PAI 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) funktioniert ähnlich, aber der Schwellenwert basiert auf einer Umsatzkennzahl. Ein Schwellenwert für PAI 6 (Intensität des Energieverbrauchs nach klimaintensiven Sektoren) wird auf der Grundlage der obengenannten CO2-Kennzahlen festgelegt. Ein ähnlicher Ansatz wurde für PAI 15 (THG-Emissionsintensität) gewählt. PAI 16 (Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstößen) funktioniert ebenfalls auf die gleiche Weise, basiert jedoch auf der Verfügbarkeit von Daten zu sozialen Verstößen. Im Rahmen dieses Prozesses wurde/n der/die betreffende(n) Emittent(en), bei dem/denen davon ausgegangen wird, dass er/sie die quantitativen Schwellenwerte nicht erfüllt/n, dem Anlageverwalter zur Prüfung vorgelegt. Dessen Reaktion konnte darin bestehen, die Beteiligung(en) zu verkaufen oder die Position beizubehalten, wenn die Daten im Einzelfall als nicht repräsentativ für die Leistung eines Unternehmens in dem betreffenden Bereich angesehen wurden. Unternehmen, in die investiert wird und von denen angenommen wird, dass sie erhebliche Beeinträchtigungen verursachen, wurden aus dem Long-Engagement des Fonds ausgeschlossen.

2. Qualitativ: Dies schloss PAI-Indikatoren ein, bei denen Schroders der Ansicht war, dass die verfügbaren Daten uns nicht in die Lage versetzen, eine quantitative Entscheidung darüber zu treffen, ob eine erhebliche Beeinträchtigung vorlag, die den Ausschluss einer Investition rechtfertigte. In solchen Fällen arbeitete der Anlageverwalter, wo immer möglich, mit dem oder den Unternehmen zusammen, die er hielt, und zwar in Übereinstimmung mit den Prioritäten, die im Engagement Blueprint von Schroders und/oder in den Abstimmungsrichtlinien dokumentiert sind. Dieser Ansatz gilt für Indikatoren wie PAI 12 (Unbereinigtes geschlechtsspezifisches Verdienstgefälle) und PAI 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen), bei denen wir aktiv wurden und unsere Stimmrechte nutzen konnten, wenn wir dies für angemessen hielten. Sowohl die Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen als auch die Offenlegung von Informationen zum geschlechtsspezifischen Verdienstgefälle sind in unserem Engagement Blueprint festgehalten.

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

Der Anteil nachhaltiger Investitionen steht im Einklang mit den OECD-Leitsätzen für multinationale Unternehmen und den Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte.

Unternehmen auf der von Schroders geführten Liste der Verstöße gegen „globale Normen“ wurden nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft. Bei der Entscheidung, ob ein Unternehmen in eine solche Liste aufgenommen werden soll, berücksichtigte Schroders neben anderen einschlägigen Grundsätzen die OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen und die Leitprinzipien der Vereinten Nationen für Wirtschaft und Menschenrechte. Die Liste der Verstöße gegen „globale Normen“ beruhte auf Informationen von Drittanbietern und, wo relevant, auf eigenen Untersuchungen.

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

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

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

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



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

Vom 1. Oktober 2023 bis zum 16. Juli 2024

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

1. Festlegung von Schwellenwerten: Hierzu zählten sehr eindeutige Schwellenwerte dafür, ob eine Anlage als „nachhaltige Investition“ angesehen wird. Beispielsweise PAI 10 zu Verletzungen von UNGC-Prinzipien.
2. Aktive Beteiligung (indirekt über die Manager der zugrunde liegenden Strategien): Dabei handelte es sich um Indikatoren, für die wir einen Plan hatten, um uns bei der zugrunde liegenden Beteiligung zu engagieren, wie in dem Dokument der Schroders-Gruppe dargelegt, in dem unser Ansatz in Bezug auf die aktive Beteiligung beschrieben wird. Zum Beispiel PAI 1, 2 und 3 zu Treibhausgasemissionen und PAI 13 zur Geschlechterdiversität im Verwaltungsrat.
3. Verbesserung der Datenlage (indirekt über die Manager der zugrunde liegenden Strategien): Hierzu zählten Indikatoren, bei denen wir die Datenlage für zu spärlich hielten, um zu handeln, und bei denen wir uns in erster Linie darauf konzentrierten, auf die zugrunde liegenden Unternehmen einzuwirken, um die Berichterstattung zu verbessern. Zum Beispiel PAI 7 zur biologischen Vielfalt, PAI 9 zum Anteil gefährlicher Abfälle und PAI 12 zum geschlechtsspezifischen Lohngefälle.

Vom 17. Juli 2024 bis zum 30. September 2024

Der Fonds verteilte sein Vermögen auf mehrere zugrunde liegende Strategien. Einige PAIs wurden gegebenenfalls auf Fondsebene berücksichtigt, andere PAIs auf der Ebene der zugrunde liegenden Strategien durch den jeweiligen Anlageverwalter. Weitere Einzelheiten dazu, wie diese während des Bezugszeitraums berücksichtigt wurden, sind nachstehend aufgeführt.

Einige PAIs wurden im Rahmen der Vorinvestitionsprüfung durch die Anwendung von Ausschlüssen berücksichtigt. Dazu zählten:

- Umstrittene Waffen: PAI 14 (Engagement in umstrittenen Waffen (Antipersonenminen, Streumunition, chemische und biologische Waffen)) – auf Long- und Short-Engagements angewandt
- Von Schroders geführte Liste mit Verstößen gegen „globale Normen“, die Folgendes abdeckt: PAI 7 (Tätigkeiten, die sich nachteilig auf Gebiete mit schutzbedürftiger Biodiversität auswirken), PAI 8 (Emissionen in Wasser), PAI 9 (Anteil gefährlicher und radioaktiver Abfälle), PAI 10 (Verstöße gegen die UNGC-Grundsätze und die Leitsätze der OECD für multinationale Unternehmen), PAI 11 (Fehlende Prozesse und Compliance-Mechanismen zur Überwachung der Einhaltung der UNGC-Grundsätze und der OECD-Leitsätze für multinationale Unternehmen) und PAI 16 (Länder, in die investiert wird, die gegen soziale Bestimmungen verstößen) – angewendet auf Long-Engagements.
- Unternehmen, die Umsätze oberhalb bestimmter Schwellenwerte aus Tätigkeiten im Zusammenhang mit Kraftwerkskohle erzielen: PAI 4 (Engagement in Unternehmen, die im Bereich der fossilen Brennstoffe tätig sind), PAI 5 (Anteil des Energieverbrauchs und der Energieerzeugung aus nicht erneuerbaren Energiequellen) – auf Long-Engagements auf Ebene des Long-Engagements angewandt

Die Einhaltung dieser Schwellenwerte wurde über den Portfolio-Compliance-Rahmen des Anlageverwalters überwacht.

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

Andere PAIs wurden im Rahmen der aktiven Eigentümerschaft berücksichtigt, die indirekt über die zugrunde liegenden Anlageverwalter erfolgte. Gegebenenfalls wurden auf der Grundlage der zugrunde liegenden Strategien und des Anlageprozesses des jeweiligen Anlageverwalters PAIs nach der Anlage im Rahmen von Engagement-Aktivitäten gemäß dem Ansatz und den Zielsetzungen des Engagement Blueprint von Schroders berücksichtigt. Zu den Schwerpunktthemen, die in unserem Engagement Blueprint berücksichtigt werden, gehören:

- Klimawandel
- Naturkapital und Biodiversität
- Menschenrechte
- Humankapitalmanagement
- Diversität und Inklusion
- Corporate Governance

Beispiele für mit diesem Ansatz erfasste PAIs sind etwa PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO2-Fußabdruck), PAI 3 (THG-Emissionsintensität der Unternehmen, in die investiert wird) und PAI 13 (Geschlechtervielfalt in den Leitungs- und Kontrollorganen).

Nachstehend sind die Engagement-Aktivitäten des Fonds im Referenzzeitraum zusammengefasst, einschließlich des jeweiligen Themas des Engagements

Engagement-Thema	Anzahl der Emittenten
Klimawandel	53
Corporate Governance	35
Menschenrechte	10
Humankapitalmanagement	10
Naturkapital und Biodiversität	10
Diversität und Inklusion	8

Unser Ansatz unterliegt einer laufenden Überprüfung, insbesondere in Anbetracht der sich verbessernden Verfügbarkeit und Qualität der Daten.



Welche waren die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die 15 größten Investitionen nach Nettoengagement (in % des NIW) während des Bezugszeitraums waren:

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

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die der **größte Anteil** der Investitionen entfiel, die im Bezugszeitraum mit dem Finanzprodukt getätigten wurden: **1. Okt. 2023 bis 30. Sep. 2024**

Größte Investitionen	Sektor	% des Vermögens (Netto)	Land
SAMSUNG ELECTRONICS	Informationstechnologie	1,93	Korea (Süd),
MEDIATEK	Informationstechnologie	1,63	Republik Taiwan (Republik China)
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY	Industrie	1,41	China
NOVA LJUBLJANSKA BANKA DD LJUBLJANA	Finanzen	1,36	Slowenien
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	Informationstechnologie	1,27	Taiwan (Republik China)
SHENZHOU INTERNATIONAL	Zyklische Konsumgüter	1,18	China
ALPHABET	Kommunikationsdienstleistungen	1,09	USA
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	Finanzen	1,08	Südkorea, Republik
TRIP.COM GROUP	Zyklische Konsumgüter	1,05	China
SAP	Informationstechnologie	1,02	Deutschland
DBS GROUP HOLDINGS	Finanzen	1,01	Dänemark
SCHNEIDER ELECTRIC	Industrie	1,01	Frankreich
RELX	Industrie	0,97	Vereiniges Königreich
RIO TINTO	Grundstoffe	0,96	Vereiniges Königreich
BHP GROUP	Grundstoffe	0,95	Australien

Die vorstehende Liste stellt den Durchschnitt des Nettoengagements des Fonds in % des NIW an jedem Quartalsende während des Referenzzeitraums dar.

Die Engagements wurden, soweit möglich, auf Look-through-Basis für Indexfutures, Indexoptionen, Total-Return-Swap-Positionen (TRS) und Differenzkontrakt-Baskets (CFD) zur Verfügung gestellt. In bestimmten Fällen wurden möglicherweise Proxy-Daten verwendet.

Die Daten zu den größten Investitionen und dem prozentualen Anteil am NIW stammen aus dem Schroders Investment Book of Record (IBoR). Die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht genannten größten Investitionen und prozentualen Anteile am NIW sind dem Accounting Book of Record (ABoR) des Administrators entnommen. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen mit unterschiedlichen Berechnungsmethoden können Angaben zu den größten Investitionen und Prozentsätzen des NIW voneinander abweichen.



Wie hoch war der Anteil der nachhaltigkeitsbezogenen Investitionen?

• Wie sah die Vermögensallokation aus?

Die Anlagen des Fonds, die genutzt werden, um seine ökologischen oder sozialen Merkmale zu erfüllen, sind nachstehend zusammengefasst.

#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst den Anteil des Fondsvermögens, der zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale eingesetzt wird. Dieser Anteil beträgt 98 % des Bruttoengagements. Der Fonds erzielte dauerhaft einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert, und somit wurden die Investitionen (Long- und Short-Positionen) des Fonds, die durch das proprietäre Nachhaltigkeitstool von Schroders bewertet wurden, unter #1 einbezogen,

Die **Vermögensallokation** definiert den Anteil der Anlagen in bestimmten Vermögenswerten.

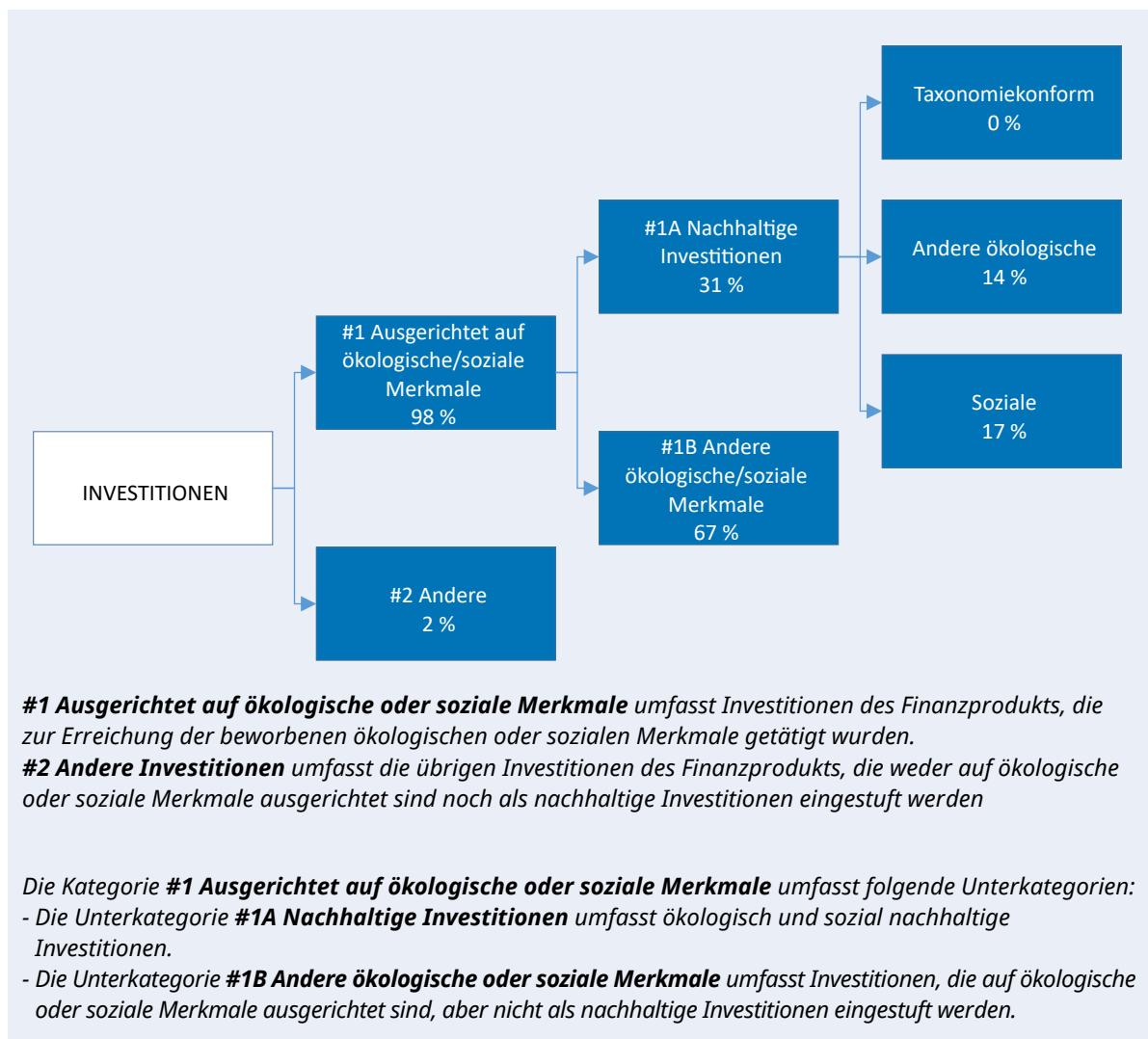
Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft) (Forts.)

wenn sie Einfluss auf den Nachhaltigkeitswert des Fonds hatten (unabhängig davon, ob eine jeweilige Einzelinvestition einen positiven oder einen negativen Wert aufwies). Long-Positionen mit positiven Bewertungen und Short-Positionen mit negativen Bewertungen trugen beide positiv zur Gesamtbewertung bei, während Long-Positionen mit negativen Bewertungen und Short-Positionen mit positiven Bewertungen beide die Gesamtbewertung beeinträchtigten. Der unter #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale angegebene Prozentsatz bezieht sich auf den Durchschnitt des Bezugszeitraums auf der Grundlage der Quartalsenddaten. Ebenfalls in #1 enthalten ist der Anteil des Bruttoengagements, der in nachhaltige Anlagen investiert wurde, wie in #1A angegeben.

Der Fonds investierte während des Referenzzeitraums 31 % seines Bruttoengagements in nachhaltige Investitionen. Dieser Prozentsatz entspricht dem Durchschnitt der Quartalsenddaten im Referenzzeitraum. Das Bruttoengagement umfasst sowohl Long- als auch Short-Positionen, während die Prozentangabe nur Long-Positionen umfasst, da Short-Positionen nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden. 14 % davon wurden in nachhaltige Investitionen mit Umweltziel und 17 % in nachhaltige Investitionen mit sozialem Ziel investiert. Der Fonds verpflichtete sich jedoch, mindestens 35 % seines Long-Engagements in nachhaltige Anlagen zu investieren. Der Fonds investierte während des Referenzzeitraums 63 % seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen. 28 % davon wurden in nachhaltige Investitionen mit Umweltziel und 34 % in nachhaltige Investitionen mit sozialem Ziel investiert. Die Summe des Prozentsatzes nachhaltiger Investitionen mit einem Umweltziel und des Prozentsatzes nachhaltiger Investitionen mit einem sozialen Ziel ergibt aufgrund von Rundungen möglicherweise nicht den Gesamtprozentsatz nachhaltiger Investitionen. In Bezug auf den nachhaltig investierten Anteil des Fondsportfolios wies jede nachhaltige Investition eine positive Nettoauswirkung auf ein oder mehrere ökologische oder soziale Ziele auf, wie anhand des proprietären Tools von Schroders bewertet. Mit Ausnahme von grünen oder sozialen Anleihen, die grundsätzlich als Investitionen mit ökologischem bzw. sozialem Ziel eingestuft werden, hängt die Einstufung von nachhaltigen Investitionen als Investitionen mit einem ökologischen oder sozialen Ziel davon ab, ob der betreffende Emittent laut der Daten des proprietären Tools von Schroders bessere Umweltindikatoren oder soziale Indikatoren aufweist als seine Vergleichsgruppe. In beiden Fällen berücksichtigen die Indikatoren die Elemente „Kosten“ und „Nutzen“.

#2 Andere Investitionen umfasst Investitionen, die nicht anhand des proprietären Nachhaltigkeitstools von Schroders bewertet werden und daher nicht zum Nachhaltigkeitswert des Fonds beitragen. Barmittel und Barmitteläquivalente sind von #2 Andere Investitionen aufgrund der Long/Short-Natur der Anlagestrategie des Fonds ausgeschlossen.

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



#1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale umfasst Investitionen des Finanzprodukts, die zur Erreichung der beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale getätigt wurden.

#2 Andere Investitionen umfasst die übrigen Investitionen des Finanzprodukts, die weder auf ökologische oder soziale Merkmale ausgerichtet sind noch als nachhaltige Investitionen eingestuft werden

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

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

Die oben angegebenen Prozentsätze werden aus Gründen der Einheitlichkeit als Anteil des Bruttoengagements berechnet. Der Fonds hat sich jedoch verpflichtet, mindestens 35 % seines Long-Engagements nachhaltig zu investieren, und während des Referenzzeitraums entfielen 63 % der Long-Positionen des Fonds auf nachhaltige Investitionen.

Es wurden auf Look-Through-Basis Engagements für Index-Futures, Index-Optionen, TRS-Positionen und CFD-Körbe bereitgestellt und auf Emittentenebene verrechnet. In bestimmten Fällen wurden möglicherweise Proxy-Daten verwendet. Diese Verrechnung erfolgte vor der Einstufung als Long- oder Short-Engagement und vor der Berechnung des Bruttoengagements.

• In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Im Referenzzeitraum wurden in den folgenden Wirtschaftssektoren Investitionen auf Basis des Brutto- und Nettoengagements (in % des NIW) getätigt:

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

Sektor	Teilesktor	% des Vermögens (Netto)	% des Vermögens (Brutto)
Kommunikationsdienstleistungen	Medien und Unterhaltung	2,14	11,69
Kommunikationsdienstleistungen	Telekommunikationsdienstleistungen	-1,01	5,85
Zyklische Konsumgüter	Automobile und Autoteile	-2,28	8,62
Zyklische Konsumgüter	Zyklische Konsumgüter - Vertrieb und Einzelhandel	-3,65	11,85
Zyklische Konsumgüter	Gebrauchsgüter und Bekleidung	3,82	12,74
Zyklische Konsumgüter	Verbraucherdiensleistungen	0,69	12,37
Basiskonsumgüter	Basiskonsumgüter - Vertrieb und Einzelhandel	-0,38	6,63
Basiskonsumgüter	Nahrungsmittel, Getränke und Tabakwaren	-3,28	9,61
Basiskonsumgüter	Haushalts- und Körperpflegeprodukte	-0,51	3,42
Energie	Energie	-1,15	10,85
Finanzen	Banken	-1,57	35,91
Finanzen	Finanzdienstleistungen	0,03	16,09
Finanzen	Versicherung	0,13	11,16
Gesundheitswesen	Geräte und Dienstleistungen für das Gesundheitswesen	0,74	8,41
Gesundheitswesen	Pharmazeutika, Biotechnologie & Life Sciences	-1,04	10,27
Inhaltsverzeichnis	Inhaltsverzeichnis	1,09	5,80
Industrie	Investitionsgüter	3,71	38,77
Industrie	Gewerbliche und professionelle Dienstleistungen	0,37	8,07
Industrie	Transport	-0,59	9,62
Informationstechnologie	Halbleiter und Halbleiterausrüstung	1,82	14,14
Informationstechnologie	Software und softwarebezogene Dienstleistungen	2,64	12,86
Informationstechnologie	Technologie-Hardware und Ausrüstung	2,15	18,22
Zinssätze / staatsnahe Titel / Staatsanleihen	Zinssätze / staatsnahe Titel / Staatsanleihen	1,56	1,56
Grundstoffe	Grundstoffe	-0,58	26,62
Immobilien	Aktien - Real Estate Investment Trusts (REITs)	-0,78	3,16
Immobilien	Immobilienbewirtschaftung und -entwicklung	-0,29	6,66
Versorger	Versorger	-3,15	6,63

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

Es wurden auf Look-Through-Basis Engagements für Index-Futures, Index-Optionen, TRS-Positionen und CFD-Körbe bereitgestellt und auf Emittentenebene verrechnet. In bestimmten Fällen wurden möglicherweise Proxy-Daten verwendet.

Die obigen Angaben zu den auf die Sektoren entfallenden Prozentanteilen des NIW sind dem Schroders Investment Book of Record (IBOR) entnommen. Die an anderer Stelle im geprüften Jahresbericht genannten Prozentanteile des NIW an den Sektoren sind dem Accounting Book of Record (ABoR) des Administrators entnommen. Aufgrund dieser unterschiedlichen Datenquellen mit unterschiedlichen Berechnungsmethoden können Angaben zu Prozentanteilen des NIW an einzelnen Sektoren voneinander abweichen.



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

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

Es gab keine definierte Mindest-Taxonomieausrichtung der Anlagen des Fonds (einschließlich Übergangs- und ermögliche Tätigkeiten) mit Umweltziel. Die Taxonomieausrichtung der Investitionen dieses Fonds wurde daher nicht berechnet und wird mit 0 % des Fondspportfolios angegeben.

- Wurde mit dem Finanzprodukt in EU-taxonomiekonforme Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie investiert?

Ja:

In fossiles Gas

In Kernenergie

Nein

¹ Tätigkeiten im Bereich fossiles Gas und/oder Kernenergie sind nur dann EU-taxonomiekonform, wenn sie zur Eindämmung des Klimawandels („Klimaschutz“) beitragen und kein Ziel der EU-Taxonomie erheblich beeinträchtigen – siehe Erläuterung links am Rand. Die vollständigen Kriterien für EU-taxonomiekonforme Wirtschaftstätigkeiten im Bereich fossiles Gas und Kernenergie sind in der Delegierten Verordnung (EU) 2022/1214 der Kommission festgelegt.

Taxonomiekonforme Aktivitäten, ausgedrückt durch den Anteil der:

- Umsatzerlöse, die den Anteil der Einnahmen aus umweltfreundlichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

Die nachstehenden Grafiken zeigen den Mindestprozentsatz der EU-taxonomiekonformen Investitionen in Grün. Da es keine geeignete Methode zur Bestimmung der Taxonomiekonformität von Staatsanleihen gibt, zeigt die erste Grafik die Taxonomiekonformität in Bezug auf alle Investitionen des Finanzprodukts einschließlich der Staatsanleihen, während die zweite Grafik die Taxonomiekonformität nur in Bezug auf Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.*

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

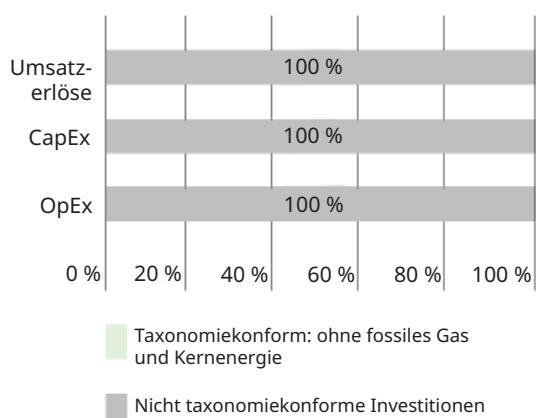
- Investitionsausgaben

(CapEx), die die umweltfreundlichen Investitionen der Unternehmen, in die investiert wird, aufzeigen, z. B. für den Übergang zu einer grünen Wirtschaft.

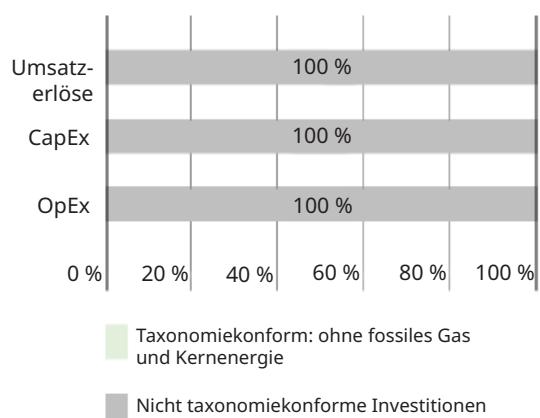
- Betriebsausgaben

(OpEx), die die umweltfreundlichen betrieblichen Aktivitäten der Unternehmen, in die investiert wird, widerspiegeln.

1. Taxonomiekonformität der Investitionen einschließlich Staatsanleihen*



2. Taxonomiekonformität der Investitionen ohne Staatsanleihen*



Diese Grafik gibt x % der Gesamtinvestitionen wieder²

* Für die Zwecke dieser Grafiken umfasst der Begriff „Staatsanleihen“ alle Risikopositionen gegenüber Staaten.

²Da keine Taxonomiekonformität besteht, hat der Ausschluss von Staatsanleihen keine Auswirkungen auf das Diagramm (d. h. der Prozentsatz der Investitionen, die der Taxonomie entsprechen, bleibt bei 0 %) und die Verwaltungsgesellschaft ist daher der Ansicht, dass es nicht notwendig ist, diese Information anzugeben.

Ermöglichte Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichtend darauf hin, dass andere Tätigkeiten einen wesentlichen Beitrag zu den Umweltzielen leisten

Übergangstätigkeiten

sind Wirtschaftstätigkeiten, für die es noch keine CO2-armen Alternativen gibt und Treibhausgas-emissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

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

Diese Frage ist nicht relevant.

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



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



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

Während des Referenzzeitraums und auf der Grundlage von Daten zum jeweiligen Quartalsende investierte der Fonds 14 % seines Bruttoengagements in nachhaltige Anlagen mit einem Umweltziel, die nicht mit der Taxonomie konform waren. Dieser Prozentsatz wird aus Gründen der Vereinheitlichung mit der oben im Abschnitt „Vermögensallokation“ angegebenen Berechnungsgrundlage aufgeführt. Der Fonds investierte 28 % seines Long-Engagements in nachhaltige Anlagen mit einem Umweltziel, die nicht mit der Taxonomie konform waren.



Wie hoch war der Anteil der sozial nachhaltigen Investitionen?

Während des Bezugszeitraums und auf der Grundlage von Daten zum jeweiligen Quartalsende investierte der Fonds 17 % seines Bruttoengagements in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel. Dieser Prozentsatz wird aus Gründen der Vereinheitlichung mit der oben im Abschnitt „Vermögensallokation“ angegebenen Berechnungsgrundlage aufgeführt. Der Fonds investierte 34 % seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel.



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

#2 Andere Investitionen umfasst Investitionen, die nicht anhand des proprietären Nachhaltigkeitstools von Schroders bewertet werden und daher nicht zum Nachhaltigkeitswert des Fonds beitragen. Barmittel und Barmitteläquivalente sind von #2 Andere Investitionen aufgrund der Long/Short-Natur der Anlagestrategie des Fonds ausgeschlossen.

Mindestschutzregelungen wurden gegebenenfalls auf Geldmarktinstrumente und Optionen angewandt, die zur Risikominderung (Absicherung) verwendet wurden, oder auf andere Anlagen, indem (gegebenenfalls) Anlagen in Gegenparteien eingeschränkt wurden, die mit Ländern mit höherem Risiko (im Hinblick auf Geldwäsche, Terrorismusfinanzierung, Bestechung, Korruption, Steuerhinterziehung und Sanktionsrisiken) verbunden oder dort engagiert waren. Bei einer unternehmensweiten Risikobewertung wird die Risikoeinstufung der einzelnen Länder berücksichtigt; dabei wird auf eine Reihe von öffentlichen Erklärungen, Indizes und globale Staatsführungsindikatoren Bezug genommen, die von den Vereinten Nationen, der Europäischen Union, der britischen Regierung, der Financial Action Task Force und mehreren Nichtregierungsorganisationen (NRO) wie Transparency International und dem Basler Ausschuss herausgegeben wurden.

Darüber hinaus wurden neue Kontrahenten durch das Kreditrisikoteam von Schroders überprüft und die Zulassung eines neuen Kontrahenten basierte auf einer ganzheitlichen Prüfung der verschiedenen verfügbaren Informationsquellen, insbesondere zur Qualität des Managements, zur Eigentümerstruktur, zum Standort, zum aufsichtsrechtlichen und gesellschaftlichen Umfeld eines jeden Kontrahenten und zum Entwicklungsgrad des örtlichen Bankensystems sowie dessen aufsichtsrechtlichen Rahmenbedingungen. Die laufende Überwachung erfolgte über ein firmeneigenes Tool von Schroders, das die Analyse des Managements ökologischer, sozialer und unternehmensführungsbezogener Trends und Herausforderungen durch die Kontrahenten unterstützt.

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

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



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

Im Bezugszeitraum wurden die folgenden Maßnahmen ergriffen, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu erreichen:

- Der Anlageverwalter wandte bei der Auswahl der Anlagen für den Fonds Nachhaltigkeitskriterien an;
- Der Anlageverwalter berücksichtigte bei der Auswahl der Vermögenswerte den Nachhaltigkeitswert des Fonds;
- Während des gesamten Berichtszeitraums wurde eine Bewertung der guten Unternehmensführung durchgeführt; und
- Der Anlageverwalter setzte (auch indirekt über die Manager der zugrunde liegenden Strategien) Engagement-Aktivitäten in Bezug auf mindestens eines der sechs vorrangigen Themen um, die in unserem Engagement Blueprint (Link <https://mybrand.schroders.com/m/3222ea4ed44a1f2c/original/schroders-engagement-blueprint.pdf>) definiert sind. Die Engagement-Aktivitäten des Fonds mit Angaben zur Anzahl der Emittenten, mit denen zusammengearbeitet wurde, und zu den entsprechenden Themen sind oben in der Antwort auf die Frage „Wie wurden bei diesem Finanzprodukt die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?“ zusammengefasst. Durch unsere Engagement-Aktivitäten bauen wir Beziehungen auf und führen einen wechselseitigen Dialog mit den Unternehmen, in die wir investieren. Wir wollen damit Veränderungen vorantreiben, die den Wert unserer Investitionen schützen und steigern.



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Referenzbenchmarks sind Indizes, die messen, ob Finanzprodukte die ökologischen oder sozialen Merkmale, auf die sie abzielen, tatsächlich fördern.

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

• Wie unterscheidet sich der Referenzwert von einem breiten Marktindex?

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

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

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

• Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum Referenzwert abgeschnitten?

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

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

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

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

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

Wichtige Hinweise

Die in diesem Anhang enthaltenen Angaben dienen der Erfüllung der aufsichtsrechtlichen Offenlegungspflichten von Schroder Investment Management (Europe) S.A. und sollten nur zu Informationszwecken verwendet werden. Das Material soll kein Angebot und keine Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Finanzinstrumenten darstellen. Das Material soll keine Rechnungslegungs-, Rechts- oder Steuerberatung oder Anlageempfehlung darstellen und sollte nicht entsprechend verwendet werden. Die hierin enthaltenen Informationen werden als zuverlässig erachtet, Schroders übernimmt jedoch keine Gewähr für deren Vollständigkeit oder Richtigkeit und kann keine Verantwortung für Irrtümer in Bezug auf Fakten oder Meinungen übernehmen. Individuelle Anlage- und/oder strategische Entscheidungen sollten nicht auf der Grundlage der in diesen Angaben enthaltenen Ansichten und Informationen getroffen werden. Schroders hat in diesen Angaben eigene Ansichten zum Ausdruck gebracht, die sich ändern können.

Bestimmte hierin enthaltene Informationen (die „Informationen“) stammen von bzw. sind urheberrechtlich geschützt von MSCI Inc., MSCI ESG Research LLC oder ihren verbundenen Unternehmen („MSCI“) oder Informationsanbietern (zusammen die „MSCI-Parteien“) und können zur Berechnung von Bewertungen, Signalen oder anderen Indikatoren verwendet werden sein. Die Informationen sind nur für den internen Gebrauch bestimmt und dürfen ohne vorherige schriftliche Genehmigung weder ganz noch teilweise vervielfältigt oder verbreitet werden. Die Informationen dürfen nicht für ein Angebot zum Kauf oder Verkauf oder eine Werbung oder Empfehlung von Wertpapieren, Finanzinstrumenten oder -produkten, Handelsstrategien oder Indizes verwendet werden und sind auch nicht als Hinweis oder Garantie für eine zukünftige Wertentwicklung zu verstehen. Einige Fonds können auf MSCI-Indizes basieren oder an diese gekoppelt sein, und MSCI kann auf der Grundlage des verwalteten Vermögens des Fonds oder anderer Kennzahlen vergütet werden. MSCI hat eine Informationsbarriere zwischen Indexanalyse und bestimmten Informationen geschaffen. Die Informationen selbst dürfen nicht dazu verwendet werden, zu bestimmen, welche Wertpapiere zu kaufen oder zu verkaufen sind oder wann sie gekauft oder verkauft werden sollten. Die Informationen werden ohne Mängelgewähr bereitgestellt und der Nutzer übernimmt das volle Risiko der Nutzung der Informationen, die er vornimmt oder zulässt. Keine MSCI-Partei garantiert die Ursprünglichkeit, Richtigkeit und/oder Vollständigkeit der Informationen und jede Partei lehnt ausdrücklich alle ausdrücklichen oder stillschweigenden Garantien ab. Keine MSCI-Partei haftet für Fehler oder Auslassungen im Zusammenhang mit hierin enthaltenen Informationen oder für direkte, indirekte oder spezielle Schäden; Strafschadenersatz, Folgeschäden oder sonstige Schäden (einschließlich entgangener Gewinne), selbst wenn sie auf die Möglichkeit solcher Schäden hingewiesen wurde.



EST. 1804

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof,
L-1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg
Tel.: (+352) 341 342 212
Fax: (+352) 341 342 342