



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Geprüfter Jahresbericht

30. September 2023

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

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

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.

Inhalt

Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland	5
Verwaltungsrat	6
Verwaltung	7
Bericht des Verwaltungsrats	8
Bericht des Anlageverwalters	11
Prüfbericht	13
Statistische Informationen	16
Nettovermögensaufstellung	30
Ertrags- und Aufwandsrechnung	32
Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens	34
Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen	36
Anlageportfolio	40
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	40
Schroder GAIA BlueTrend	41
Schroder GAIA Cat Bond	42
Schroder GAIA Contour Tech Equity	48
Schroder GAIA Egerton Equity	48
Schroder GAIA Helix	49
Schroder GAIA Oaktree Credit	53
Schroder GAIA SEG US Equity*	60
Schroder GAIA Sirius US Equity	61
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	62
Schroder GAIA Wellington Pagosa	63
Anmerkungen zum Abschluss	69
Gesamtkostenquote („TER“)	145
Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)	148
Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft)	150
Anhang III – Nachhaltigkeitsbezogene Finanzangaben (ungeprüft)	161

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

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 Luxembourg

Email: simeudealing@schroders.com

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

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

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

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

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

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

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsvorsitzender

- **Eric Bertrand**

Non-Executive Director

Vaults 13-16
Valletta Waterfront
FRN 1914
Malta

Weitere Verwaltungsratsmitglieder

- **Carla Bergareche Garcia-Minaur**

Global Head of Wealth, Client Group

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

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

Independent Director

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

- **Bernard Herman**

Independent Director

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

- **Hugh Mullan**

Independent Director

5, rue Höhenhof
L-1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

- **Alexander Prawitz¹**

Country Head Germany, Austria & CEEMED region

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

- **Neil Walton²**

Head of OCIO and Client Specialist Solutions

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

- **Ross Leach³**

Specialist Solutions

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

- **Tim Boole⁴**

Head of Product Management Private Equity

Schroders Capital Management (Switzerland) AG
Affolternstrasse 56
8050 Zürich
Schweiz

¹ Das Verwaltungsratsmandat von Alexander Prawitz endete während des Geschäftsjahres am 15. September 2023.

² Das Verwaltungsratsmandat von Neil Walton endete während des Geschäftsjahres am 1. September 2023.

³ Ross Leach wurde am 1. September 2023 in den Verwaltungsrat berufen.

⁴ Tim Boole wurde am 30. März 2023 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, Register- und Transferstelle

HSBC Continental Europe, Luxembourg¹

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

Verwahrstelle und Verwaltungsstelle

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

80, route d'Esch, 1470 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptrechtsberater

Arendt & Medernach S.A.

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

Unabhängiger Abschlussprüfer

KPMG Audit S.à r.l.

39, Avenue J.F. Kennedy, 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, L.P.

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

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

- Oaktree Capital Management (UK) LLP

Schroder Investment Management Limited

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

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

- Tellworth Investments LLP²
- Schroder Investment Management North America Inc.
- 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 (Switzerland) AG

Central 2, 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, und
- Systematica Investments Singapore PTE.

Tellworth Investments LLP²

Eagle House, 3rd Floor, 108-110 Jermyn Street, London, SW1Y 6EE,
Vereinigtes Königreich

Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund*

Two Sigma Advisers LP

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

Wellington Management International Limited

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

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

- Wellington Management Company LLP.

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

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

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

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: 4RIMT7.0000.SP.442.

Abschluss

Der Verwaltungsrat (der „Verwaltungsrat“) der Gesellschaft legt hiermit seinen Bericht und den geprüften Abschluss für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 vor.

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

Dieser Bericht bezieht sich auf den Berichtszeitraum vom 1. Oktober 2022 bis zum 30. September 2023. Der letzte Termin, an dem die Anteilkurse berechnet wurden, war der 29. September 2023, der letzte Arbeitstag im Berichtszeitraum. Der Abschluss wurde im Einklang mit den Luxemburger Verordnungen in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen erstellt.

Zum 30. September 2023 belief sich das Nettovermögen der Gesellschaft insgesamt auf 4.930.545.415 EUR, was im Vergleich zu 5.333.186.258 EUR zum 30. September 2022 einem Rückgang um 7,55 % 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 Teilfonds zum Ende des Geschäftsjahres sowie des Ergebnisses der Gesellschaft und jedes ihrer Teilfonds 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 Fonds 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.

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 Geschäftsjahres zum 30. September 2023 fanden acht 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 5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg, Großherzogtum Luxemburg, zur Einsichtnahme verfügbar ist.
2. Ihrer Satzung, die am Geschäftssitz der Gesellschaft sowie im luxemburgischen Handelsregister, dem Registre de Commerce et des Sociétés („RCSL“), zur Einsichtnahme verfügbar ist.
3. Den Verpflichtungen bezüglich der Verwaltung der Gesellschaft, wofür die Gesellschaft Schroder Investment Management (Europe) S.A. bestellt hat, die wiederum den Bestimmungen der Richtlinie 2010/43/EG über Verwaltungsgesellschaften und der Richtlinie 2011/61/EU über die Verwalter alternativer Investmentfonds unterliegt, die in luxemburgisches Recht umgesetzt wurden.
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 Jahresberichten ordnungsgemäß geführt werden und ohne Weiteres zugänglich sind. Die Jahresberichte der Gesellschaft müssen vom Verwaltungsrat der Gesellschaft genehmigt und bei der Commission de Surveillance du Secteur Financier („CSSF“) sowie, im Fall von Jahresberichten, dem Registre de Commerce et des Sociétés (RCSL) eingereicht werden. Die gesetzlich vorgeschriebenen Jahresabschlüsse müssen von unabhängigen Abschlussprüfern geprüft werden, die dem Verwaltungsrat ihre Feststellungen melden.

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

Bericht des Verwaltungsrats (Forts.)

Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor

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

Aktivitäten während des Geschäftsjahres

1. Neue Teilfonds

Während des Berichtsjahres wurden neue Teilfonds für Anlagen innerhalb der Gesellschaft zur Verfügung gestellt:

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	USD	21. Dezember 2022
Schroder GAIA SEG US Equity*	USD	30. Juni 2023

2. Neue Anteilklassen

Während des Berichtszeitjahres wurden die folgenden Anteilklassen aufgelegt:

Teilfonds und Anteilklasse	Währung der Anteilklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Asian Equity Long Short			
Klasse A Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Klasse C Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Klasse I Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Klasse IZ Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Schroder GAIA Cat Bond			
Klasse Y2 Thes.	USD	USD	11. November 2022
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	11. November 2022
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	11. November 2022
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	11. November 2022
Schroder GAIA SEG US Equity			
Klasse C Thes.	USD	USD	30. Juni 2023
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	30. Juni 2023
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	30. Juni 2023
Klasse IZ Thes.	USD	USD	30. Juni 2023
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	30. Juni 2023
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	30. Juni 2023
Klasse K Thes.	USD	USD	30. Juni 2023
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	30. Juni 2023
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	30. Juni 2023
Klasse R1 Thes.	USD	USD	30. Juni 2023
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023
Klasse R2 Thes.	USD	USD	30. Juni 2023
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	30. Juni 2023
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	30. Juni 2023
Klasse R3 Thes.	USD	USD	30. Juni 2023
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	30. Juni 2023
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	30. Juni 2023
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	30. Juni 2023
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	30. Juni 2023

* Der Schroder GAIA SEG US Equity wurde im Rahmen einer Fondsverschmelzung mit dem Select Equity/Short UCITS Fund aufgelegt. Der Select Equity/Short UCITS Fund wurde zum Zeitpunkt der Verschmelzung am 30. Juni 2023 effektiv geschlossen, wobei alle Anleger und Vermögenswerte an den GAIA SEG US Equity Fund übertragen wurden.

Bericht des Verwaltungsrats (Forts.)

3. Auflösungen von Teilfonds

Während des Berichtsjahres wurde ein Teilfonds aufgelöst:

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Auflösungsdatum
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund	GBP	19. September 2023

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

Wesentliche Ereignisse während des Jahres

Der anhaltende Konflikt zwischen Russland und der Ukraine wirkt sich weiterhin auf die Bewertung der von der Gesellschaft gehaltenen russischen Wertpapiere aus. Der Verwaltungsrat hat weiterhin angemessene Bewertungsgrundsätze in Übereinstimmung mit unseren Preisbildungsprozessen angewandt. Zum Ende des Geschäftsjahres hielt der Schroder GAIA Helix 38.000.000 russische Aktien, die mit 116.803 USD bewertet wurden.

Nach finanziellen Schwierigkeiten und einer Reihe von Medienskandalen brach die Credit Suisse im März 2023 zusammen und wurde von der ebenfalls schweizerischen UBS übernommen. Zum Ende des Geschäftsjahres hielt der Schroder GAIA Wellington Pagosa Fund 2.392.000 Nominalanleihen in USD der Credit Suisse, die mit null bewertet wurden.

Der folgende Teilfonds ist in russischen und ukrainischen Wertpapieren engagiert:

Schroder GAIA Helix

Für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 wurde der bisherige unabhängige Abschlussprüfer der Gesellschaft, PricewaterhouseCoopers Société coopérative, durch KPMG Audit S.à r.l. ersetzt.

Der Verwaltungsrat

Schroder GAIA

30. September 2023

Bericht des Anlageverwalters

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

Wirtschaftlicher Rückblick

Im zwölfmonatigen Berichtszeitraum standen vor allem die steigende Inflation und die politischen Reaktionen der großen Zentralbanken im Fokus der Anleger. Die Befürchtung, dass steigende Zinsen zu einer Rezession führen könnten, nahm zu.

In Europa war der anhaltende Krieg in der Ukraine ein weiterer Negativfaktor, und vor dem Winter 2022 wuchs die Sorge, dass es in der Region zu einer Gasknappheit kommen könnte. Die Wirtschaftstätigkeit und die Aktienmarktrenditen wurden Ende 2022 auch durch die anhaltenden COVID-19-bedingten Lockdowns in China belastet.

Im Vereinigten Königreich begann der Berichtszeitraum unter der kurzlebigen Regierung von Liz Truss, die im September 2022 Premierministerin wurde, turbulent. Die neue Regierung kündigte ein Haushaltspaket an, das von den Märkten negativ aufgenommen wurde. Die Renditen britischer Anleihen stiegen sprunghaft an, und das Pfund Sterling fiel gegenüber dem US-Dollar auf ein Allzeittief. Nach dem Rücktritt von Liz Truss im Oktober 2022 und der Bildung einer neuen Regierung unter Rishi Sunak stabilisierten sich die Märkte jedoch.

Zu Beginn des Jahres 2023 wurden die Aussichten für die Märkte positiver. Das Weltwirtschaftswachstum blieb trotz weiterer Zinserhöhungen der großen Zentralbanken insgesamt robust. In Europa trug das wärmere Wetter dazu bei, die Auswirkungen der hohen Gaspreise zu begrenzen.

Die Entscheidung Chinas, seine strikten Lockdown-Maßnahmen Ende 2022 aufzuheben, führte ebenfalls zu einer Belebung der Mobilität und der Wirtschaftstätigkeit. Im weiteren Verlauf des Jahres 2023 zeigten die Daten aus China jedoch, dass die wirtschaftliche Erholung schwächer ausfiel als von vielen erhofft, während der Immobiliensektor unter Druck geriet.

Die Volatilität nahm im März 2023 zu, als mehrere US-Regionalbanken, darunter die Silicon Valley Bank, aufgrund mangelnder Liquidität zusammenbrachen. In Europa folgte kurz darauf die Übernahme der Credit Suisse durch die UBS.

Befürchtungen, dass die USA ihre Schuldenobergrenze überschreiten könnten, sorgten für zusätzliche Unsicherheit. Anfang Juni 2023 wurde jedoch eine Einigung über die Anhebung der Schuldenobergrenze erzielt.

Gegen Ende des Berichtszeitraums begannen die Inflationsraten in den großen Volkswirtschaften zu sinken. Das robuste Wachstum ließ jedoch Befürchtungen aufkommen, dass dies noch nicht das Ende des Zinserhöhungszyklus bedeuten könnte.

Überblick über die Entwicklung am Aktienmarkt

Vor diesem Hintergrund konnten globale Aktien aber immer noch Gewinne erzielen. Gemessen am MSCI World Index erzielten Aktien aus Industrieländern eine Rendite von 22,0 % (in US-Dollar).

Der wachstumsorientierte Anlagestil schnitt überdurchschnittlich ab: Der MSCI World Growth erzielte eine Rendite von 26,6 % gegenüber 17,1 % für den MSCI World Value (jeweils in US-Dollar). Die sogenannten „glorreichen Sieben“ (Apple, Microsoft, Meta, Amazon, Alphabet, Nvidia und Tesla) waren für einen Großteil der Outperformance der Wachstumswerte verantwortlich. Ihre Kursgewinne wurden zum Teil von einer Welle der Begeisterung der Anleger für das Potenzial der künstlichen Intelligenz getragen. Während diese großen Unternehmen weiterhin von den Anlegern bevorzugt wurden, blieben kleinere Unternehmen zurück, obwohl sie insgesamt immer noch positive Renditen erzielten.

Aktien aus Schwellenländern (EM) schnitten schlechter ab, und der MSCI EM Index erzielte eine Rendite von 11,7 % (in US-Dollar). Einige der europäischen Schwellenländer entwickelten sich sehr stark, nachdem sie zu Beginn des Jahres 2022 bei Ausbruch des Kriegs zwischen Russland und der Ukraine zurückgeblieben waren. China blieb aufgrund der schwachen Konjunkturerholung und der Probleme im Immobiliensektor hinter dem MSCI EM Index zurück.

Überblick über die Entwicklung am Anleihemarkt

Die US-Wirtschaft überraschte weiterhin durch ihre Widerstandsfähigkeit. Der Arbeitsmarkt blieb relativ robust, und Anzeichen einer Verbesserung im verarbeitenden Gewerbe trugen zu einem optimistischeren Ausblick bei. Sorgen über die zunehmende Emission von US-Schuldtiteln belasteten den Markt für US-Staatsanleihen. Im August stufte die Ratingagentur Fitch das Rating der USA von AAA auf AA+ herab und begründete dies mit der wachsenden Schuldenlast und einer „Erosion der Governance“.

Trotz des starken Ölpreisanstiegs gab es im Jahresverlauf bessere Nachrichten von der Inflationsfront: Die Kerninflationsraten gingen in den meisten Wirtschaftsräumen gegen Ende des Berichtszeitraums im Jahresvergleich zurück. Dies ermöglichte es vielen großen Zentralbanken, eine Pause in Bezug auf weitere Zinserhöhungen zu signalisieren. Nach früheren Zinserhöhungen beließen sowohl die US-Notenbank (Fed) als auch die Bank of England (BoE) die Zinssätze im September unverändert. Die Europäische Zentralbank (EZB) erhöhte die Leitzinsen, wies jedoch darauf hin, dass die derzeitigen Zinssätze restriktiv genug sein könnten, um die Inflation wieder auf ihr Zielniveau zurückzuführen.

Da die Inflation jedoch nach wie vor hoch war, ging der Markt davon aus, dass die Zinsen noch für eine längere Zeit auf hohem Niveau bleiben würden. Dies war der Hauptgrund für die Marktschwäche im Quartalsverlauf. Die Renditen von Staatsanleihen stiegen stark an, und die Kurven wurden an den meisten wichtigen Märkten steiler, da sich Anleihen mit längeren Laufzeiten schlechter entwickelten.

Die Rendite zehnjähriger US-Staatsanleihen stieg von 3,80 % auf 4,57 %, die Rendite zehnjähriger britischer Staatsanleihen von 4,09 % auf 4,44 % und die Rendite zehnjähriger deutscher Staatsanleihen von 2,11 % auf 2,84 %.

Die Märkte für Unternehmensanleihen entwickelten sich besser als die Märkte für Staatsanleihen. Trotz eines schwächeren Wachstumspfades übertrafen europäische Kreditwerte ihre Pendants aus den USA.

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

Bericht des Anlageverwalters (Forts.)

Ausblick

Während sich die Inflation in die richtige Richtung bewegt, hat das robuste Wachstum Befürchtungen geweckt, dass der Zinserhöhungszyklus noch nicht abgeschlossen sein könnte.

Die Wirtschaftsexperten von Schroders haben ihre Wachstumsprognose für die USA in diesem Jahr auf 2,3 % (zuvor 1,5 %) angehoben, die Prognose für China hingegen auf 4,8 % (zuvor 6,5 %) gesenkt. Diese Veränderungen heben sich weitgehend gegenseitig auf, so dass die Prognose für das globale BIP-Wachstum mit 2,5 % nahezu unverändert bleibt. Es wird erwartet, dass sich das globale Wachstum im Jahr 2024 weiter auf 2,1 % verlangsamen wird, da die Geldpolitik die Wirtschaftstätigkeit weiterhin dämpft.

Die globale Inflation wird sich voraussichtlich von 7,2 % im vergangenen Jahr auf 4,4 % in diesem und 3,1 % im nächsten Jahr abschwächen. Zwischen den Industrieländern und den Schwellenländern ist eine deutliche Divergenz festzustellen, wobei die Inflation in den Industrieländern sinkt und in den Schwellenländern steigt, während sich China aus der Deflation befreit.

Die Leitzinsen befinden sich in der Nähe ihrer Höchststände und werden im nächsten Jahr sinken, wenngleich sich der Lockerungszyklus verzögert, was die Herausforderung der Inflationsbekämpfung widerspiegelt.

Die Anlageverwalter

Schroder GAIA

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



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 Anteilhaber 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 Nettovermögensaufstellung und die Aufstellung der Anlagebestände zum 30. September 2023 sowie die Ertrags- und Aufwandsrechnung und die 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 2023 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 Angaben 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 angemessenerweise 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 führen diese durch und wir verschaffen uns Prüfungsnachweise, die als Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk ausreichend und geeignet sind. Das Risiko, dass eine auf Betrug zurückzuführende wesentliche Falschaussage nicht aufgedeckt wird, ist höher als im Fall von Irrtümern, da im Betrugsfall Absprachen, Fälschungen, absichtliche Auslassungen, Falschdarstellungen oder das Ausschalten interner Kontrollmaßnahmen vorliegen können;
- verschaffen wir uns ein Verständnis der für die Prüfung relevanten internen Kontrollmaßnahmen, um Prüfverfahren zu konzipieren, die für die jeweilige Situation geeignet sind, jedoch nicht zum Zweck der Äußerung einer Ansicht darüber, ob die internen Kontrollmaßnahmen des Fonds wirksam sind oder nicht;
- 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 25. Januar 2024

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 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
zum 30. September 2021	-	206.090.340	2.363.039.525	441.703.360	949.465.017	731.532.901
Im Umlauf befindliche Anteile**						
zum 30. September 2023						
Klasse A Thes.	15	105.371	2.279	136.044	235.198	4.657
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	1.121	-	2.838	-	100
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	352.383	33.624	29.455	-	154.695
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	7.915	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	100	-	-	111
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	4.291	-	140
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	292.734	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	813	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	8.275	8.135	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	90.260	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	15	383.056	6.433	483.525	568.931	13.494
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	292.798	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	14.716	1.678	15.533	-	949
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	302.150	20.846	307.549	-	22.066
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	1.092.824	10.039	116.298	85.684	36.023
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	65.827	-	11
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	140
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	463.016	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	5.044	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	3.210	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	31.965	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	1
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	-	33.418	-	3.838	24	363.550
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	2.509	-	5.298
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	5.000	-	22.181	-	1.193.246
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	71.859
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	-	120.008	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	10.972	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	1.252	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	7.046	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	200	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	290	-	-	-
Klasse I Thes.	100.015	-	161.520	-	-	138.428
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	27.737	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	9.572	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	120	-	-	103
Klasse IF Thes.	-	-	157.068	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	84.353	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	463.479	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	7.462.415	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	11.689	-	-	-
Klasse IZ Thes.	15	-	-	-	-	-

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

** Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in 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 2023						
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
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	-	273.000	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	100	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	56.014	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	15.750	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	28.066	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	35.573	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	51.218	-	-	-
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.	-	-	-	-	-	126
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	96
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	2.253
Klasse X Thes.	-	-	-	-	62.985	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	582.309
Klasse Y Thes.	-	-	8.454	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	413	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	109	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	31	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	10	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	10	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	16.423	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	54.115	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	29.280	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	100	-	-	-

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

** Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt „Anteilklassen“ 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 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
zum 30. September 2021	28.626.911	-	338.622.600	908.388.830	411.679.496
Im Umlauf befindliche Anteile**					
zum 30. September 2023					
Klasse A Thes.	-	-	525.344	-	137.785
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	-	2.261	-	7.236
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	-	65.247	-	185.806
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	16.758
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	15	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	100	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	100	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	16	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	105	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	105	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	105	-	-	-	-
Klasse C Thes.	13.959	15	316.200	1.230.890	1.300.142
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	140.648
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	620	800	12.843	20.168	91.052
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1.151	4.418	78.933	535.532	1.203.500
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	100	15.224	24.683	571.944	866.897
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	16	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	106	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	105	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	106	-	398	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	55
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	258
Klasse E Thes.	317.678	-	170	-	42.886
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	100	-	-	-	8.332
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	125.832	-	5.632	-	98.472
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	100	-	-	-	58.965
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	16	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	106	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	105	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	18.395	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes.	-	59.994	-	-	-
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	901	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	31.624	-	-	-

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

** Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt „Anteilklassen“ 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 2023					
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	100	-	-	-
Klasse K Thes.	-	15	-	391.237	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	100	-	590	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	100	-	49.364	-
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.	-	53.934	-	-	-
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	-	61.515	-	-	-
Klasse R2 Thes.	-	271.772	-	-	-
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	-	15.803	-	-	-
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	-	631.343	-	-	-
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	-	23.595	-	-	-
Klasse R3 Thes.	-	383.767	-	-	-
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	-	31.141	-	-	-
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	-	325.220	-	-	-
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	-	39.773	-	-	-
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	-	2.631	-	-	-
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	-	2.809	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	15	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	68	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-

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

** Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in 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
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	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	110,07
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-

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

** Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse 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 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	-	-	-

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

** Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse 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 Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch.	97,91	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	93,09	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	100,63	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
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	-	122,89
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	95,04	-	-	-	107,25
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	96,93	-	160,39	-	110,14
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	99,94	-	-	-	93,45
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
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	-	-	-
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 EUR abgesichert	-	94,27	-	110,78	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	94,82	-	115,04	-

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

** Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse 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 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	-	-	-	-	-

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

** Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse 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
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Wahrung der Anteilsklasse 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 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 Anteilsklassen wird in der Wahrung der Anteilsklasse 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**					
zum 30. September 2022					
Klasse A Thes.	-	144,25	-	-	114,68
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	168,47	-	-	104,17
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	126,87	-	-	105,30
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	157,82
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	89,68	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	87,46	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	87,63	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	92,55	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	91,62	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	97,33	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	92,17	-	-	-	-
Klasse C Thes.	90,12	151,65	126,72	112,77	117,77
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	134,17
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	88,03	175,63	112,05	139,93	107,30
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	88,24	133,59	114,57	125,50	108,20
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	89,59	140,66	120,55	-	90,30
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	150,77	-
Klasse C Aussch.	92,55	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	91,61	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	97,33	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	92,15	140,47	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5.352,35
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5.426,56
Klasse E Thes.	90,17	162,79	-	-	121,01
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	88,22	-	-	-	109,90
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	88,45	143,73	-	-	111,01
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	89,78	-	-	-	92,66
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	92,54	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	91,60	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	97,33	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	92,15	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	91,14	-	-	121,56	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	123,20	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	108,88	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	111,19	121,97	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	147,12	-

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

** Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse 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.)					
zum 30. September 2022					
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	112,71	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	125,53	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	150,74	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	100,54	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	141,45	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-

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

** Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse 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 2021					
Klasse A Thes.	104,27	1.467,46	132,18	220,80	115,45
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	90,88	-	121,95	-	109,23
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	93,88	-	124,41	-	110,04
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	206,94	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	913,91	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	142,43	-	181,62	-	114,68
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	218,87	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	210,98	-
Klasse A1 Thes.	-	-	131,99	207,06	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	210,90	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	107,08	1.476,56	136,52	237,81	118,46
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	105,88	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	93,82	1.160,58	127,56	-	112,83
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	96,05	1.221,98	128,16	-	113,22
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	102,06	104,90	105,55	221,12	115,81
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	1.065,45	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	188,93	-	117,41
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	236,05	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	237,14	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	227,65	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	101,08	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5.851,33
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5.641,43
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5.671,85
Klasse E Thes.	110,23	-	137,92	236,00	120,71
Klasse E Thes. CHF	96,45	-	-	-	-
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	94,54	-	128,05	-	114,22
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	98,76	-	129,31	-	115,35
Klasse E Thes. GBP	108,56	-	-	-	-
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	105,36	-	105,52	-	117,81
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	1.065,91	-	-
Klasse E Thes., in SGD abgesichert	-	-	190,34	-	119,58
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	104,12	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	1.466,48	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	1.155,70	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	1.214,16	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	1.173,41	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	1.569,30	-	-	-
Klasse I Thes.	121,74	1.662,84	157,11	341,27	125,92
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	1.407,79	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	1.484,33	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	10.608,63	-	-	12.903,29
Klasse I Thes., in USD abgesichert	-	-	-	275,98	-
Klasse IF Thes.	-	1.514,07	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	1.281,57	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	1.351,44	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	922,66	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	1.396,47	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	95,01	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	105,16	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	-	-	236,36	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	114,60

* Der Nettoinventarwert je Anteil der einzelnen Anteilklassen wird in der Wahrung der Anteilsklasse 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**					
zum 30. September 2021					
Klasse A Thes.	-	151,88	-	-	110,83
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	181,00	-	-	102,32
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	136,50	-	-	103,28
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	152,54
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	109,29
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	101,37	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	100,89	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	101,01	-	-	-	-
Klasse C Thes.	101,56	158,46	114,81	116,22	113,26
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	116,73
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	101,09	187,13	103,24	146,22	104,63
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	101,21	142,29	105,29	131,06	105,57
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	101,46	148,13	109,54	-	86,96
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	155,95
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	154,88	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	148,04	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5.666,93
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5.228,86
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5.284,23
Klasse E Thes.	101,53	169,60	-	-	115,46
Klasse E Thes. CHF	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	101,08	-	-	-	106,46
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	101,26	152,59	-	-	107,49
Klasse E Thes. GBP	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	101,52	-	-	-	88,64
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	159,01
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	101,84	205,53	133,89	123,90	121,92
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	112,18	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	100,80	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	102,70	128,06	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	151,95	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	116,14	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	131,08	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	154,92	-
Klasse X Thes.	-	104,86	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	151,00	-	-	-

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

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

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2023

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short* USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
VERMÖGENSWERTE						
Anlagen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	9.706.301	310.817.756	2.459.088.034	122.058.181	283.368.041	257.782.776
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	102.103	(24.082.685)	(74.233.570)	10.390.302	42.100.088	(7.112.602)
Wertpapiere zum Marktwert	9.808.404	286.735.071	2.384.854.464	132.448.483	325.468.129	250.670.174
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	(126.011)	(1.466.806)	6.420.347	(306.441)	(2.699.657)	(2.989.323)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	7.535.496	-	-	-	2.354.606
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	5.760.685	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	9.220.465	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	9.000.344	9.087.736
aus Differenzkontrakten	175.559	150.181	-	2.202.594	-	(7.168.577)
	49.548	21.200.021	6.420.347	1.896.153	6.300.687	1.284.442
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	-	297.694	37.119.434	3.600.791	3.856.723	15.296.638
Bankguthaben	675.373	45.170.278	48.817.222	21.113.677	63.689.452	41.258.800
Termineinlagen	-	-	-	-	-	-
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	3.313.396	-	-	-	1.868.849
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	36.445	54.527.985	40.540.000	7.020.411	21.644.379	-
Forderungen aus Zeichnungen	-	579.712	-	613.389	1.147.989	500.897
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	-	-	445.334
Dividenden und Zinsforderungen	47.788	409.784	35.600.239	235.671	838.243	4.439.158
Erstattungsforderung des Fonds	-	246.495	15.390	-	-	2.484
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	880.000	5.430.000	160.000	-	820.000
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	1.000.000	-	220.000	1.260.000	700.000
Sonstige Forderungen**	-	-	-	-	3.577.098	-
SUMME VERMÖGENSWERTE	10.617.558	414.360.436	2.558.797.096	167.308.575	427.782.700	317.286.776
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	-	324.707	27.130.873	9.436.173	14.022.396	6.611.827
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	-	1.079.537	-	459.866	849.856	2.679.559
Fällige Managementgebühren	5	347.087	1.739.722	167.107	491.108	179.892
Fällige Performancegebühren	43	465	927.912	-	-	-
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	10.490	662	-	59.191	162.621	1.038.626
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	-	-	-	3.042.408
Optionen zum Marktwert	-	-	-	1.008.030	-	-
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	730.000	-
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	1.880.000	5.430.000	380.000	530.000	1.520.000
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen***	3.216	9.750.639	43.710.303	1.871.515	427.124	5.551.184
SUMME VERBINDLICHKEITEN	13.754	13.383.097	78.938.810	13.381.882	17.213.105	20.623.496
SUMME NETTOVERMÖGEN	10.603.804	400.977.339	2.479.858.286	153.926.693	410.569.595	296.663.280

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

** 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 Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 30. September 2023 (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
VERMÖGENSWERTE						
Anlagen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	65.958.465	282.697.440	147.944.688	5.164.828	446.437.468	4.168.594.827
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	(2.887.926)	(10.810.845)	11.659.646	(59.644)	7.520.386	(42.567.528)
Wertpapiere zum Marktwert	63.070.539	271.886.595	159.604.334	5.105.184	453.957.854	4.126.027.299
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	1.250.708	(1.441.701)	129.844	(370.562)	664.397	(1.030.750)
aus Kassageschäften	-	-	-	17.487	-	16.540
aus Terminkontrakten	-	-	-	3.214.574	388.804	12.762.810
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	(854.319)	(808.058)
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	(107.628)	(252.884)	5.107.754
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	19.444	18.391
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	190.759	180.429
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	(614.430)	8.140.020
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	2.203.320	4.846.767	1.357.944	25.548.717
aus Differenzkontrakten	-	1.767.521	-	-	-	(2.717.164)
	1.250.708	325.820	2.333.164	7.600.638	899.715	47.218.689
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	556.335	39.105.303	857.574	52.701.611	19.733.681	163.959.882
Bankguthaben	4.713.345	29.990.225	16.636.217	310.472.763	33.069.022	585.720.130
Termineinlagen	-	-	-	221.977.000	-	209.956.968
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	15.730.630	18.588.446	37.362.329
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	330.000	7.106.984	-	11.556.637	373.186	136.557.267
Forderungen aus Zeichnungen	430.747	471.614	-	233.895	231.349	4.043.807
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	3.302.975	-	-	2.041.963	5.476.729
Dividenden und Zinsforderungen	983.265	668.921	236.290	85.409	1.616.455	42.761.138
Erstattungsforderung des Fonds	-	12.296	-	-	-	261.684
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	50.000	690.000	110.000	420.000	960.000	9.004.493
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	50.000	600.000	90.000	540.000	900.000	5.137.985
Sonstige Forderungen***	-	-	-	-	86.170	3.658.600
SUMME VERMÖGENSWERTE	71.434.939	354.160.733	179.867.579	626.423.767	532.457.841	5.377.147.000
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	1.290.181	315.885	3.542.688	221.977.000	28.802.766	297.240.278
Verbindlichkeiten aus der Rückgabe von Anteilen	628	15.728.906	751.534	14.855.563	8.066.893	42.110.189
Fällige Managementgebühren	22.960	372.388	232.701	459.580	508.153	4.302.501
Fällige Performancegebühren	-	32	1.089.270	3.238.119	19.773	4.989.940
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	-	319.245	162.766	714.728	1.250.719	3.526.468
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	1.520.000	-	-	4.315.354
Optionen zum Marktwert	-	-	-	-	-	953.445
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	-	730.000
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	100.000	1.290.000	200.000	960.000	1.860.000	13.412.478
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen****	428.128	5.008.310	931.604	5.299.649	8.343.378	76.944.436
SUMME VERBINDLICHKEITEN	1.841.897	23.034.766	8.430.563	247.504.639	48.851.682	448.525.089
SUMME NETTOVERMÖGEN	69.593.042	331.125.967	171.437.016	378.919.128	483.606.159	4.928.621.911

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

** Für die in Euro angegebene Summe der Nettovermögensaufstellung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit dem folgenden Wechselkurs vom 30. September 2023 umgerechnet: 1 Euro = 0,94585 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 Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short* USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD	Schroder GAIA Oaktree Credit USD
ERTRÄGE							
Nettodividenden [^]	287.822	66.998	-	-	3.280.407	16.618.660	36.709
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	-	879.882	237.203.176	-	-	700.942	4.119.559
Nettoertrag aus Swaps	179.372	5.600.485	-	5.467.461	1.780.931	4.449.152	-
Bankzinsen	34.413	3.692.912	7.468.158	1.239.536	1.394.712	1.884.296	137.548
Sonstige Erträge	-	4	37.500	-	40.427	16.399	1.289
Erträge insgesamt	501.607	10.240.281	244.708.834	6.706.997	6.496.477	23.669.449	4.295.105
AUFWAND							
Performancegebühren	43	465	927.912	-	-	-	-
Managementgebühren	51	4.680.880	20.725.790	2.246.501	6.972.276	2.313.804	289.951
Nettodividendenaufwand [^]	-	-	26.747	1.394.074	-	-	-
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	-	-	-	-	-
Verwahrstellengebühren	2.844	314.835	578.595	41.251	119.056	97.555	50.909
Verwaltungsgebühren	6.533	1.341.125	3.459.837	520.623	1.469.498	396.846	90.518
Taxe d'abonnement	1.051	221.888	310.460	80.896	214.892	110.675	23.654
Vertriebsgebühren	-	-	-	6.656	99.164	-	-
Bank- und Zinskosten	46	46.347	30.886	643	2.806	12.389	78.807
Sonstige Aufwendungen	1.900	275.643	779.690	88.221	1.086.734	193.946	23.798
Aufwendungen insgesamt	12.468	6.881.183	26.839.917	4.378.865	9.964.426	3.125.215	557.637
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	246.495	15.390	-	-	2.484	-
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	489.139	3.605.593	217.884.307	2.328.132	(3.467.949)	20.546.718	3.737.468

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Ertrags- und Aufwandsrechnung für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA SEG US Equity* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund* GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe** EUR
ERTRÄGE						
Nettodividenden [^]	-	946.033	144.347	302.191	-	20.716.710
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	-	386.348	91.739	13.083.418	2.473.742	244.936.394
Nettoertrag aus Swaps	179.461	730.090	-	-	-	17.487.738
Bankzinsen	447.756	488.842	90.176	8.093.376	4.174.058	27.661.838
Sonstige Erträge	457.000	272	-	-	5	525.146
Erträge insgesamt	1.084.217	2.551.585	326.262	21.478.985	6.647.805	311.327.826
AUFWAND						
Performancegebühren	32	1.089.270	-	3.238.119	19.773	4.989.940
Managementgebühren	1.218.357	3.122.166	213.279	8.047.490	7.670.985	54.809.777
Nettodividendenaufwand [^]	400.154	-	-	-	139.813	1.854.611
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	130.324	24.277.203	1.096.960	24.150.553
Verwahrstellengebühren	24.212	46.352	11.076	136.731	333.781	1.670.798
Verwaltungsgebühren	173.364	588.226	75.184	1.661.556	1.871.202	11.118.646
Taxe d'abonnement	39.096	94.594	11.261	255.137	298.209	1.585.807
Vertriebsgebühren	-	-	-	-	-	105.460
Bank- und Zinskosten	-	106	12	48.185	123.914	325.660
Sonstige Aufwendungen	47.891	85.532	69.736	254.145	706.449	3.491.369
Aufwendungen insgesamt	1.903.106	5.026.246	510.872	37.918.566	12.261.086	104.102.621
Abzüglich: Kostenzuschüsse	12.296	-	-	-	-	261.684
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	(806.593)	(2.474.661)	(184.610)	(16.439.581)	(5.613.281)	207.486.889

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

** Für die in Euro angegebene Summe der Ertrags- und Aufwandsrechnung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 30. September 2023 umgerechnet: 1 Euro = 0,94585 US-Dollar und 1 Euro = 1,15403 Pfund Sterling.

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short* USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD	Schroder GAIA Oaktree Credit USD
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)**	489.139	3.605.593	217.884.307	2.328.132	(3.467.949)	20.546.718	3.737.468
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)							
aus verkauften Wertpapieren	249.858	38.746	14.459.597	(4.447.028)	32.868.972	(3.213.272)	(566.488)
aus Devisenterminkontrakten	(5.616)	41.585.247	21.940.054	5.458.645	29.356.883	21.355.677	(493.900)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	(46.359.877)	430	-	476.064	(13.267.294)	42.905
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	(8.210.941)	-	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	887.973	-	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	20.534.694	(78.121.541)	-
aus Differenzkontrakten	(274.501)	-	-	2.079.260	-	62.425.167	-
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	2.869.422	-	805.668	-	(2.452.300)	(353)
aus Devisengeschäften	(12.471)	(946.184)	2.932.099	(19.560)	2.685.460	(10.257.685)	(136.875)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)	(42.730)	(10.135.614)	39.332.180	3.876.985	85.922.073	(23.531.248)	(1.154.711)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs/ (Wertverlustes)							
aus Anlagen	102.103	(14.385.341)	196.272.435	45.053.433	6.373.162	59.972.821	4.489.809
aus Devisenterminkontrakten	(126.011)	(12.478.911)	(1.315.925)	(498.072)	1.480.328	4.013.615	183.564
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	222.471	-	-	(2.219.883)	(11.506.487)	(43.173)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	4.270.772	-	-	-	-	-
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-	-
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	-	-	-
aus Zins-Swapkontrakten	-	1.519.944	-	-	-	-	-
aus Total Return Swapkontrakten	-	-	-	-	(26.549.873)	(26.419.591)	-
aus Differenzkontrakten	175.559	(428.530)	-	(14.226.977)	-	22.748.355	-
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	22.384	-	269.212	-	(641.856)	(422)
aus Devisengeschäften	(256)	(410.340)	27.799	(8.358)	249.722	(149.070)	46.577
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/ (WERTVERLUSTES)	151.395	(21.667.551)	194.984.309	30.589.238	(20.666.544)	48.017.787	4.676.355
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	597.804	(28.197.572)	452.200.796	36.794.355	61.787.580	45.033.257	7.259.112
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	10.006.000	242.009.370	557.465.603	34.752.920	58.940.722	137.610.643	31.599.635
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	-	(184.098.355)	(501.920.313)	(137.155.614)	(298.756.479)	(376.321.007)	(16.674.098)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	(187.270)	(4.741.511)	-	-	(23.328)	(108.020)
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Geschäftsjahres	10.603.804	29.526.173	503.004.575	(65.608.339)	(178.028.177)	(193.700.435)	22.076.629
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	-	371.451.166	1.976.853.711	219.535.032	588.597.772	490.363.715	47.516.413
Nennwährungsanpassung***	-	-	-	-	-	-	-
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	10.603.804	400.977.339	2.479.858.286	153.926.693	410.569.595	296.663.280	69.593.042

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

** 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 2022 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 30. September 2023.

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA SEG US Equity* USD	Schroder GAIA Sirius US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund* GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe** EUR
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)***	(806.593)	(2.474.661)	(184.610)	(16.439.581)	(5.613.281)	207.486.889
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	(349.741)	9.673.452	(2.123.847)	1.456.764	26.236.566	71.598.835
aus Devisenterminkontrakten	(5.960.276)	1.611.647	(200.302)	19.394.742	27.686.073	154.519.246
aus Kassageschäften	-	-	-	10.265	-	9.709
aus Terminkontrakten	-	-	(175.331)	(10.769.833)	(10.129.714)	(75.851.489)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	(1.957.867)	(1.851.849)
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	46.255	(1.108.135)	(8.770.699)
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	132.634	125.452
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	447.790	423.542
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	(4.740.205)	(3.643.634)
aus Total Return Swapkontrakten	-	3.581.217	-	64.539.557	(1.916.803)	9.262.459
aus Differenzkontrakten	(5.505.376)	-	179.242	-	-	55.751.473
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	(893.955)	666.370	(39.064)	-	(14.318.148)	(12.646.922)
aus Devisengeschäften	(22.132)	3.954	3.665	45.353	(371.186)	(5.619.307)
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)	(12.731.480)	15.536.640	(2.355.637)	74.723.103	19.961.005	183.306.816
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)						
aus Anlagen	(10.810.845)	20.928.897	2.843.271	(9.125)	29.209.371	322.563.883
aus Devisenterminkontrakten	(1.441.701)	(564.881)	(90.379)	(2.372.780)	(4.458.640)	(16.651.631)
aus Kassageschäften	-	-	-	5.055	-	4.781
aus Terminkontrakten	-	-	(138.600)	(522.408)	990.544	(12.650.868)
aus Credit Default Swapkontrakten	-	-	-	-	(2.276.965)	(2.153.667)
aus Credit Default Index-Swapkontrakten	-	-	-	(643.735)	(501.579)	2.956.215
aus Cross-Currency Swapkontrakten	-	-	-	-	25.412	24.036
aus Inflations-Swapkontrakten	-	-	-	-	180.982	171.182
aus Zins-Swapkontrakten	-	-	-	-	694.067	2.094.123
aus Total Return Swapkontrakten	-	(5.492.261)	-	(13.171.030)	(11.168.218)	(79.754.982)
aus Differenzkontrakten	1.767.521	-	(263.253)	-	-	9.188.681
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	(353.820)	-	-	-	(196.963)	(852.651)
aus Devisengeschäften	(121)	7.562	(4.186)	87.287	(527.137)	(631.020)
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	(10.838.966)	14.879.317	2.346.853	(16.626.736)	11.970.874	224.308.082
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	(24.377.039)	27.941.296	(193.394)	41.656.786	26.318.598	615.101.787
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	398.073.705	32.105.905	1.937.941	86.274.486	193.454.371	1.691.210.435
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(42.570.699)	(77.079.251)	(42.369.816)	(443.858.159)	(351.705.383)	(2.363.621.304)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	-	-	-	-	(4.786.124)
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Geschäftsjahres	331.125.967	(17.032.050)	(40.625.269)	(315.926.887)	(131.932.414)	(62.095.206)
Nettovermögen zu Beginn des Geschäftsjahres	-	188.469.066	40.625.269	694.846.015	615.538.573	5.333.186.258
Nennwährungsanpassung****	-	-	-	-	-	(342.469.141)
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES GESCHÄFTSJAHRES	331.125.967	171.437.016	-	378.919.128	483.606.159	4.928.621.911

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

** Für die in Euro angegebene Summe der Veränderung des Nettovermögens wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 30. September 2023 umgerechnet: 1 Euro = 0,94585 US-Dollar und 1 Euro = 1,15403 Pfund Sterling.

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 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	43,99	71,51	93,40	-	-	26,16
Sonstige Wertpapiere						
Werbung	-	-	-	-	-	-
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	-	-	2,04	0,42
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	-	-
Fluggesellschaften	-	-	-	-	-	0,06
Bekleidung	1,42	-	-	-	-	0,93
Automobilhersteller	-	-	-	-	-	0,34
Autoteile und -zubehör	1,89	-	-	-	-	1,45
Banken	2,79	-	-	-	8,26	7,43
Getränke	-	-	-	-	-	0,44
Biotechnologie	-	-	-	-	-	0,13
Baustoffe	-	-	-	-	-	0,59
Chemie	-	-	-	-	-	0,59
Gewerbliche Dienstleistungen	3,11	-	-	1,34	-	1,04
Computer	1,57	-	-	-	-	0,47
Kosmetik und Körperpflege	-	-	-	-	-	-
Vertrieb und Großhandel	-	-	-	-	-	-
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	-	2,19	9,93	1,88
Elektrik	-	-	-	-	-	0,74
Elektrische Bauteile und Geräte	0,85	-	-	-	-	0,38
Elektronik	3,79	-	-	6,96	-	3,16
Energie – Alternative Energiequellen	-	-	-	-	-	0,06
Bau- und Ingenieurwesen	-	-	-	-	-	0,42
Unterhaltung	-	-	-	-	-	-
Umweltschutz	-	-	-	-	-	-
Lebensmittel	-	-	-	-	-	0,98
Forstwirtschaftliche Erzeugnisse und Papier	-	-	-	-	-	0,45
Gas	-	-	-	-	-	-
Gesundheitswesen – Produkte	-	-	-	-	-	0,04
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	-	-	-	-	0,74
Wohngebäude-Bauträger	-	-	-	-	-	-
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	-	0,74
Haushaltswaren	1,27	-	-	-	-	0,49
Versicherung	1,36	-	2,77	-	9,74	1,09
Internet	1,36	-	-	29,56	13,68	0,71
Investmentgesellschaften	-	-	-	-	0,63	6,63
Eisen und Stahl	-	-	-	-	-	1,19
Freizeit	1,18	-	-	-	-	0,58
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	0,76	0,09
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	-	0,40
Maschinen – Diversifiziert	1,13	-	-	-	-	0,58
Medien	-	-	-	4,54	-	-
Metallprodukte und Eisenwaren	1,20	-	-	-	-	0,12
Bergbau	0,57	-	-	-	-	0,43
Diverse Fertigungsbetriebe	-	-	-	-	3,62	-
Öl und Gas	-	-	-	-	4,06	1,01
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	4,60	-

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

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.)						
Verpackung und Container	-	-	-	-	-	0,07
Pharmazeutika	-	-	-	-	2,44	0,73
Pipelines	-	-	-	-	-	-
Immobilien	-	-	-	-	-	1,36
Einzelhandel	1,16	-	-	-	-	2,24
Halbleiter	22,04	-	-	8,32	-	15,74
Software	-	-	-	33,14	6,49	0,19
Telekommunikation	1,82	-	-	-	-	1,21
Transport	-	-	-	-	13,02	-
Wasser	-	-	-	-	-	-
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	92,50	71,51	96,17	86,05	79,27	84,50
Termineinlagen	-	-	-	-	-	-
Sonstiges Nettovermögen	7,50	28,49	3,83	13,95	20,73	15,50
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

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

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	90,63	-	19,06	0,03	59,00
Sonstige Wertpapiere					
Werbung	-	-	-	-	0,04
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	2,17	-	0,15
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	0,13
Fluggesellschaften	-	-	1,20	-	-
Bekleidung	-	-	-	-	-
Automobilhersteller	-	-	1,50	-	0,13
Autoteile und -zubehör	-	-	-	-	0,16
Banken	-	-	2,14	-	4,67
Getränke	-	-	1,62	-	-
Biotechnologie	-	-	-	-	2,14
Baustoffe	-	4,41	-	-	0,44
Chemie	-	-	-	-	0,15
Gewerbliche Dienstleistungen	-	5,87	6,86	-	0,75
Computer	-	-	0,80	-	-
Kosmetik und Körperpflege	-	-	-	-	0,31
Vertrieb und Großhandel	-	0,87	-	-	-
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	0,96	-	1,54
Elektrik	-	-	-	-	1,57
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	0,03
Elektronik	-	2,63	1,41	-	0,15
Energie – Alternative Energiequellen	-	-	-	-	0,07
Bau- und Ingenieurwesen	-	2,98	-	-	0,17
Unterhaltung	-	11,00	-	-	-
Umweltschutz	-	3,66	2,13	-	0,04
Lebensmittel	-	-	-	-	0,22
Forstwirtschaftliche Erzeugnisse und Papier	-	-	-	-	-
Gas	-	-	-	-	0,63
Gesundheitswesen – Produkte	-	4,33	14,69	-	1,22
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	-	1,21	-	0,83
Wohngebäude-Bauträger	-	-	-	-	0,16
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	0,09
Haushaltswaren	-	-	-	-	-
Versicherung	-	4,70	-	-	1,33
Internet	-	6,02	1,95	-	0,83
Investmentgesellschaften	-	-	1,77	1,32	2,11
Eisen und Stahl	-	-	-	-	0,02
Freizeit	-	-	2,84	-	-
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	-
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	0,29
Maschinen – Diversifiziert	-	9,69	-	-	0,38
Medien	-	-	-	-	0,12
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	0,06
Bergbau	-	-	-	-	0,57
Diverse Fertigungsbetriebe	-	3,41	1,49	-	0,17
Öl und Gas	-	-	2,15	-	7,22
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	1,00	-	0,58

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

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.)					
Verpackung und Container	-	-	-	-	-
Pharmazeutika	-	-	4,49	-	2,14
Pipelines	-	-	-	-	0,76
Immobilien	-	-	-	-	0,26
Einzelhandel	-	5,07	0,96	-	0,32
Halbleiter	-	4,53	4,64	-	0,60
Software	-	12,94	12,07	-	0,84
Telekommunikation	-	-	1,12	-	0,19
Transport	-	-	2,87	-	0,27
Wasser	-	-	-	-	0,02
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	90,63	82,11	93,10	1,35	93,87
Termineinlagen	-	-	-	58,58	-
Sonstiges Nettovermögen	9,37	17,89	6,90	40,07	6,13
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

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

Anlageportfolio zum 30. September 2023

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	% Netto- vermö- gen
Aktien				
China				
7.200	CNH	Contemporary Ampere Technology	200.325	1,89
46.800	CNH	Yizumi Holdings	120.252	1,13
31.300	CNH	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	127.393	1,20
Indonesien			182.446	1,72
468.000	IDR	Bank Mandiri Persero	182.446	1,72
Philippinen				
Philippinen			443.299	4,18
45.420	PHP	BDO Unibank	113.919	1,07
56.300	PHP	International Container Terminal Services	206.190	1,95
316.800	PHP	Wilcon Depot	123.190	1,16
Südkorea				
Südkorea			1.419.913	13,39
161	KRW	Korea Zinc	60.372	0,57
312	KRW	L&F	40.092	0,38
964	KRW	NAVER	143.950	1,36
16.539	KRW	Samsung Electronics	838.350	7,90
748	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	144.400	1,36
508	KRW	Samsung SDI	192.749	1,82
Taiwan				
Taiwan			2.650.459	25,00
15.598	TWD	Advantech	166.705	1,57
67.000	TWD	ASE Technology Holding	227.273	2,14
18.000	TWD	Chroma ATE	153.901	1,45
5.000	TWD	Delta Electronics	50.263	0,47
10.000	TWD	Eclat Textile	150.865	1,42
16.000	TWD	MediaTek	364.307	3,44
23.000	TWD	Merida Industry	124.688	1,18
14.000	TWD	Nien Made Enterprise	134.446	1,27
10.000	TWD	Sinbon Electronics	100.215	0,95
15.750	TWD	Sporton International	123.197	1,16
56.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	907.296	8,56
3.000	TWD	Voltronic Power Technology	147.303	1,39
Summe Aktien			5.144.087	48,51
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			5.144.087	48,51

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
USA				
685.000	USD	United States Treasury Bill 05/10/23, ZCP	684.499	6,46
600.000	USD	United States Treasury Bill 12/10/23, ZCP	598.946	5,65
500.000	USD	United States Treasury Bill 19/10/23, ZCP	498.611	4,70
500.000	USD	United States Treasury Bill 26/10/23, ZCP	498.097	4,70
500.000	USD	United States Treasury Bill 02/11/23, ZCP	497.581	4,69
500.000	USD	United States Treasury Bill 09/11/23, ZCP	497.074	4,69
700.000	USD	United States Treasury Bill 16/11/23, ZCP	695.180	6,55
700.000	USD	United States Treasury Bill 24/11/23, ZCP	694.329	6,55
Summe Anleihen			4.664.317	43,99
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			4.664.317	43,99
Summe Kapitalanlagen			9.808.404	92,50
Sonstiges Nettovermögen			795.400	7,50
Nettoinventarwert			10.603.804	100,00

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA BlueTrend

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
USA				
42.000.000	USD	United States Treasury Note 15/10/23, 0.13%	41.921.423	10,45
41.000.000	USD	United States Treasury Note 15/11/23, 0.25%	40.746.533	10,16
41.000.000	USD	United States Treasury Note 15/12/23, 0.13%	40.567.984	10,12
37.500.000	USD	United States Treasury Note 15/01/24, 0.13%	36.938.019	9,21
34.500.000	USD	United States Treasury Note 15/02/24, 0.13%	33.832.175	8,44
34.000.000	USD	United States Treasury Note 15/03/24, 0.25%	33.222.454	8,29
19.500.000	USD	United States Treasury Note 15/04/24, 0.38%	18.982.526	4,73
12.500.000	USD	United States Treasury Note 15/05/24, 0.25%	12.103.392	3,02
Summe Anleihen			258.314.506	64,42
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			258.314.506	64,42

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
Irland				
858.627.315	USD	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	28.420.565	7,09
Summe Anleihen			28.420.565	7,09
Summe sonstige Wertpapiere			28.420.565	7,09
Summe Kapitalanlagen			286.735.071	71,51
Sonstiges Nettovermögen			114.242.268	28,49
Nettoinventarwert			400.977.339	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Währung						Währung					
Aktien											
Bermuda											
697	USD	Voussoir Re		7.500.417	0,30	20.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/23, variabel		19.782.225	0,80
Supranational											
550	USD	Voussoir Re SideCar		89.100	-	8.250.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variabel		6.967.331	0,28
697	USD	Voussoir Re SideCar-Preference		76.670	-	12.087.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variabel		12.018.406	0,48
530	USD	Voussoir Re SideCar-Preference		601.550	0,03	4.380.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B1 21/04/25, variabel		4.253.418	0,17
557	USD	Voussoir Re SideCar-Preference		60.319.758	2,44	4.750.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C1 21/04/25, variabel		4.644.431	0,19
Summe Aktien				68.587.495	2,77	8.500.000	USD	Kilimanjaro III Re Series B2 20/04/26, variabel		8.056.513	0,32
Anleihen											
Bermuda											
19.450.000	USD	Acorn Re 07/11/24, variabel		19.115.460	0,77	4.100.000	USD	Kilimanjaro III Re Series C2 20/04/26, variabel		3.898.895	0,16
1.667.000	USD	Aquila Re I Series 2023- 1A 08/06/26, variabel		1.689.004	0,07	706.475	USD	Manatee Re III 08/06/26, variabel		141.295	0,01
6.076.000	USD	Aquila Re I Series 2023- 1B 08/06/26, variabel		6.189.621	0,25	25.602.000	USD	Merna Reinsurance II 08/07/24, variabel		25.031.075	1,01
7.971.000	USD	Aquila Re I Series 2023- 1C 08/06/26, variabel		8.252.177	0,33	11.500.000	USD	Montoya Re 07/04/25, variabel		11.732.300	0,47
10.263.000	USD	Baldwin Re 07/07/25, variabel		10.098.022	0,41	28.500.000	USD	Mystic Re IV 08/01/24, variabel		28.398.825	1,14
2.667.000	USD	Blue Halo Re Series A 24/02/25, variabel		2.613.860	0,11	5.000.000	USD	Nakama Re 14/01/25, variabel		5.006.875	0,20
3.500.000	USD	Blue Halo Re Series B 24/02/25, variabel		3.574.900	0,14	14.962.000	USD	Northshore Re II 08/01/24, variabel		14.950.030	0,60
500.000	USD	Bowline Re 23/05/25, variabel		499.488	0,02	10.875.000	USD	Sanders Re II 07/04/24, variabel		10.797.244	0,44
1.487.500	USD	Eden Re II 22/03/24, ZCP		433.011	0,02	9.917.000	USD	Sanders Re II Series A 07/04/25, variabel		9.439.001	0,38
193.872	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP		142.030	0,01	16.447.000	USD	Sanders Re II Series A1 07/04/25, variabel		15.850.796	0,64
24.512.000	USD	Everglades Re II Series A1 14/05/24, variabel		23.846.499	0,96	7.750.000	USD	Sanders Re III Series A 07/06/25, variabel		7.697.106	0,31
28.750.000	USD	Everglades Re II Series A2 14/05/24, variabel		27.671.156	1,12	8.250.000	USD	Sanders Re III Series B 07/06/25, variabel		7.795.219	0,31
22.750.000	USD	Everglades Re II Series B1 14/05/24, variabel		21.594.300	0,87	8.750.000	USD	Sanders Re III 07/04/26, variabel		7.157.938	0,29
9.417.000	USD	Four Lakes Re 07/01/25, variabel		9.125.544	0,37	6.256.000	USD	Tailwind Re Series A 08/01/25, variabel		6.066.756	0,24
24.450.000	USD	Galileo Re Series C 08/01/24, variabel		23.842.418	0,96	12.458.000	USD	Tailwind Re Series B 08/01/25, variabel		11.985.219	0,48
9.650.000	USD	Galileo Re Series D 08/01/24, variabel		9.451.693	0,38	5.152.000	USD	Tailwind Re Series C 08/01/25, variabel		5.052.824	0,20
6.400.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel		6.248.160	0,25	250.000	USD	Tailwind Re Series D 08/01/25, variabel		248.238	0,01
5.000.000	USD	Integrity Re 12/06/28, variabel		4.487.500	0,18	14.500.000	USD	Titania Re 21/06/24, variabel		14.333.975	0,58
12.000.000	USD	Kilimanjaro III Re Series A1 19/12/23, variabel		10.134.300	0,41	17.107.000	USD	Titania Re 27/12/24, variabel		16.442.821	0,66
						9.250.000	USD	Tomoni Re Series A 07/04/26, variabel		9.104.313	0,37
						9.475.000	USD	Tomoni Re Series B 07/04/26, variabel		9.305.161	0,38

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
1.384.000	USD	Voussoir Re 01/03/24, variabel	-	-
Irland			38.662.530	1,56
9.356.000	EUR	Azzurro Re II DAC 17/01/24, variabel	9.895.093	0,40
11.966.000	EUR	Hexagon II Reinsurance DAC 17/01/24, variabel	11.772.438	0,47
16.500.000	USD	Queen Street 2023 Re DAC 08/12/25, variabel	16.994.999	0,69
Singapur			77.797.839	3,14
9.033.000	USD	Easton Re 08/01/24, variabel	9.075.681	0,37
7.750.000	USD	Integrity Re II 12/04/28, variabel	5.231.250	0,21
6.250.000	USD	Kizuna Re III 07/04/26, variabel	6.189.063	0,25
46.075.000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	45.977.090	1,85
4.012.000	USD	Phoenix 3 Re 04/01/29, ZCP	4.449.463	0,18
11.500.000	NZD	Totara Re 08/06/27, 13.39%	6.875.292	0,28
Supranational			47.664.771	1,92
17.500.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 29/12/23, variabel	17.538.062	0,71
2.763.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 13/03/24, variabel	2.760.099	0,11
5.050.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 13/03/24, variabel	5.037.375	0,20
6.700.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series C 13/03/24, variabel	6.645.060	0,27
4.750.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series D 13/03/24, variabel	4.679.938	0,19
10.750.000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 31/03/26, variabel	11.004.237	0,44
Summe Anleihen			629.292.513	25,37
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			697.880.008	28,14

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				
Bermuda			1.215.403.214	49,02
7.308.000	USD	2001 Cat Re 08/01/24, variabel	7.297.952	0,29
36.059.000	USD	Alamo Re 07/06/24, variabel	35.682.182	1,45
8.432.000	USD	Alamo Re 07/06/26, variable	8.587.781	0,35
2.450.000	USD	Artex 17/01/25, variabel	-	-
2.761.000	USD	Baldwin Re 07/07/27, variabel	2.745.262	0,11
4.600.000	USD	Bayou Re Series A 26/05/26, variabel	4.660.605	0,19
2.000.000	USD	Bayou Re Series B 26/05/26, variabel	2.075.850	0,08
19.855.000	USD	Bonanza Re 20/02/24, variabel	18.896.004	0,76
18.996.000	USD	Bonanza Re 23/12/24, variabel	17.112.547	0,69
12.250.000	USD	Bonanza Re 16/03/25, variabel	9.187.500	0,37
6.750.000	USD	Bonanza Re 08/01/26, variabel	6.800.288	0,27
3.333.000	USD	Bowline Re Series 2022-1 23/05/25, variabel	3.335.750	0,13
24.917.000	USD	Cape Lookout Re 22/03/24, variabel	24.599.930	0,99
10.000.000	USD	Cape Lookout Re 28/03/25, variabel	9.708.000	0,39
9.905.000	USD	Cape Lookout Re 28/04/26, variabel	10.094.928	0,41
6.750.000	USD	Citrus Re 07/06/25, variabel	6.680.981	0,27
7.500.000	USD	Citrus Re Series A 07/06/26, variabel	7.664.250	0,31
5.000.000	USD	Citrus Re Series B 07/06/26, variabel	5.026.375	0,20
10.833.000	USD	Commonwealth Re 08/07/25, variabel	10.902.602	0,44
6.546.000	USD	Commonwealth Re 08/07/26, variabel	6.641.735	0,27
526.606	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP	235.920	0,01
1.077.899	USD	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP	481.821	0,02
2.819.160	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	2.106.194	0,08
1.500.000	USD	Eden Re II Series A 19/03/27, ZCP	1.559.850	0,06
10.000.000	USD	Eden Re II Series B 19/03/27, ZCP	10.399.000	0,42
26.762.000	USD	Everglades Re II 16/01/24, ZCP	25.684.829	1,04
18.282.000	USD	Everglades Re II Series A 16/01/24, ZCP	17.482.163	0,70

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
7.750.000	USD	Everglades Re II 19/05/25, variabel	7.426.050	0,30	7.500.000	USD	Matterhorn Re 08/01/24, variabel	6.268.313	0,25
1.250.000	USD	Finca Re 06/06/25, variabel	1.286.688	0,05	4.257.000	USD	Matterhorn Re 07/06/24, variabel	4.344.907	0,18
34.654.000	USD	FloodSmart Re Series A 01/03/24, variabel	34.679.990	1,41	7.750.000	USD	Matterhorn Re 24/03/25, variabel	7.714.156	0,31
5.625.000	USD	FloodSmart Re Series B 01/03/24, variabel	4.789.406	0,19	11.500.000	USD	Matterhorn Re Series A 24/03/25, variabel	11.248.438	0,45
25.020.000	USD	FloodSmart Re Series A 25/02/25, variabel	24.107.395	0,97	14.250.000	USD	Matterhorn Re 08/12/25, variabel	12.972.131	0,52
8.750.000	USD	FloodSmart Re Series B 25/02/25, variabel	8.742.781	0,35	7.600.000	USD	Matterhorn Re 25/01/27, variabel	7.621.108	0,31
2.250.000	USD	FloodSmart Re Series C 25/02/25, variabel	2.208.150	0,09	5.250.000	USD	Mayflower Re Series A 08/07/26, variabel	5.309.588	0,21
17.708.000	USD	FloodSmart Re Series A 11/03/26, variabel	18.337.519	0,74	4.750.000	USD	Mayflower Re Series B 08/07/26, variabel	4.836.213	0,20
4.500.000	USD	FloodSmart Re Series B 11/03/26, variabel	4.721.738	0,19	20.144.000	USD	Merna Reinsurance II 05/04/24, variabel	20.095.150	0,81
7.917.000	USD	Four Lakes Re 07/01/26, variabel	7.938.772	0,32	15.000.000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/25, variabel	15.027.750	0,61
3.806.744	USD	Frontline Re 06/07/26, variabel	2.093.709	0,08	12.000.000	USD	Merna Reinsurance II Series 2 07/07/25, variabel	11.330.400	0,46
7.680.000	USD	Gateway Re II 27/04/26, variabel	7.792.128	0,31	19.000.000	USD	Merna Reinsurance II Series 3 07/07/25, variabel	19.271.225	0,78
5.000.000	USD	Herbie Re 08/07/24, variabel	5.046.750	0,20	9.091.000	USD	Merna Reinsurance II Series A 07/07/26, variabel	9.236.911	0,37
3.833.000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	3.771.768	0,15	9.091.000	USD	Merna Reinsurance II Series B 07/07/26, variabel	9.708.733	0,39
9.250.000	USD	Hestia Re 22/04/25, variabel	9.028.231	0,36	3.750.000	USD	MetroCat Re 08/05/26, variabel	3.727.594	0,15
1.866.569	USD	Herbie Re 08/01/26, variabel	1.119.941	0,05	23.750.000	USD	Mona Lisa Re 08/07/25, variabel	23.286.874	0,94
6.000.000	USD	Herbie Re 08/01/27, variabel	6.424.950	0,26	8.250.000	USD	Mona Lisa Re Series A 08/01/26, variabel	8.847.713	0,36
6.758.000	USD	Hypatia 08/04/26, variabel	7.050.452	0,28	6.671.000	USD	Mona Lisa Re Series B 08/01/26, variabel	7.154.147	0,29
6.750.000	USD	Integrity Re 06/06/25, variabel	6.216.919	0,25	8.462.000	USD	Montoya Re 07/04/26, variabel	9.124.152	0,37
8.691.000	USD	Integrity Re Series A 06/06/25, variabel	9.118.380	0,37	10.500.000	USD	Mountain Re 05/06/26, variabel	10.668.263	0,43
3.000.000	USD	Kendall Re 02/05/24, variabel	2.980.275	0,12	13.250.000	USD	Mystic Re IV Series A 08/01/25, variabel	12.845.213	0,52
7.857.000	USD	Kilimanjaro III Re 21/04/25, variabel	7.538.399	0,30	500.000	USD	Mystic Re IV Series B 08/01/25, variabel	491.250	0,02
23.344.000	USD	Kilimanjaro III Re 25/06/25, variabel	23.347.501	0,94	14.250.000	USD	Mystic Re IV 08/01/26, variabel	14.598.413	0,59
10.464.000	USD	Kilimanjaro III Re 20/04/26, variabel	9.832.236	0,40	6.602.000	USD	Nakama Re Series 1 09/05/28, variabel	6.584.175	0,27
9.906.000	USD	Locke Tavern Re 09/04/26, variabel	10.091.490	0,41	8.111.000	USD	Nakama Re Series 2 09/05/28, variabel	8.198.599	0,33
5.000.000	USD	Lower Ferry Re Series A 08/07/26, variabel	5.047.250	0,20	9.418.000	USD	Northshore Re II 08/07/25, variabel	9.482.042	0,38
9.750.000	USD	Lower Ferry Re Series B 08/07/26, variabel	9.900.150	0,40					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	
8.491.000	USD	Phoenician Re 14/12/23, variabel	8.479.537	0,34	19.250.000	USD	Torrey Pines Re Series B 07/06/24, variabel	18.887.138	0,76	
16.000.000	USD	Phoenician Re Series A 14/12/23, variabel	15.964.400	0,64	9.500.000	USD	Torrey Pines Re Series A 06/06/25, variabel	9.508.788	0,38	
13.000.000	USD	Phoenician Re 14/12/24, variabel	12.822.875	0,52	5.000.000	USD	Torrey Pines Re Series B 06/06/25, variabel	4.909.125	0,20	
5.000.000	USD	Power Protective Re 15/12/23, variabel	4.947.250	0,20	8.333.000	USD	Torrey Pines Re Series A 05/06/26, variabel	8.450.079	0,34	
2.250.000	USD	Power Protective Re 09/10/24, variabel	2.212.875	0,09	2.625.000	USD	Torrey Pines Re Series B 05/06/26, variabel	2.610.300	0,11	
3.286.000	USD	Purple Re 24/04/26, variabel	3.325.761	0,13	21.366.000	USD	Ursa Re II 06/12/24, variabel	20.630.474	0,83	
5.653.000	USD	Purple Re 05/06/26, variabel	5.699.779	0,23	41.725.000	USD	Ursa Re II Series AA 07/12/23, variabel	41.672.843	1,69	
10.000.000	EUR	Randolph Re 15/06/24, ZCP	10.006.871	0,40	16.700.000	USD	Ursa Re II Series D 07/12/23, variabel	16.655.328	0,67	
23.000.000	USD	Riverfront Re Series A 07/01/25, variabel	22.104.149	0,89	10.500.000	USD	Ursa Re II Series A 16/06/25, variabel	10.478.213	0,42	
5.750.000	USD	Riverfront Re Series B 07/01/25, variabel	5.281.950	0,21	5.250.000	USD	Ursa Re II Series E 16/06/25, variabel	5.149.200	0,21	
19.872.000	USD	Sakura Re Series A 07/04/25, variabel	19.778.104	0,80	17.500.000	USD	Ursa Re II Series AA 06/12/25, variabel	18.250.313	0,74	
18.792.000	USD	Sakura Re Series B 07/04/25, variabel	18.372.938	0,74	11.250.000	USD	Ursa Re II Series C 06/12/25, variabel	11.785.500	0,48	
11.500.000	USD	Sakura Re 05/01/26, variabel	12.235.713	0,49	8.173.000	USD	Ursa Re Series AA 06/12/25, variabel	8.260.655	0,33	
2.651.542	USD	Sanders Re II 07/04/26, variabel	20.085	-	2.419.000	USD	Ursa Re Series C 06/12/25, variabel	2.436.659	0,10	
12.050.000	USD	Sanders Re III 07/04/26, variabel	11.435.149	0,46	6.000.000	USD	Veraison Re 09/03/26, variabel	6.340.650	0,26	
11.750.000	USD	Sanders Re III 05/06/26, variabel	12.211.481	0,49	6.875.000	USD	Wrigley Re Series A 07/08/26, variabel	6.913.672	0,28	
5.156.000	USD	Sanders Re III 07/04/27, variabel	5.121.584	0,21	8.565.000	USD	Wrigley Re Series B 07/08/26, variabel	8.661.785	0,35	
10.000.000	USD	Sanders Re III Series A 07/04/27, variabel	10.089.500	0,41	Kaimaninseln				164.200.833	6,62
14.500.000	USD	Sierra Series A 31/01/24, variabel	14.453.600	0,58	1.092.500	USD	Caelus Re V Series B 05/06/24, variabel	942.281	0,04	
3.500.000	USD	Sierra Series B 31/01/24, variabel	3.477.863	0,14	3.747.995	USD	Caelus Re V Series C 05/06/24, variabel	552.829	0,02	
4.079.000	USD	Solomon Re 08/06/26, variabel	4.155.379	0,17	11.550.000	USD	Caelus Re VI 07/06/24, variabel	11.283.484	0,46	
3.375.000	USD	Stabilitas Re 05/06/26, variabel	3.460.978	0,14	4.500.000	USD	Long Point Re IV 01/06/26, variabel	4.486.500	0,18	
15.000.000	USD	Sutter Re Series B 19/06/26, variabel	15.171.000	0,61	7.062.000	USD	Residential Reinsurance 2019 06/12/23, variabel	6.953.422	0,28	
11.781.000	USD	Sutter Re Series E 19/06/26, variabel	11.850.213	0,48	2.000.000	USD	Residential Reinsurance 2019 06/06/26, variabel	1.500.000	0,06	
2.708.000	USD	Titania Re 27/02/26, variabel	2.933.983	0,12	6.154.000	USD	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variabel	6.151.692	0,25	
3.750.000	USD	Topanga Re 08/01/26, variabel	3.364.125	0,14	5.484.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variabel	5.456.854	0,22	
19.000.000	USD	Torrey Pines Re Series A 07/06/24, variabel	18.542.575	0,75	5.000.000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variabel	4.930.125	0,20	

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens	
4.250.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 11 06/06/25, variabel	3.621.850	0,15	18.500.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity 06/06/25, variabel	18.882.025	0,76	
5.535.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 12 06/06/25, variabel	4.515.730	0,18	19.500.000	EUR	Lion III Re DAC 16/07/25, variabel	20.114.366	0,81	
4.642.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 13 06/06/25, variabel	4.172.810	0,17	5.250.000	EUR	Orange Capital Re DAC 17/01/25, variabel	5.424.426	0,22	
6.500.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 14 06/06/25, variabel	6.191.250	0,25	7.269.000	EUR	Windmill II Re DAC 05/07/24, variabel	7.646.724	0,31	
14.416.667	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 2 06/12/25, variabel	13.876.763	0,56	Singapur				82.995.048	3,35
4.310.000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 3 06/12/25, variabel	4.042.888	0,16	4.000.000	USD	Astro Re 08/07/25, variabel	3.400.000	0,14	
6.300.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 13 06/06/26, variabel	5.561.010	0,22	9.750.000	USD	Catahoula II Re Series A 16/06/25, variabel	9.584.006	0,39	
2.950.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 14 06/06/26, variabel	2.796.526	0,11	5.250.000	USD	Catahoula II Re Series B 16/06/25, variabel	5.287.931	0,21	
3.750.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 3 06/12/26, variabel	3.919.031	0,16	11.466.000	USD	First Coast Re III 07/04/25, variabel	11.205.435	0,45	
8.500.000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 5 06/12/26, variabel	8.538.250	0,34	7.973.000	USD	First Coast Re IV 07/04/26, variabel	8.009.277	0,32	
10.117.000	USD	Vitality Re XI Series A 09/01/24, variabel	10.104.607	0,41	8.957.000	EUR	Hexagon III Re 15/01/26, variabel	8.759.554	0,35	
5.000.000	USD	Vitality Re XI Series B 09/01/24, variabel	4.969.375	0,20	5.000.000	EUR	Hexagon III Re Series CAT 15/01/26, variabel	5.048.369	0,20	
12.044.000	USD	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variabel	11.973.844	0,48	17.714.000	USD	Nakama Re Series 2 13/10/26, variabel	17.388.948	0,71	
6.000.000	USD	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variabel	5.894.250	0,24	3.000.000	USD	Phoenix 2 Re 04/01/28, ZCP	3.328.140	0,13	
8.148.000	USD	Vitality Re XIII Series A 06/01/26, variabel	8.004.392	0,32	625.000	USD	Phoenix 2 Re Series 22-1 04/01/28, ZCP	887.938	0,04	
4.000.000	USD	Vitality Re XIII Series B 06/01/26, variabel	3.867.500	0,16	5.000.000	USD	Umigame Re Series A1 07/04/25, variabel	4.901.250	0,20	
14.000.000	USD	Vitality Re XIV Series A 05/01/27, variabel	14.337.049	0,58	2.750.000	USD	Umigame Re Series A2 07/04/25, variabel	2.713.700	0,11	
5.550.000	USD	Vitality Re XIV Series B 05/01/27, variabel	5.556.521	0,22	2.500.000	USD	Umigame Re Series B1 07/04/25, variabel	2.480.500	0,10	
China			3.266.250	0,13	Vereinigtes Königreich				28.748.913	1,16
3.250.000	USD	Great Wall Re 05/01/26, variabel	3.266.250	0,13	29.750.000	USD	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variabel	28.748.913	1,16	
Hongkong			11.460.046	0,46	USA				96.010.529	3,87
11.558.000	USD	Black Kite Re 09/06/25, variabel	11.460.046	0,46	6.315.000	USD	Cosaint Re 03/04/24, variabel	5.492.156	0,22	
Irland			70.828.797	2,86	5.500.000	USD	Gateway Re 12/05/25, variabel	5.405.263	0,22	
18.425.000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variabel	18.761.256	0,76	20.666.000	USD	Gateway Re Series A 24/02/26, variabel	21.790.229	0,87	
					4.500.000	USD	Gateway Re Series B 24/02/26, variabel	4.634.100	0,19	
					507.548	USD	JGWPT XXV 15/02/67, 7.14%	491.653	0,02	
					8.000.000	USD	Lightning Re 31/03/26, variabel	8.380.400	0,34	
					5.250.000	USD	Logistics Re 20/12/24, variabel	5.156.156	0,21	

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
8.500.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 13 06/06/27, variabel	8.324.475	0,34
17.300.000	USD	Residential Reinsurance 2023 Series 14 06/06/27, variabel	17.200.957	0,68
1.375.446	USD	Security First Managers 25/02/25, variabel	1.375.446	0,06
13.903.000	USD	Vista Re 21/05/24, variabel	13.877.975	0,56
3.750.000	USD	Vista Re 21/05/25, variabel	3.881.719	0,16
Summe Anleihen			1.672.913.630	67,47
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			1.672.913.630	67,47

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen				
Bermuda			88.231	-
891.964	USD	Pelican IV Re Series A 07/05/24, variabel	4.750	-
4.750.000	USD	Pelican IV Re Series B 07/05/24, variabel	83.481	-
USA			13.972.595	0,56
13.099.432	USD	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5.96%	12.522.009	0,50
2.400	USD	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP	-	-
1.836.184	USD	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP	1.450.586	0,06
Summe Anleihen			14.060.826	0,56
Summe sonstige Wertpapiere			14.060.826	0,56
Summe Kapitalanlagen			2.384.854.464	96,17
Sonstiges Nettovermögen			95.003.822	3,83
Nettoinventarwert			2.479.858.286	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (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				
USA				
56.964	USD	Activision Blizzard	5.333.539	3,46
7.485	USD	Adobe	3.816.602	2,48
30.386	USD	AppLovin	1.214.225	0,79
46.682	USD	Block	2.066.145	1,34
6.465	USD	Broadcom	5.369.700	3,49
97.581	USD	CCC Intelligent Solutions Holdings	1.302.706	0,85
229.786	USD	Endeavor Group Holdings	4.572.741	2,97
85.757	USD	Marvell Technology	4.642.026	3,02
124.542	USD	Match Group	4.878.933	3,17
25.100	USD	Meta Platforms	7.535.271	4,90
29.990	USD	Microsoft	9.469.343	6,15
11.235	USD	MongoDB	3.885.737	2,52
23.900	USD	Netflix	9.024.640	5,86
83.735	USD	New Relic	7.169.391	4,66
120.475	USD	News	2.416.729	1,57
800	USD	NVIDIA	347.992	0,23
101.355	USD	Oracle	10.735.521	6,98
170.963	USD	Pinterest	4.621.130	3,00
94.554	USD	Semtech	2.434.766	1,58
57.654	USD	Spotify Technology	8.915.615	5,79
199.049	USD	Trimble	10.720.778	6,96
57.300	USD	Twilio	3.353.769	2,18
150.764	USD	Unity Software	4.732.482	3,07
255.217	USD	Western Union	3.363.760	2,19
228.010	USD	Zillow Group	10.524.942	6,84
Summe Aktien			132.448.483	86,05
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			132.448.483	86,05
Summe Kapitalanlagen			132.448.483	86,05
Sonstiges Nettovermögen			21.478.210	13,95
Nettoinventarwert			153.926.693	100,00

Schroder GAIA Egerton Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpa- piere und Geldmarkt- instrumente, die zu einer amtlichen Börsennotie- rung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% Netto- vermö- gen
Aktien				
Bermuda				
47.772	USD	RenaissanceRe Holdings	8.943.045	2,18
Kanada				
161.491	CAD	Canadian National Railway	16.541.468	4,03
525.185	CAD	Canadian Pacific Kansas City	36.923.617	8,99
743.665	CAD	Cenovus Energy	14.645.336	3,57
Dänemark				
116.090	DKK	Novo Nordisk	10.022.415	2,44
Frankreich				
56.326	EUR	Safran	8.372.297	2,04
Deutschland				
66.398	EUR	Münchener Rückversicherungs-Gesellschaft in München	24.507.502	5,97
Indien				
96.383	USD	HDFC Bank	5.379.580	1,31
285.633	USD	ICICI Bank	6.246.238	1,52
Niederlande				
33.117	USD	Shell	2.016.621	0,49
Vereinigtes Königreich				
1.068.600	HKD	HSBC Holdings	7.963.577	1,94
USA				
155.064	USD	Alphabet	19.338.083	4,71
17.065	USD	Amazon.com	2.051.835	0,50
50.970	USD	Arch Capital Group	3.842.817	0,94
4.108	USD	Booking Holdings	11.982.849	2,92
7.605	USD	Everest Re Group	2.673.493	0,65
10.970	USD	First Citizens BancShares	14.319.884	3,49
125.785	USD	Fiserv	13.439.275	3,27
142.232	USD	General Electric	14.872.308	3,62
21.939	USD	Hilton Worldwide Holdings	3.116.386	0,76
44.557	USD	KKR	2.596.085	0,63
43.358	USD	Mastercard	16.236.336	3,95
80.243	USD	Meta Platforms	22.785.292	5,55
44.203	USD	Microsoft	13.201.322	3,22
342.430	USD	Schlumberger	18.882.638	4,60
112.927	USD	Visa	24.567.830	5,98
Summe Aktien			325.468.129	79,27
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			325.468.129	79,27
Summe Kapitalanlagen			325.468.129	79,27
Sonstiges Nettovermögen			85.101.466	20,73
Nettoinventarwert			410.569.595	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Helix

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen		
Aktien					286.474	CNH	Midea Group	2.181.462	0,74		
Bahrain					135.452	CNH	NARI Technology	412.542	0,14		
340.332	BHD	Aluminium Bahrain BSC	988.497	0,33	26.800	CNH	Ping An Insurance Group of China	177.667	0,06		
Brasilien					16.691.778	5,63	545.000	CNH	Sany Heavy Industry	1.188.629	0,40
48.000	BRL	Arezzo Industria e Comercio	622.968	0,21	72.200	CNH	Shandong Sinocera Functional Material	270.834	0,09		
457.300	BRL	B3 – Brasil Bolsa Balcao	1.122.876	0,38	125.708	CNH	Shenzhen Inovance Technology	1.147.216	0,39		
469.762	BRL	Banco Bradesco	1.342.124	0,45	121.100	HKD	Shenzhou International Group Holdings	1.159.689	0,39		
829.000	BRL	Cia Paranaense de Energia	1.392.929	0,47	82.700	CNH	Suzhou Dongshan Precision Manufacturing	196.825	0,07		
365.400	BRL	Embraer	1.257.130	0,42	24.211	CNY	Suzhou Everbright Photonics	216.485	0,07		
734.451	BRL	Gerdau	3.540.777	1,20	34.056	CNH	Thunder Software Technology	357.913	0,12		
626.073	BRL	Itausa	1.132.015	0,38	105.800	CNH	Venustech Group	410.087	0,14		
44.400	BRL	Klabin	211.213	0,07	66.900	CNH	Wanhua Chemical Group	810.981	0,27		
151.600	BRL	PRIO	1.424.771	0,48	29.800	CNH	Wuliangye Yibin	638.476	0,22		
328.768	BRL	Raia Drogasil	1.814.228	0,62	54.900	CNH	WuXi AppTec	649.388	0,22		
23.800	BRL	Rede D'Or Sao Luiz	120.826	0,04	27.000	HKD	Wuxi Biologics Cayman	157.377	0,05		
121.900	BRL	Suzano	1.321.972	0,45	17.900	CNH	Wuxi Lead Intelligent Equipment	66.875	0,02		
234.600	BRL	Vivara Participacoes	1.258.962	0,42	27.866	CNH	Xiamen Faratronic	370.731	0,12		
17.800	BRL	WEG	128.987	0,04	95.000	CNH	Xuji Electric	252.829	0,09		
China					20.252.630	6,83	276.384	CNH	Yizumi Holdings	711.279	0,24
4.662	USD	Alibaba Group Holding	404.382	0,14	90.600	CNH	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	369.326	0,12		
16.100	CNH	Bafang Electric Suzhou	126.643	0,04	103.500	HKD	Zylox-Tonbridge Medical Technology	103.608	0,03		
114.000	HKD	China Mengniu Dairy	382.094	0,13	Kolumbien						
45.600	HKD	China Pacific Insurance Group	114.119	0,04	38.688	COP	Banco Davivienda	167.337	0,06		
125.596	CNH	Contemporary Amperex Technology	3.499.950	1,18	Georgien						
206.660	CNH	East Money Information	431.147	0,15	43.938	GBP	TBC Bank Group	1.600.811	0,54		
40.800	CNH	Estun Automation	123.535	0,04	Deutschland						
26.944	CNH	Foshan Haitian Flavouring & Food	140.494	0,05	4.735	EUR	Dr Ing hc F Porsche	446.173	0,15		
167.900	CNH	Foxconn Industrial Internet	453.986	0,15	404	EUR	Schott Pharma	13.534	-		
33.920	CNH	Gongniu Group	482.885	0,16	Griechenland						
6.552	USD	H World Group	258.345	0,09	406.140	EUR	National Bank of Greece	2.296.204	0,78		
12.300	CNH	Hithink RoyalFlush Information Network	252.322	0,09	406.068	EUR	Piraeus Financial Holdings	1.208.088	0,41		
65.416	CNH	Hongfa Technology	301.233	0,10	8.481	EUR	Terna Energy	131.546	0,04		
122.000	CNH	Hualan Biological Engineering	371.739	0,13	Hongkong						
12.100	HKD	JD.com	177.826	0,06	21.800	HKD	AIA Group	177.727	0,06		
2.700	CNH	Kweichow Moutai	666.518	0,22	Ungarn						
9.512	CNH	Leader Harmonious Drive Systems	154.161	0,05	28.001	HUF	OTP Bank	1.015.367	0,34		
16.300	CNH	LONGi Green Energy Technology	61.032	0,02							

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
86.225	HUF	Richter Gedeon	2.095.814	0,71
Indonesien			2.528.914	0,85
821.600	IDR	Bank BTPN Syariah	101.271	0,03
34.500	IDR	Bank Central Asia	19.700	0,01
5.067.300	IDR	Bank Mandiri Persero	1.975.445	0,66
238.600	IDR	Bank Rakyat Indonesia Persero	80.665	0,03
1.825.900	IDR	Industri Jamu Dan Farmasi Sido Muncul	69.704	0,02
608.400	IDR	Mitra Keluarga Karyasehat	106.288	0,04
724.700	IDR	Telkom Indonesia Persero	175.841	0,06
Italien			5.256.561	1,77
4.124	EUR	Ariston Holding	26.918	0,01
97.804	EUR	Eni	1.579.758	0,53
59	EUR	Ferrari	17.472	0,01
70.470	EUR	FinecoBank Banca Fineco	859.135	0,29
2.681	EUR	Industrie De Nora	46.211	0,02
248.850	EUR	Intesa Sanpaolo	642.867	0,22
55.068	EUR	Iveco Group	516.683	0,17
1.631	EUR	Moncler	95.113	0,03
474	EUR	Philogen	8.306	-
998	EUR	Prysmian	40.311	0,01
13.563	EUR	Terna-Rete Elettrica Nazionale	102.357	0,03
54.910	EUR	UniCredit	1.321.430	0,45
Japan			66.615	0,02
4.600	JPY	Integral	66.615	0,02
Kasachstan			1.891.943	0,64
128.074	USD	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	1.708.507	0,58
1.895	USD	Kaspi.KZ	183.436	0,06
Kenia			114.892	0,04
1.158.300	KES	Safaricom	114.892	0,04
Mexiko			3.753.524	1,27
2.073.358	MXN	Gentera	2.439.807	0,83
115.200	MXN	Grupo Aeroportuario del Centro Norte	1.255.841	0,42
27.800	MXN	Orbia Advance	57.876	0,02
Peru			102.556	0,03
4.554	USD	Intercorp Financial Services	102.556	0,03
Philippinen			6.472.642	2,18
5.464.300	PHP	Ayala Land	2.844.380	0,95

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
268.430	PHP	BDO Unibank	673.258	0,23
330.920	PHP	International Container Terminal Services	1.211.938	0,41
1.986.800	PHP	Puregold Price Club	1.014.892	0,34
1.872.600	PHP	Wilcon Depot	728.174	0,25
Polen			3.659.438	1,23
88.734	PLN	Grupa Pracuj	1.158.713	0,39
10.577	PLN	KRUK	1.003.168	0,34
244	PLN	LPP	726.681	0,24
81.337	PLN	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	770.876	0,26
Rumänien			1.363.321	0,46
140.058	RON	Banca Transilvania	658.851	0,22
27.580	RON	Societatea De Producere A Energiei Electrice in Hidrocentrale Hidroelectrica	704.470	0,24
Slowenien			3.522.817	1,19
231.065	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	3.522.817	1,19
Südafrika			5.137.330	1,73
19.566	ZAR	Capitec Bank Holdings	1.782.526	0,59
10.456	ZAR	Clicks Group	143.553	0,05
1.615.165	ZAR	Netcare	1.157.400	0,39
127.172	ZAR	Shoprite Holdings	1.618.997	0,55
53.388	ZAR	Tiger Brands	434.854	0,15
Südkorea			24.776.790	8,35
27.605	KRW	Hankook Tire & Technology	810.107	0,27
179	KRW	Hyundai Motor	25.350	0,01
3.147	KRW	KB Financial Group	128.968	0,04
9.235	KRW	Koh Young Technology	84.726	0,03
779	KRW	Korea Zinc	292.111	0,10
1.961	KRW	L&F	251.992	0,08
1.273	KRW	LG Chem	468.389	0,16
364	KRW	LG Chem – Preference	84.162	0,03
5.679	KRW	NAVER	848.020	0,29
9.664	KRW	Samsung Electro- Mechanics	984.018	0,33
274.038	KRW	Samsung Electronics	13.890.765	4,69
55.040	KRW	Samsung Electronics – Preference	2.222.973	0,75
10.332	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	1.994.580	0,67
6.514	KRW	Samsung SDI	2.471.592	0,83
5.684	KRW	SK Telecom	219.037	0,07

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Schweiz			175.056	0,06
7.470	GBP	Wizz Air Holdings	175.056	0,06
Taiwan			41.829.620	14,09
92.059	TWD	Advantech	983.887	0,33
498.000	TWD	ASE Technology Holding	1.689.286	0,57
108.000	TWD	Chroma ATE	923.406	0,31
166.000	TWD	Chunghwa Telecom	596.521	0,20
146.000	TWD	CTBC Financial Holding	110.810	0,04
14.250	TWD	Dadi Early-Childhood Education Group	33.991	0,01
51.000	TWD	Delta Electronics	512.678	0,17
59.000	TWD	Eclat Textile	890.104	0,30
38.000	TWD	Giant Manufacturing	210.127	0,07
539.000	TWD	Hon Hai Precision Industry	1.736.528	0,59
214.000	TWD	MediaTek	4.872.601	1,64
256.000	TWD	Merida Industry	1.387.835	0,47
150.000	TWD	Nien Made Enterprise	1.440.498	0,49
5.000	TWD	Novatek Microelectronics	65.519	0,02
211.000	TWD	Sinbon Electronics	2.114.543	0,71
92.187	TWD	Sporton International	721.092	0,24
1.355.000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	21.953.346	7,40
66.000	TWD	Uni-President Enterprises	143.325	0,05
412.000	TWD	United Microelectronics	576.893	0,19
17.650	TWD	Voltronic Power Technology	866.630	0,29
Thailand			525.453	0,18
69.900	THB	Kasikornbank	241.879	0,08
50.700	THB	Kasikornbank-XDR	175.440	0,06
504.800	THB	Land & Houses	108.134	0,04
Vereinigte Arabische Emirate			1.068.294	0,36
560.557	AED	Emaar Development	1.068.294	0,36
Vereinigtes Königreich			1.137.580	0,38
14.721	EUR	CNH Industrial	179.861	0,06
206.546	PLN	Pepco Group	957.719	0,32
USA			3.963.787	1,34
22.783	USD	ARM Holdings	1.219.346	0,41
149.100	MXN	GCC	1.407.650	0,47
1.762	USD	Mastercard	697.593	0,24
2.779	USD	Visa	639.198	0,22

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Vietnam			173.708	0,06
56.900	VND	Vietnam Dairy Products	173.708	0,06
Summe Aktien			154.606.347	52,11
Anleihen				
Brasilien			1.130.346	0,38
2.096.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10.00%	408.454	0,14
1.610.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/31, 10.00%	307.560	0,10
2.210.000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/33, 10.00%	414.332	0,14
Kolumbien			592.052	0,20
1.580.000.000	COP	Colombian TES 26/03/31, 7.00%	306.317	0,10
642.800.000	COP	Colombian TES 09/02/33, 13.25%	171.736	0,06
734.700.000	COP	Colombian TES 26/10/50, 7.25%	113.999	0,04
Tschechische Republik			339.631	0,11
570.000	EUR	CPI Property Group 27/01/31, 1.50%	339.631	0,11
El Salvador			153.104	0,05
200.000	USD	El Salvador Government International Bond 15/07/52, 9.50%	153.104	0,05
Ungarn			321.805	0,11
140.000.000	HUF	Hungary Government Bond 27/10/27, 3.00%	321.805	0,11
Elfenbeinküste			525.305	0,18
470.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5.88%	412.098	0,14
140.000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 30/01/32, 4.88%	113.207	0,04
Mexiko			698.592	0,24
2.700.000	MXN	Mexican Bonos 18/11/38, 8.50%	137.042	0,05
6.410.000	MXN	Mexican Bonos 13/11/42, 7.75%	297.290	0,10
2.570.000	MXN	Mexican Bonos 07/11/47, 8.00%	121.760	0,04
2.900.000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/11/26, 7.47%	142.500	0,05
Nigeria			472.324	0,16
550.000	USD	Nigeria Government International Bond 24/03/29, 8.38%	472.324	0,16

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Russland				
38.000.000	RUB	Russian Federal Bond – OFZ 23/03/33, 7.70%	116.803	0,04
Südafrika				
6.500.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	281.676	0,10
2.890.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	121.141	0,04
1.730.000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8.50%	67.265	0,02
Supranational				
20.000.000	ARS	European Bank for Reconstruction & Development 28/05/24, 175.00%	49.756	0,02
Türkei				
200.000	USD	Pegasus Hava Tasimaciligi 30/04/26, 9.25%	202.538	0,07
250.000	USD	Turkey Government International Bond 16/04/43, 4.88%	159.093	0,05
Ukraine				
330.000	USD	VF Ukraine PAT via VFU Funding 11/02/25, 6.20%	249.150	0,08
Summe Anleihen			5.480.581	1,85
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			160.086.928	53,96

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
Brasilien				
241.563	USD	MC Brazil Downstream Trading 30/06/31, 7.25%	185.567	0,06
Burkina Faso				
380.000	USD	Endeavour Mining 14/10/26, 5.00%	340.101	0,12
USA				
1.000.000	USD	United States Treasury Bill 05/10/23, ZCP	999.272	0,34
10.000.000	USD	United States Treasury Bill 12/10/23, ZCP	9.982.487	3,36
10.000.000	USD	United States Treasury Bill 19/10/23, ZCP	9.972.265	3,36
10.000.000	USD	United States Treasury Bill 26/10/23, ZCP	9.962.130	3,36

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
10.000.000	USD	United States Treasury Bill 09/11/23, ZCP	9.941.483	3,35
10.000.000	USD	United States Treasury Bill 16/11/23, ZCP	9.931.139	3,35
10.000.000	USD	United States Treasury Bill 30/11/23, ZCP	9.911.270	3,34
10.000.000	USD	United States Treasury Bill 07/12/23, ZCP	9.899.785	3,34
1.000.000	USD	United States Treasury Bill 18/01/24, ZCP	983.803	0,33
Summe Anleihen			72.109.302	24,31
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			72.109.302	24,31

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Luxemburg				
100.000	USD	Schroder GAIA Asian Equity Long Short	10.616.000	3,58
6.139	USD	Schroder ISF – China A	798.693	0,27
2.884	USD	Schroder ISF Emerging Markets Value	442.865	0,15
17.893	USD	Schroder ISF Indian Equity	6.616.386	2,23
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen			18.473.944	6,23

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Britische Jungferninseln				
100.339	USD	Noventiq Holdings	-	-
Summe Anleihen			-	-
Summe sonstige Wertpapiere			-	-
Summe Kapitalanlagen			250.670.174	84,50
Sonstiges Nettovermögen			45.993.106	15,50
Nettoinventarwert			296.663.280	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
Argentinien				
775.000	USD	YPF 27/06/29, 8.50%	626.023	0,90
250.000	USD	YPF Energia Electrica 25/07/26, 10.00%	233.770	0,34
Belgien				
100.000	EUR	Telenet Finance Luxembourg Notes 01/03/28, 3.50%	98.478	0,14
Kanada				
200.000	EUR	Primo Water Holdings 31/10/28, 3.88%	190.710	0,27
Frankreich				
22.905	EUR	Accor 07/12/27, 0.70%	23.075	0,03
200.000	EUR	Afflelou 19/05/26, 4.25%	200.754	0,29
100.000	EUR	Altice France 15/07/29, 4.00%	76.518	0,11
220.000	EUR	Banijay Entertainment 01/05/29, 7.00%	231.134	0,33
210.000	EUR	CAB Selas 01/02/28, 3.38%	186.095	0,27
23.454	EUR	Edenred 14/06/28, ZCP	25.469	0,04
200.000	EUR	Electricite de France perpetual, variabel	215.710	0,31
200.000	EUR	Iliad Holding 15/10/28, 5.63%	197.311	0,28
100.000	EUR	Loxam 15/07/26, 3.75%	99.254	0,14
100.000	EUR	Loxam 15/04/27, 4.50%	94.630	0,14
110.000	EUR	Parts Europe 16/07/25, 6.50%	116.298	0,17
27.134	EUR	Safran 01/04/28, ZCP	29.114	0,04
22.655	EUR	Veolia Environnement 01/01/25, ZCP	24.279	0,03
Deutschland				
180.000	EUR	Cheplapharm Arzneimittel 15/01/28, 4.38%	174.045	0,25
100.000	EUR	Cheplapharm Arzneimittel 15/05/30, 7.50%	106.107	0,15
215.000	EUR	IHO Verwaltungs 15/05/28, 8.75%	235.015	0,34
200.000	EUR	Nidda Healthcare Holding 21/08/26, 7.50%	213.432	0,31
200.000	EUR	Renk 15/07/25, 5.75%	210.604	0,30
92.316	EUR	Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH 30/07/26, 6.00%	95.300	0,14
100.000	EUR	TUI Cruises 15/05/26, 6.50%	100.186	0,14
200.000	EUR	WEPA Hygieneprodukte 15/12/27, 2.88%	186.006	0,27

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Indien				
200.000	USD	Vedanta Resources Finance II 21/01/24, 13.88%	179.205	0,26
200.000	USD	Vedanta Resources Finance II 11/03/25, 8.95%	147.341	0,21
Italien				
210.000	EUR	Castor 15/02/29, variabel	211.488	0,30
200.000	EUR	Engineering-Ingegneria Informatica 30/09/26, 5.88%	190.677	0,27
210.000	EUR	Lottomatica 01/06/28, 7.13%	227.296	0,33
200.000	EUR	Mooney Group 17/12/26, variabel	211.080	0,30
200.000	EUR	Telecom Italia 15/02/28, 6.88%	213.256	0,31
Luxemburg				
200.000	EUR	Altice Financing 15/01/28, 3.00%	178.945	0,26
205.000	EUR	INEOS Finance 15/05/28, 6.63%	213.097	0,31
100.000	EUR	Matterhorn Telecom 15/11/27, 4.00%	98.919	0,14
200.000	EUR	Summer BC Holdco B 31/10/26, 5.75%	194.534	0,28
Niederlande				
200.000	GBP	GTCR W-2 Merger Sub 15/01/31, 8.50%	249.830	0,35
110.000	EUR	Q-Park Holding I 01/03/26, variabel	115.567	0,17
210.000	EUR	TMNL Holding 15/01/29, 3.75%	191.510	0,28
100.000	EUR	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 3.75 %	98.049	0,14
100.000	EUR	UPC Holding 15/06/29, 3.88%	87.911	0,13
120.000	EUR	VZ Vendor Financing II 15/01/29, 2.88%	98.244	0,14
100.000	EUR	Ziggo Bond 28/02/30, 3.38%	78.135	0,11
Spanien				
100.000	EUR	Cellnex Telecom 05/07/28, 0.50%	105.323	0,15
170.000	EUR	Cirsa Finance International 31/07/28, 7.88%	181.181	0,26
210.000	EUR	Lorca Telecom Bondco 18/09/27, 4.00%	206.817	0,30
100.000	EUR	Telefonica Europe 2 perpetual, variabel	92.377	0,13
100.000	EUR	Telefonica Europe 4 perpetual, variabel	103.722	0,15

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
Schweden			229.017	0,33
100.000	EUR		16.777	0,02
100.000	EUR	Verisure Holding 15/07/26, 3.88%	99.778	0,14
100.000	EUR	Verisure Holding 15/10/27, 9.25%	112.462	0,17
Vereinigtes Königreich			963.599	1,38
184.943	EUR	EG Global Finance 30/10/25, 6.25%	190.203	0,27
100.000	GBP	Hurricane Finance 15/10/25, 8.00%	119.606	0,17
205.000	GBP	Pinewood Finance 30/09/25, 3.25%	235.287	0,34
100.000	GBP	Premier Foods Finance 15/10/26, 3.50%	111.512	0,16
100.000	GBP	Virgin Media Secured Finance 15/05/29, 5.25%	105.539	0,15
110.000	EUR	Vodafone Group 27/08/80, variabel	94.560	0,14
100.000	EUR	Vodafone Group 30/08/84, variabel	106.892	0,15
USA			2.313.438	3,33
265.000	EUR	Allied Universal 01/06/28, 3.63%	231.839	0,33
200.000	EUR	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 2.13 %	188.080	0,27
125.000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/27, 5.25%	104.485	0,15
100.000	EUR	Clarios Global 15/05/26, 4.38%	101.864	0,15
220.000	EUR	Coty 15/09/28, 5.75%	234.840	0,34
200.000	EUR	Dana Financing Luxembourg 15/07/29, 3.00%	165.424	0,24
90.000	USD	Ford Motor 12/02/32, 3.25%	69.445	0,10
100.000	USD	Ford Motor 19/08/32, 6.10%	94.306	0,14
65.000	USD	Ford Motor Credit 13/11/30, 4.00%	54.352	0,08
85.000	USD	MGIC Investment 15/08/28, 5.25%	79.243	0,11
190.000	USD	MPT Operating Partnership 15/10/27, 5.00%	147.512	0,21
190.000	USD	Oceaneering International 01/02/28, 6.00%	179.187	0,26
110.000	EUR	Silgan Holdings 01/06/28, 2.25%	99.117	0,14
180.000	USD	TransDigm 15/11/27, 5.50%	169.168	0,24

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
290.000	USD	Vital Energy 15/01/25, 9.50%	292.624	0,42
100.000	USD	Vital Energy 15/01/28, 10.13%	101.952	0,15
Summe Anleihen			11.169.875	16,05
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			11.169.875	16,05

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
Anleihen				
Argentinien			138.451	0,20
5.600	USD	Genneia 02/09/27, 8.75%	5.361	0,01
140.000	USD	Pampa Energia 15/04/29, 9.13%	133.090	0,19
Australien			1.386.063	1,99
295.000	USD	Mineral Resources 01/05/27, 8.13%	291.369	0,42
125.000	USD	Mineral Resources 01/05/30, 8.50%	122.780	0,18
254.440	AUD	Ruby Bond Trust 12/03/53, variabel	163.877	0,24
264.151	AUD	Ruby Bond Trust Series 2021-1 12/03/53, variabel	168.642	0,24
500.000	AUD	Ruby Bond Trust 14/01/54, variabel	319.748	0,45
500.000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2022-1 14/01/54, variabel	319.647	0,46
Bermuda			402.999	0,58
400.000	USD	Home Re 25/01/34, variabel	402.999	0,58
Brasilien			163.313	0,23
200.000	USD	Azul Secured Finance 28/05/30, 10.88%	163.313	0,23
Kanada			1.285.052	1,85
15.000	USD	Bombardier 15/03/25, 7.50%	14.955	0,02
255.000	USD	Bombardier 15/06/26, 7.13%	247.294	0,36
100.000	USD	Bombardier 15/02/28, 6.00%	90.821	0,13
405.000	USD	Cascades 15/01/28, 5.38%	374.593	0,53
9.000	USD	First Majestic Silver 15/01/27, 0.38%	6.778	0,01
300.000	USD	Intelligent Packaging 15/09/28, 6.00%	262.961	0,38
195.000	USD	Precision Drilling 15/01/26, 7.13%	193.292	0,28

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermög- en	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermög- en
100.000	USD	Strathcona Resources 01/08/26, 6.88%	94.358	0,14	103.254	EUR	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	93.037	0,13
Kaimaninseln					99.268	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	104.084	0,15
250.000	USD	ACAM 17/11/34, variabel	239.380	0,34	108.202	GBP	Frost CMBS DAC* 20/11/33, variabel	112.132	0,16
250.000	USD	ACAM Series 2019-FL1 17/11/34, variabel	244.129	0,35	375.000	EUR	Goldentree Loan Management CLO 4 DAC 20/07/34, variabel	366.876	0,53
1.093.923	USD	Falcon Aerospace 15/09/39, 6.66%	323.112	0,46	800.000	EUR	ICG Euro CLO 19/04/36, variabel	848.830	1,22
375.000	USD	ICG US CLO 16/01/33, variabel	290.902	0,42	100.000	GBP	Last Mile Logistics CMBS UK DAC 17/08/33, variabel	122.071	0,18
375.000	USD	Marble Point CLO XV 23/07/32, variabel	335.432	0,48	174.770	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 17/08/33, variabel	166.807	0,24
250.000	USD	MP CLO VIII 28/04/34, variabel	235.281	0,34	550.821	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance Series 1A 17/08/33, variabel	535.272	0,77
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI 20/07/34, variabel	235.617	0,34	375.000	EUR	Palmer Square European CLO DAC 15/04/35, variabel	356.322	0,51
250.000	USD	Ocean Trails CLO XI Series 2021-11A 20/07/34, variabel	245.828	0,35	94.405	EUR	Pearl Finance DAC 17/11/32, variabel	96.975	0,14
470.264	USD	Pioneer Aircraft Finance 15/06/44, 3.97%	409.691	0,59	300.000	EUR	Penta CLO 10 DAC 20/11/34, variabel	293.069	0,42
1.116.071	USD	Thunderbolt II Aircraft Lease 15/09/38, variabel	703.593	1,01	375.000	EUR	Segovia European CLO 20/07/32, variabel	382.111	0,55
375.000	USD	Trinitas CLO XVI 20/07/34, variabel	365.233	0,52	250.000	EUR	St Paul's CLO VII DAC 18/07/34, variabel	252.322	0,36
1.000.000	USD	Trinitas CLO XVIII 20/01/35, variabel	986.914	1,43	398.915	GBP	Taurus UK DAC 17/11/29, variabel	459.976	0,66
400.000	USD	TRTX Issuer 15/03/38, variabel	376.404	0,54	310.000	GBP	Taurus UK DAC 17/05/31, variabel	331.423	0,48
Hongkong					279.128	GBP	Taurus UK DAC 17/08/31, variabel	306.830	0,44
240.000	USD	Seaspan 01/08/29, 5.50%	192.902	0,28	500.000	EUR	Tikehau CLO VIII DAC 25/10/34, variabel	536.300	0,77
Irland					375.000	EUR	Vendome Funding CLO DAC 20/07/34, variabel	330.896	0,48
375.000	EUR	Ares European CLO XII DAC 20/04/32, variabel	375.008	0,54	Jersey				
321.530	EUR	Arrow CMBS 2018 DAC 22/05/30, variabel	335.900	0,48	500.000	USD	ICG US CLO 18/07/36, variabel	502.280	0,72
750.000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 15/04/32, variabel	725.010	1,04	Luxemburg				
750.000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 19/10/34, variabel	756.196	1,09	260.000	USD	ION Trading Technologies 15/05/28, 5.75%	227.035	0,33
800.000	EUR	Barings Euro CLO 2022-1 DAC 28/10/34, variabel	850.702	1,23	Mexiko				
550.000	EUR	BBAM European CLO I DAC 22/07/34, variabel	524.600	0,75	200.000	USD	Braskem Idesa 20/02/32, 6.99%	120.446	0,17
250.000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund 15/01/37, variabel	249.326	0,36	Singapur				
300.000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund 15/01/37, variabel	322.167	0,46	20.000	USD	Sea 01/12/25, 2.38%	19.220	0,03
458.683	EUR	European Loan Conduit No 36 DAC Series C 17/02/30, variabel	466.257	0,67	31.000	USD	Sea 15/09/26, 0.25%	24.878	0,03
382.236	EUR	European Loan Conduit No 36 DAC Series D 17/02/30, variabel	385.537	0,55					

* Notleidendes Wertpapier.

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag		Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Vereinigtes Königreich					USA				
8.000	USD	Farfetch 01/05/27, 3.75%	4.290	0,01	370.000	USD	Bloomin' Brands 15/04/29, 5.13%	325.092	0,47
100.000	GBP	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 15/07/28, 4.88%	101.868	0,14	320.000	USD	Brinker International 15/07/30, 8.25%	308.309	0,44
USA					USA				
195.000	USD	Academy 15/11/27, 6.00%	184.529	0,27	250.000	USD	BRSP 19/08/38, variabel	222.891	0,32
170.000	USD	Ahead DB Holdings 01/05/28, 6.63%	143.969	0,21	58.000	USD	Cable One 15/03/26, ZCP	47.734	0,07
61.000	USD	Alarm.com Holdings 15/01/26, ZCP	53.009	0,08	235.000	USD	Cablevision Lightpath 15/09/28, 5.63%	180.689	0,26
310.000	USD	Albertsons 15/02/28, 5.88%	298.690	0,43	415.000	USD	Calpine 01/02/29, 4.63%	348.108	0,50
60.000	USD	Albertsons 15/02/30, 4.88%	54.146	0,08	240.000	USD	Calpine 01/02/31, 5.00%	194.374	0,28
135.000	USD	Allied Universal 01/06/28, 4.63%	112.699	0,16	165.000	USD	Carnival 01/03/27, 5.75%	149.476	0,21
280.000	USD	Allied Universal Finance 15/07/26, 6.63%	265.706	0,38	20.000	USD	Carnival 01/06/30, 10.50%	20.615	0,03
275.000	USD	AMC Networks 15/02/29, 4.25%	169.170	0,24	396.846	USD	Castlelake Aircraft Structured Trust 2017-1R 15/08/41, 2.74%	360.561	0,52
245.000	USD	American Airlines 15/07/25, 11.75%	263.520	0,38	120.000	USD	CCO Holdings 01/02/28, 5.00 %	109.108	0,16
7.000	USD	American Water Capital 15/06/26, 3.63%	6.782	0,01	360.000	USD	CCO Holdings 01/03/31, 7.38%	347.999	0,50
90.000	USD	APX Group 15/02/27, 6.75%	86.524	0,12	350.000	USD	Central Parent 15/06/29, 8.00%	349.445	0,50
250.000	USD	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 15/05/36, variabel	234.212	0,34	45.000	USD	Ceridian HCM Holding 15/03/26, 0.25%	39.798	0,06
80.000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 4.13 %	73.230	0,11	700.000	USD	Churchill Downs 01/05/31, 6.75%	662.374	0,94
100.000	USD	AREIT 17/07/28, variabel	99.661	0,14	330.000	USD	CITGO Petroleum 15/06/25, 7.00%	325.369	0,47
103.000	USD	AREIT Trust 14/09/36, variabel	96.175	0,14	285.000	USD	Cloud Software Group 31/03/29, 6.50%	252.333	0,36
305.000	USD	ASP Unifrax Holdings 30/09/28, 5.25%	217.690	0,31	52.000	USD	Cloudflare 15/08/26, ZCP	44.460	0,06
170.000	USD	AssuredPartners 15/01/29, 5.63%	147.372	0,21	280.000	USD	Cogent Communications Group 15/06/27, 7.00%	267.669	0,38
115.000	USD	B&G Foods 15/09/28, 8.00%	115.381	0,17	45.000	USD	CommScope 01/07/28, 7.13%	26.401	0,04
50.000	USD	Bausch Health 01/02/27, 6.13%	31.283	0,04	225.000	USD	CommScope 01/09/29, 4.75%	163.544	0,24
55.000	USD	Bausch Health 01/06/28, 4.88%	31.375	0,05	145.000	USD	CommScope Technologies 15/06/25, 6.00%	135.628	0,19
49.000	USD	Beauty Health 01/10/26, 1.25%	38.343	0,06	40.000	USD	Community Health Systems 15/03/27, 5.63%	34.346	0,05
375.000	USD	BellRing Brands 15/03/30, 7.00%	369.801	0,53	30.000	USD	Community Health Systems 15/01/29, 6.00%	24.260	0,03
293.445	USD	Blackbird Capital Aircraft 15/07/46, 2.44%	251.022	0,36	35.000	USD	Comstock Resources 15/01/30, 5.88%	30.338	0,04
41.000	USD	Blackline 15/03/26, ZCP	35.516	0,05	380.000	USD	Consolidated Communications 01/10/28, 6.50%	297.825	0,43
					335.000	USD	Coty 15/04/26, 6.50%	333.744	0,48
					395.000	USD	CQP 15/06/31, 5.50%	350.555	0,50
					265.000	USD	CSC Holdings 01/02/28, 5.38 %	216.069	0,31

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
3.000	USD	Datadog 15/06/25, 0.13%	3.536	0,01	135.000	USD	GTCR W-2 Merger Sub 15/01/31, 7.50%	135.678	0,19
430.000	USD	Directv Financing 15/08/27, 5.88%	381.380	0,55	41.000	USD	Haemonetics 01/03/26, ZCP	35.773	0,05
115.000	USD	DISH DBS 01/12/26, 5.25%	97.563	0,14	410.000	USD	Hanesbrands 15/02/31, 9.00%	390.903	0,56
50.000	USD	DISH DBS 01/12/28, 5.75%	38.531	0,06	200.000	USD	HAT Holdings I 15/04/25, 6.00%	194.828	0,28
405.000	USD	Edgewell Personal Care 01/04/29, 4.13%	344.876	0,50	375.000	USD	HAT Holdings I 15/06/26, 3.38%	333.716	0,48
9.000	USD	Enphase Energy 01/03/28, ZCP	7.493	0,01	80.000	USD	HAT Holdings I 15/09/30, 3.75%	61.320	0,09
18.000	USD	Envestnet 01/12/27, 2.63%	16.497	0,02	170.000	USD	Hess Midstream Operations 15/06/28, 5.13%	156.615	0,23
6.000	USD	Envista Holdings 15/08/28, 1.75%	5.556	0,01	285.000	USD	Howard Midstream Energy Partners 15/07/28, 8.88%	287.757	0,41
510.000	USD	EquipmentShare.com 15/05/28, 9.00%	491.614	0,70	350.000	USD	Hunt 15/04/29, 5.25%	275.324	0,40
6.000	USD	Etsy 01/10/26, 0.13%	6.120	0,01	405.000	USD	Imola Merger 15/05/29, 4.75%	355.371	0,51
30.000	USD	Etsy 15/06/28, 0.25%	22.890	0,03	10.000	USD	Integer Holdings 15/02/28, 2.13%	10.915	0,02
322.000	USD	Everi Holdings 15/07/29, 5.00%	278.194	0,40	185.000	USD	Iron Mountain 15/03/28, 5.25%	171.269	0,25
9.000	USD	Exact Sciences 15/03/27, 0.38%	8.190	0,01	180.000	USD	Iron Mountain 15/07/28, 5.00%	163.943	0,24
125.000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/29, 4.63%	106.074	0,15	305.000	USD	JB Poindexter 15/04/26, 7.13%	296.991	0,43
90.000	USD	Fertitta Entertainment 15/01/30, 6.75%	73.467	0,11	65.000	USD	JetBlue Airways 01/04/26, 0.50%	50.577	0,07
455.000	USD	FirstCash 01/01/30, 5.63%	409.895	0,59	145.000	USD	LABL 01/11/28, 5.88%	130.474	0,19
7.000	USD	Fluor 15/08/29, 1.13%	7.261	0,01	375.000	USD	Level 3 Financing 01/07/28, 4.25%	234.129	0,34
400.000	USD	FMC GMSR Issuer Trust 25/07/26, variabel	329.022	0,47	14.000	USD	Liberty Media-Liberty Formula One 15/08/27, 2.25%	13.692	0,02
22.000	USD	Ford Motor 15/03/26, ZCP	21.725	0,03	12.000	USD	LivNova USA 15/12/25, 3.00%	13.058	0,02
160.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/08/27, 9.75%	165.647	0,24	15.000	USD	Live Nation Entertainment 15/01/29, 3.13%	15.593	0,02
195.000	USD	Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/05/28, 5.50%	176.998	0,25	23.000	USD	Lumentum Holdings 15/06/28, 0.50%	16.820	0,02
210.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/28, 5.00%	179.599	0,26	600.000	USD	Marriott Ownership Resorts 15/06/29, 4.50%	503.357	0,71
170.000	USD	Frontier Communications Holdings 01/05/29, 6.75%	131.030	0,19	340.000	USD	Medline Borrower 01/10/29, 5.25%	294.292	0,42
195.000	USD	Graham Packaging 15/08/28, 7.13%	163.645	0,24	295.000	USD	Minerals Technologies 01/07/28, 5.00%	270.912	0,39
305.000	USD	Gray Television 15/10/30, 4.75%	202.437	0,29	17.000	USD	MP Materials 01/04/26, 0.25%	14.685	0,02
					155.000	USD	MPH Acquisition Holdings 01/09/28, 5.50%	131.864	0,19

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
2.000	USD	Nabors Industries 15/06/29, 1.75%	1.769	-	23.000	USD	Shift4 Payments 01/08/27, 0.50%	19.766	0,03
280.791	USD	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 15/03/35, variabel	276.433	0,40	535.000	USD	Sirius XM Radio 01/07/29, 5.50%	473.847	0,68
105.000	USD	NCR 01/10/28, 5.00%	94.087	0,14	240.000	USD	Six Flags Entertainment 15/04/27, 5.50%	221.032	0,32
245.000	USD	NCR 15/04/29, 5.13%	216.106	0,31	195.000	USD	SK Invictus Intermediate II 30/10/29, 5.00%	156.505	0,22
140.000	USD	NCR Atleos Escrow 01/04/29, 9.50%	136.134	0,20	45.000	USD	Spirit AeroSystems 15/04/25, 7.50%	44.208	0,06
180.000	USD	Necessity Retail Real Estate Investment Trust 30/09/28, 4.50%	137.232	0,20	18.000	USD	Splunk 15/09/25, 1.13%	19.386	0,03
355.000	USD	Neptune Bidco US 15/04/29, 9.29%	322.216	0,46	48.000	USD	Spotify USA 15/03/26, ZCP	40.974	0,06
27.000	USD	NextEra Energy Partners 15/06/24, ZCP	25.677	0,04	55.000	USD	Standard Industries 15/01/28, 4.75%	49.678	0,07
18.000	USD	NRG Energy 01/06/48, 2.75%	19.134	0,03	170.000	USD	Standard Industries 15/07/30, 4.38%	141.187	0,20
52.000	USD	Nutanix 01/10/27, 0.25%	46.670	0,07	425.000	USD	Talen Energy Supply 01/06/30, 8.63%	436.045	0,63
33.000	USD	NuVasive 15/03/25, 0.38%	30.476	0,04	55.000	USD	Tenet Healthcare 01/02/27, 6.25%	53.269	0,08
275.000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/28, 4.25%	224.474	0,32	325.000	USD	Tenet Healthcare 01/10/28, 6.13%	305.396	0,44
55.000	USD	Olympus Water US Holding 15/11/28, 9.75%	54.951	0,08	95.000	USD	TMS International 15/04/29, 6.25%	78.670	0,11
10.000	USD	ON Semiconductor 01/03/29, 0.50%	11.030	0,02	5.000	USD	TransMedics Group 01/06/28, 1.50%	4.541	0,01
290.000	USD	OneMain Finance 15/03/26, 7.13%	284.445	0,41	40.000	USD	Tronox 15/03/29, 4.63%	32.315	0,05
390.000	USD	Pediatrix Medical Group 15/02/30, 5.38%	343.945	0,49	105.000	USD	Uber Technologies 15/09/27, 7.50%	105.991	0,15
28.000	USD	Perficient 15/11/26, 0.13%	22.576	0,03	110.000	USD	Uber Technologies 15/01/28, 6.25%	107.682	0,15
205.000	USD	Performance Food Group 15/10/27, 5.50%	194.414	0,28	71.000	USD	Unity Software 15/11/26, ZCP	56.552	0,08
125.000	USD	Permian Resources Operating 15/02/26, 7.75%	125.924	0,18	165.000	USD	Univision Communications 30/06/30, 7.38%	150.914	0,22
200.000	USD	Post Holdings 15/01/28, 5.63%	189.240	0,27	80.000	USD	US Foods 01/06/30, 4.63%	69.589	0,10
480.000	USD	Prime Security Services Borrower 15/01/28, 6.25%	445.138	0,64	200.000	USD	Venture Global LNG 01/06/28, 8.13%	198.158	0,28
293.416	USD	PRPM 25/06/26, variabel	234.600	0,34	85.000	USD	Venture Global LNG 01/06/31, 8.38%	83.632	0,12
200.000	USD	PRPM 25/09/26, variabel	161.106	0,23	400.000	USD	Verus Securitization Trust 25/08/67, variabel	378.688	0,54
40.000	USD	QVC 01/04/24, 4.85%	38.486	0,06	211.000	USD	Verus Securitization Trust 25/06/68, variabel	206.431	0,30
65.000	USD	QVC 15/02/25, 4.45%	56.951	0,08	97.609	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-A3 25/08/68, variabel	97.407	0,14
85.000	USD	Rocket Mortgage 15/10/26, 2.88%	74.664	0,11	100.000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-B1 25/08/68, variabel	97.357	0,14
165.000	USD	SEG Holding 15/10/28, 5.63%	165.512	0,24					
31.000	USD	Shake Shack 01/03/28, ZCP	23.289	0,03					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
100.000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-M1 25/08/68, variabel	99.115	0,14
201.000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-A3 25/09/68, variabel	201.010	0,29
150.000	USD	Verus Securitization Trust Series 2023-B1 25/09/68, variabel	145.389	0,21
100.000	USD	Vistra Operations 15/10/31, 7.75%	98.728	0,14
370.000	USD	VM Consolidated 15/04/29, 5.50%	333.458	0,48
189.000	USD	VMC Finance 16/06/36, variabel	169.005	0,24
455.000	USD	VMC Finance Series 2021-FL4 16/06/36, variabel	420.486	0,60
370.000	USD	Wash Multifamily Acquisition 15/04/26, 5.75%	345.902	0,50
375.000	USD	Watco 15/06/27, 6.50%	356.556	0,51
390.480	USD	WAVE Trust 15/11/42, 3.84%	315.847	0,45
34.000	USD	Western Digital 01/02/24, 1.50%	33.592	0,05
90.000	USD	Windsor Holdings III 15/06/30, 8.50%	88.908	0,13
14.000	USD	Wolfspeed 15/02/28, 0.25%	9.506	0,01
11.000	USD	World Kinect 01/07/28, 3.25%	10.925	0,02
13.000	USD	Zscaler 01/07/25, 0.13%	15.678	0,02
Summe Anleihen			48.254.368	69,33
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			48.254.368	69,33

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Marktwert USD	% Nettovermögen
Anleihen				
Kaimaninseln			651.524	0,94
756.453	USD	Horizon Aircraft Finance I 15/12/38, 4.46%	651.524	0,94
China			32.081	0,05
5.000	USD	Bilibili 01/04/26, 1.38%	4.963	0,01
200.000	USD	Shimao Group Holdings 15/07/26, 5.60%*	7.000	0,01
200.000	USD	Shimao Group Holdings 13/07/30, 4.60%*	7.982	0,01
200.000	USD	Sino-Ocean Land Treasure IV 05/05/26, 3.25%	12.136	0,02
Irland			2.109.873	3,03
750.000	EUR	Aurium CLO 18/01/38, variabel	793.334	1,14
500.000	EUR	Dryden 27 R Euro CLO DAC 15/04/33, variabel	464.139	0,67
250.000	EUR	ICG Euro CLO DAC 15/05/35, variabel	251.937	0,36
500.000	EUR	ICG Euro CLO DAC Series 2022-1A 15/05/35, variabel	505.363	0,72
100.000	EUR	Rockford Tower Europe CLO DAC 20/04/34, variabel	95.100	0,14
USA			852.818	1,23
100.000	EUR	Darling Global Finance 15/05/26, 3.63%	102.781	0,15
750.000	USD	Voya CLO 20/10/34, variabel	750.037	1,08
Summe Anleihen			3.646.296	5,25
Summe sonstige Wertpapiere			3.646.296	5,25
Summe Kapitalanlagen			63.070.539	90,63
Sonstiges Nettovermögen			6.522.503	9,37
Nettoinventarwert			69.593.042	100,00

* Notleidendes Wertpapier.

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA SEG US Equity*

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpa- piere und Geldmarkt- instrumente, die zu einer amtlichen Börsennotie- rung zugelassen sind	Markt- wert GBP	% Netto- vermö- gen
Aktien				
USA			271.886.595	82,11
49.655	USD	Amphenol	4.170.523	1,26
12.671	USD	ANSYS	3.770.256	1,14
222.691	USD	Brown & Brown	15.552.739	4,70
98.764	USD	CDW	19.926.625	6,02
307.009	USD	Ceridian HCM Holding	20.830.561	6,29
72.435	USD	Clean Harbors	12.122.722	3,66
64.842	USD	Core & Main	1.870.692	0,56
159.574	USD	Entegris	14.985.594	4,53
19.014	USD	Fastenal	1.038.925	0,31
72.314	USD	Jacobs Solutions	9.870.861	2,98
268.453	USD	Live Nation Entertainment	22.292.336	6,73
35.594	USD	Martin Marietta Materials	14.610.625	4,41
86.616	USD	Middleby	11.086.848	3,35
15.267	USD	Morningstar	3.576.142	1,08
33.416	USD	Paychex	3.853.867	1,16
101.550	USD	PTC	14.387.604	4,35
129.547	USD	Revvity	14.340.853	4,33
276.135	USD	Rollins	10.308.120	3,11
97.070	USD	Service International	5.546.580	1,68
233.731	USD	Signet Jewelers	16.784.223	5,07
27.617	USD	Teledyne Technologies	11.283.754	3,41
116.959	USD	Toro	9.719.293	2,94
84.435	USD	Trimble	4.547.669	1,37
63.617	USD	Vail Resorts	14.115.976	4,26
106.269	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	11.293.207	3,41
Summe Aktien			271.886.595	82,11
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			271.886.595	82,11
Summe Kapitalanlagen			271.886.595	82,11
Sonstiges Nettovermögen			59.239.372	17,89
Nettoinventarwert			331.125.967	100,00

* Für nähere Angaben zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Aktien				
Schweiz			7.731.045	4,51
100.325	USD	Alcon	7.731.045	4,51
Taiwan			501.239	0,29
5.768	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	501.239	0,29
USA			118.697.970	69,24
37.742	USD	Abbott Laboratories	3.655.313	2,13
5.637	USD	Adobe	2.874.306	1,68
17.819	USD	agilon health	316.465	0,18
20.715	USD	Alphabet	2.710.765	1,58
10.988	USD	American Express	1.639.300	0,96
17.052	USD	Analog Devices	2.985.635	1,74
12.449	USD	Becton Dickinson	3.218.440	1,88
116.603	USD	Boston Scientific	6.156.638	3,59
100.556	USD	Carlyle Group	3.032.769	1,77
10.279	USD	Clean Harbors	1.720.293	1,00
11.060	USD	Constellation Brands	2.779.710	1,62
3.524	USD	CyberArk Software	577.125	0,34
1.678	USD	Danaher	416.312	0,24
55.380	USD	Delta Air Lines	2.049.060	1,20
8.075	USD	Eli Lilly	4.337.325	2,53
23.150	USD	General Electric	2.559.233	1,49
28.330	USD	Global Payments	3.268.999	1,91
52.184	USD	Globus Medical	2.590.936	1,51
6.093	USD	HCA Healthcare	1.498.756	0,87
28.779	USD	HEICO	3.718.822	2,17
6.677	USD	Hess	1.021.581	0,60
11.268	USD	Inari Medical	736.927	0,43
430	USD	Inspire Medical Systems	85.329	0,05
1.340	USD	Intuit	684.660	0,40
18.298	USD	Keysight Technologies	2.421.008	1,41
396	USD	KLA	181.629	0,11
11.754	USD	Lantheus Holdings	816.668	0,48
2.853	USD	Marvell Technology	154.433	0,09
36.340	USD	Medtronic	2.847.602	1,66
14.618	USD	Microsoft	4.615.634	2,69
21.599	USD	Nabors Industries	2.659.701	1,55
3.439	USD	Natera	152.176	0,09
295.793	USD	Norwegian Cruise Line Holdings	4.874.669	2,84
4.449	USD	Old Dominion Freight Line	1.820.264	1,06

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
4.521	USD	Option Care Health	146.254	0,09
30.176	USD	PACCAR	2.565.564	1,50
19.350	USD	PacWest Bancorporation	396.482	0,23
2.664	USD	Palo Alto Networks	624.548	0,36
107.430	USD	Portillo's	1.653.348	0,96
13.973	USD	Regions Financial	240.336	0,14
56.310	USD	Riskified	252.269	0,15
17.450	USD	Roper Technologies	8.450.685	4,93
23.237	USD	S&P Global	8.491.031	4,95
29.330	USD	Schlumberger	1.709.939	1,00
12.433	USD	Splunk	1.818.326	1,06
17.572	USD	Tenable Holdings	787.226	0,46
4.087	USD	Tenet Healthcare	269.292	0,16
25.976	USD	Texas Instruments	4.130.444	2,41
13.700	USD	T-Mobile US	1.918.685	1,12
15.254	USD	Union Pacific	3.106.172	1,81
14.361	USD	Waste Connections	1.928.682	1,13
74.349	USD	Wells Fargo	3.037.900	1,77
9.273	USD	Workday	1.992.304	1,16
Summe Aktien			126.930.254	74,04
Anleihen				
USA			1.628.711	0,95
1.733.000	USD	TransDigm 15/11/27, 5,50%	1.628.711	0,95
Summe Anleihen			1.628.711	0,95
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			128.558.965	74,99
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
USA			31.045.369	18,11
1.274.000	USD	NCL 15/03/26, 5,88%	1.177.369	0,69
30.000.000	USD	United States Treasury Bill 02/11/23, ZCP	29.868.000	17,42
Summe Anleihen			31.045.369	18,11
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			31.045.369	18,11
Summe Kapitalanlagen			159.604.334	93,10
Sonstiges Nettovermögen			11.832.682	6,90
Nettoinventarwert			171.437.016	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (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	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
Deutschland			62.944	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4.25%	12.205	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4.75%	12.970	0,01
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3.25%	10.907	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2.50%	9.748	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2.50%	9.702	-
10.000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1.25%	7.412	-
USA			20.916	0,01
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2.50%	6.787	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3.00%	7.423	0,01
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2.50%	6.706	-
Summe Anleihen			83.860	0,02
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			83.860	0,02

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
USA			21.324	0,01
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2.88%	7.240	-
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3.00%	7.391	0,01
10.000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2.50%	6.693	-
Summe Anleihen			21.324	0,01
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			21.324	0,01
Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen				
Luxemburg			5.000.000	1,32
5.000.000	USD	JPMorgan Liquidity Funds-US Dollar Treasury Liquidity Fund	5.000.000	1,32
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen			5.000.000	1,32
Summe Kapitalanlagen			5.105.184	1,35
Termineinlagen				
Finanzen			221.977.000	58,58
52.000.000	USD	Banque 02/10/23, 5.30%	52.000.000	13,73
52.000.000	USD	Credit Agricole 02/10/23, 5.30%	52.000.000	13,72
14.000.000	USD	Mizuho Bank 02/10/23, 5.32%	14.000.000	3,69
51.977.000	USD	Rabobank 02/10/23, 5.30%	51.977.000	13,72
52.000.000	USD	Toronto-Dominion Bank 02/10/23, 5.30%	52.000.000	13,72
Summe Termineinlagen			221.977.000	58,58
Sonstiges Nettovermögen			151.836.944	40,07
Nettoinventarwert			378.919.128	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Aktien					358.618	HKD	China Longyuan Power Group	312.322	0,06
Australien					11.923	HKD	China National Building Material	6.258	-
127.645	GBP	Glencore	731.821	0,15	61.886	HKD	China Resources Gas Group	181.368	0,04
Österreich					27.205	CNH	Contemporary Amperex Technology	756.925	0,16
21.835	EUR	Addiko Bank	293.180	0,06	32.774	HKD	ENN Energy Holdings	272.037	0,06
31.741	EUR	BAWAG Group	1.458.438	0,30	54.070	HKD	Hope Education Group	3.418	-
Belgien					1.563	HKD	JD.com	22.973	-
1.177	EUR	Aedifica	67.010	0,01	310.213	HKD	Kunlun Energy	267.393	0,06
14.000	EUR	KBC Group	875.360	0,18	26.579	HKD	Li Ning	111.835	0,02
3.516	EUR	UCB	288.239	0,06	229.124	HKD	Lifetech Scientific	70.221	0,01
Brasilien					2.368	HKD	Ping An Insurance Group of China	13.562	-
1.265	USD	Banco Bradesco	3.605	-	14.460	CNH	Proya Cosmetics	201.329	0,04
148.931	BRL	Hapvida Participacoes e Investimentos	139.256	0,03	15.302	HKD	Remegen	78.748	0,02
Kanada					140.600	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer	123.526	0,03
194.638	CAD	Advantage Energy	1.328.396	0,27	9.900	HKD	Sichuan Kelun-Biotech Biopharmaceutical	96.839	0,02
210.328	CAD	ARC Resources	3.357.197	0,70	235.517	CNH	Sinoma Science & Technology	663.574	0,14
69.853	USD	Barrick Gold	1.016.361	0,21	9.900	HKD	Tencent Holdings	387.102	0,08
22.919	USD	Canadian Natural Resources	1.482.172	0,31	132.000	HKD	Venus MedTech Hangzhou	78.381	0,02
115.292	USD	Cenovus Energy	2.400.379	0,50	25.800	HKD	WuXi AppTec	308.871	0,06
3.200	USD	Clementia Pharmaceuticals	-	-	455	HKD	XPeng	4.064	-
12.646	CAD	Enbridge	419.438	0,09	1.240	CNH	Yunnan Energy New Material	10.179	-
88.746	CAD	Enerplus	1.561.590	0,32	7.191	USD	Zai Lab	174.813	0,04
77.819	CAD	Foran Mining	212.559	0,04	509	CNH	Zhejiang HangKe Technology	1.824	-
22.486	CAD	Headwater Exploration	118.535	0,02	5.539	CNH	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology	5.200	-
4.500	CAD	Intact Financial	656.057	0,14	Dänemark				
113.841	CAD	Kelt Exploration	607.655	0,13	4.968	USD	Ascendis Pharma	465.204	0,10
48.381	CAD	MEG Energy	941.439	0,19	Finnland				
108.254	CAD	NuVista Energy	1.036.114	0,21	45.560	SEK	Nordea Bank Abp	500.905	0,10
80.200	CAD	Peyto Exploration & Development	813.662	0,17	Frankreich				
53.343	CAD	Peyto Exploration & Development	537.652	0,11	74.213	EUR	ALD	575.517	0,12
8.320	USD	Shopify	454.022	0,09	24.510	EUR	AXA	730.234	0,15
10.663	USD	Suncor Energy	366.594	0,08	16.872	EUR	BNP Paribas	1.077.945	0,22
1.255	CAD	Tourmaline Oil	63.154	0,01	3.590	EUR	Cie de Saint-Gobain	215.890	0,04
China					1.574	EUR	Dassault Aviation	296.877	0,06
214.030	HKD	Alibaba Group Holding	2.339.558	0,48	77.516	EUR	Engie	1.190.788	0,26
22.934	CNH	Amoy Diagnostics	78.100	0,02					
2.860	HKD	Anhui Conch Cement	7.615	-					
20.600	HKD	Anta Sports Products	231.886	0,05					
3.739	HKD	BYD	115.546	0,02					
201.617	HKD	China Gas Holdings	190.264	0,04					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
2.260	EUR	Publicis Groupe	171.462	0,04
11.360	EUR	TotalEnergies	748.366	0,15
Deutschland			4.830.149	1,00
1.926	EUR	Allianz	459.585	0,10
3.692	EUR	Bayer	177.408	0,04
9.025	EUR	Daimler Truck Holding	313.158	0,06
16.495	USD	Immatic	191.012	0,04
5.914	EUR	LEG Immobilien	408.543	0,08
2.139	EUR	Münchener Rückversicherungs- Gesellschaft in München	834.704	0,17
1.689	EUR	Rheinmetall	435.531	0,09
5.652	EUR	Siemens	810.647	0,17
18.216	EUR	Talanx	1.155.532	0,24
307	EUR	Wacker Chemie	44.029	0,01
Indien			568.317	0,12
484	INR	Adani Ports & Special Economic Zone	4.812	-
1.702	INR	Ambuja Cements	8.706	-
49.182	INR	Bharti Airtel	548.995	0,12
15.252	INR	IRB Infrastructure Developers	5.804	-
Irland			2.644.280	0,55
4.776	USD	AerCap Holdings	299.312	0,06
273.063	EUR	AIB Group	1.229.844	0,26
166.171	EUR	Irish Continental Group	785.309	0,16
75.090	EUR	Permanent TSB Group Holdings	170.686	0,04
3.298	USD	Prothena	159.129	0,03
Italien			3.114.511	0,64
3.612	EUR	DiaSorin	330.020	0,07
1.311	EUR	FinecoBank Banca Fineco	15.960	-
300.327	EUR	Intesa Sanpaolo	774.751	0,16
82.966	EUR	UniCredit	1.993.780	0,41
Japan			6.829.640	1,41
3.000	JPY	Bank of Nagoya	104.189	0,02
186.500	JPY	Chiba Bank	1.357.192	0,29
20.535	JPY	Chugai Pharmaceutical	635.398	0,13
224.400	JPY	Concordia Financial Group	1.023.344	0,21
10.990	JPY	Daiichi Sankyo	301.960	0,06
6.800	JPY	Ebara	318.932	0,07
2.798	JPY	Eisai	155.478	0,03
1.400	JPY	Hyakujushi Bank	24.564	0,01
25.900	JPY	Iyogin Holdings	186.312	0,04
21.000	JPY	Kyushu Financial Group	108.344	0,02
1.400	JPY	Mitsubishi Gas Chemical	18.854	-

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
102	JPY	Omron	4.551	-
16.500	JPY	Otsuka Holdings	586.620	0,12
205	JPY	Panasonic Holdings	2.307	-
50.200	JPY	Resona Holdings	278.243	0,06
29.700	JPY	Shiga Bank	695.597	0,14
6.000	JPY	Shiseido	210.787	0,04
5.420	JPY	Sony Group	443.929	0,09
9.900	JPY	Sumitomo Mitsui Trust Holdings	373.039	0,08
Jersey			1.823.836	0,38
33.781	USD	WisdomTree Brent Crude Oil	1.823.836	0,38
Niederlande			6.240.333	1,29
1.779	USD	Argenx	874.610	0,18
17.493	EUR	ASR Nederland	656.924	0,14
30.374	EUR	EXOR	2.695.557	0,56
10.980	USD	Merus	258.908	0,05
55.175	GBP	Shell	1.754.334	0,36
Norwegen			1.031.330	0,21
44.536	NOK	Aker Carbon Capture	47.173	0,01
17.109	USD	Seadrill	766.312	0,15
15.895	NOK	TGS	217.845	0,05
Philippinen			3.420	-
2.420	PHP	Security Bank	3.420	-
Südafrika			805.884	0,17
29.155	GBP	Anglo American	805.884	0,17
Südkorea			475.309	0,10
9.246	KRW	Samsung Electronics	468.672	0,10
118	KRW	SKC	6.637	-
Spanien			1.252.539	0,26
148.134	EUR	CaixaBank	592.943	0,12
612.246	EUR	Unicaja Banco	659.596	0,14
Schweiz			2.302.237	0,48
6.260	CHF	Alcon	485.153	0,10
2.372	CHF	Cie Financiere Richemont	290.232	0,06
6.045	CHF	Novartis	619.920	0,13
370	CHF	Tecan Group	124.984	0,03
31.545	CHF	UBS Group	781.948	0,16
Taiwan			188.308	0,04
1.393	TWD	Kinsus Interconnect Technology	4.682	-
290	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	4.699	-
2.059	USD	Taiwan Semiconductor Manufacturing-ADR	178.927	0,04
Vereinigtes Königreich			8.653.550	1,79
9.606	USD	Abcam	217.384	0,04
16.670	GBP	Admiral Group	483.460	0,10

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
12.873	GBP	AstraZeneca	1.743.720	0,37	4.151	USD	Biogen	1.066.849	0,22
120.330	GBP	Aviva	572.283	0,12	546	USD	BlackRock	352.984	0,07
455.808	GBP	Barclays	883.916	0,18	3.376	USD	Blueprint Medicines	169.543	0,04
65.754	GBP	Beazley	444.053	0,09	94	USD	Booking Holdings	289.891	0,06
79.486	GBP	BP	515.356	0,11	3.760	USD	Boston Properties	223.645	0,05
17.305	GBP	British American Tobacco	544.103	0,11	2.388	USD	Boston Scientific	126.086	0,03
19.101	GBP	Cranswick	827.798	0,17	10.335	USD	Bridgebio Pharma	272.534	0,06
3.339	GBP	Genus	85.389	0,02	5.855	USD	Builders FirstSource	728.889	0,15
19.129	GBP	Hunting	71.302	0,01	15.589	USD	BWX Technologies	1.168.863	0,24
29.009	GBP	IMI	554.976	0,11	2.453	USD	California Resources	137.393	0,03
26.358	GBP	Lancashire Holdings	189.740	0,04	7.785	USD	Capital One Financial	755.534	0,16
4.305	GBP	London Stock Exchange Group	432.493	0,09	2.200	USD	Cboe Global Markets	343.662	0,07
22.263	GBP	National Grid	266.198	0,06	532	USD	Cencora	95.744	0,02
28.638	NOK	Subsea 7	394.632	0,08	5.275	USD	Centene	363.342	0,08
11.541	USD	Verona Pharma	188.118	0,04	15.452	USD	CenterPoint Energy	414.886	0,09
28.527	GBP	Wise	238.629	0,05	2.874	USD	CH Robinson Worldwide	247.538	0,05
USA			93.570.850	19,34	3.296	USD	Cheniere Energy	547.004	0,11
6.983	USD	Abbott Laboratories	676.304	0,14	6.712	USD	Chesapeake Energy	578.776	0,12
5.393	USD	Acadia Healthcare	379.182	0,08	10.196	USD	Chord Energy	1.652.466	0,34
17.124	USD	Aclaris Therapeutics	117.299	0,02	56.081	USD	Citizens Financial Group	1.502.971	0,31
2.728	USD	Addus HomeCare	232.398	0,05	5.173	USD	Comcast	229.371	0,05
6.209	USD	agilon health	110.272	0,02	9.946	USD	ConocoPhillips	1.191.531	0,25
4.574	USD	Akero Therapeutics	231.353	0,05	913	USD	Consolidated Edison	78.089	0,02
45.912	USD	Alignment Healthcare	318.629	0,07	45.498	USD	Coterra Energy	1.230.721	0,25
19.941	USD	Alkermes	558.547	0,12	10.993	USD	Crinetics Pharmaceuticals	326.932	0,07
4.591	USD	Alnylam Pharmaceuticals	813.066	0,17	15.820	USD	Cytokinetics	466.057	0,10
1.191	USD	Amazon.com	151.400	0,03	2.094	USD	Danaher	519.521	0,11
23.713	USD	American Electric Power	1.783.692	0,37	564	USD	Deere	212.842	0,04
2.819	USD	American Express	420.567	0,09	4.515	USD	Denali Therapeutics	93.144	0,02
713	USD	American Water Works	88.291	0,02	2.422	USD	Devon Energy	115.529	0,02
843	USD	AMETEK	124.562	0,03	1.817	USD	Dexcom	169.526	0,04
806	USD	ANSYS	239.825	0,05	21.200	USD	Diamondback Energy	3.283.455	0,67
26.270	USD	Antero Resources	666.733	0,14	10.830	USD	Dominion Energy	483.776	0,10
282	USD	Aon	91.430	0,02	89	USD	DR Horton	9.565	-
9.235	USD	Apellis Pharmaceuticals	351.299	0,07	6.036	USD	Edison International	382.018	0,08
1.315	USD	Applied Industrial Technologies	203.312	0,04	19.897	USD	Elanco Animal Health	223.642	0,05
39.058	USD	Ares Management	4.017.895	0,82	2.280	USD	elf Beauty	250.412	0,05
3.020	USD	Array Technologies	67.014	0,01	3.349	USD	Eli Lilly	1.798.848	0,37
16.949	USD	Atmos Energy	1.795.408	0,37	2.884	USD	Encompass Health	193.689	0,04
6.730	USD	AtriCure	294.774	0,06	3.828	USD	Entergy	354.090	0,07
343	USD	Autodesk	70.970	0,01	87.167	USD	EQT	3.537.236	0,72
22.564	USD	AZEK	671.053	0,14	260	USD	Equinix	188.828	0,04
5.242	USD	Baker Hughes	185.147	0,04	6.100	USD	Eversource Energy	354.715	0,07
37.551	USD	Bank of New York Mellon	1.601.550	0,33	13.799	USD	Exact Sciences	941.368	0,19
7.911	USD	Bath & Body Works	267.392	0,06	13.798	USD	Exelon	521.426	0,11
1.054	USD	Becton Dickinson	272.491	0,06	27.811	USD	Expro Group Holdings	646.050	0,13
					10.857	USD	Federated Hermes	367.727	0,08

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
18.516	USD	Flex	499.562	0,10	18.550	USD	Navigator Holdings	273.984	0,06
21.995	USD	Fluor	807.217	0,17	13.675	USD	Net Power	206.493	0,04
125.164	USD	FNB	1.350.520	0,28	1.836	USD	NiSource	45.312	0,01
3.050	USD	Fortive	226.188	0,05	5.165	USD	Nuvalent	237.435	0,05
71.903	USD	Geron	152.434	0,03	937	USD	NVIDIA	407.586	0,08
2.475	USD	Goldman Sachs Group	800.836	0,17	4.021	USD	ON Semiconductor	373.752	0,08
4.090	GBP	GSK	74.454	0,02	4.858	USD	ONE Gas	331.704	0,07
2.237	USD	Gulfport Energy	265.442	0,05	2.059	USD	Oracle	218.089	0,05
200.778	GBP	Haleon	834.978	0,17	660	USD	Paycom Software	171.118	0,04
7.426	USD	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital	157.431	0,03	4.452	USD	Pfizer	147.673	0,03
2.227	USD	HCA Healthcare	547.797	0,11	70.127	USD	PG&E	1.131.149	0,23
15.437	USD	Health Catalyst	156.222	0,03	2.219	USD	Phillips 66	266.613	0,06
2.272	USD	Hologic	157.677	0,03	1.602	USD	Pioneer Natural Resources	367.739	0,08
10.685	USD	Houlihan Lokey	1.144.577	0,24	10.142	USD	Privia Health Group	233.266	0,05
227	USD	Humana	110.440	0,02	1.192	USD	Progressive	166.046	0,03
1.059	USD	ICON	260.779	0,05	1.673	USD	QuidelOrtho	122.196	0,03
896	USD	Illumina	123.003	0,03	4.205	USD	RayzeBio	93.351	0,02
25.749	USD	ImmunoGen	408.637	0,08	369	USD	Regeneron Pharmaceuticals	303.672	0,06
701	USD	Inari Medical	45.845	0,01	753	USD	RH	199.063	0,04
802	USD	Inspire Medical Systems	159.149	0,03	13.289	USD	Rocket Pharmaceuticals	272.292	0,06
574	USD	Insulet	91.547	0,02	35.663	USD	Roivant Sciences	416.544	0,09
34.893	USD	Intel	1.240.446	0,26	942	USD	Roper Technologies	456.192	0,09
546	USD	Intellia Therapeutics	17.265	-	3.853	USD	Ross Stores	435.196	0,09
2.638	USD	Intercontinental Exchange	290.233	0,06	5.501	USD	S&P Global	2.010.119	0,42
1.440	USD	Intuitive Surgical	420.898	0,09	5.574	USD	Sage Therapeutics	114.713	0,02
3.537	USD	JPMorgan Chase	512.936	0,11	2.683	USD	Salesforce	544.059	0,11
2.885	USD	Karuna Therapeutics	487.825	0,10	225	USD	Sarepta Therapeutics	27.275	0,01
27.618	USD	KKR	1.701.269	0,35	20.284	USD	Schlumberger	1.182.557	0,24
509	USD	KLA	233.458	0,05	1.891	USD	Seagen	401.176	0,08
3.777	USD	Kymera Therapeutics	52.500	0,01	2.175	USD	Sempra	147.965	0,03
985	USD	Laboratory of America Holdings	198.034	0,04	120	USD	ServiceNow	67.075	0,01
3.250	USD	Legend Biotech	218.303	0,05	13.436	USD	Shoals Technologies Group	245.207	0,05
3.685	USD	Lennar	413.568	0,09	2.723	USD	Shockwave Medical	542.149	0,11
5.277	USD	Liberty Media-Liberty Formula One	328.757	0,07	3.136	USD	SilverBow Resources	112.175	0,02
6.124	USD	Marathon Oil	163.817	0,03	5.257	USD	Skyline Champion	334.976	0,07
1.540	USD	Marathon Petroleum	233.064	0,05	3.933	USD	Southwest Gas Holdings	237.593	0,05
8.626	USD	Matador Resources	513.074	0,11	5.131	USD	Sprouts Farmers Market	219.607	0,05
9.098	USD	Merck	936.639	0,19	5.400	USD	StepStone Group	170.532	0,04
336	USD	Meta Platforms	100.871	0,02	4.249	USD	Structure Therapeutics	214.235	0,04
555	USD	Microsoft	175.241	0,04	470	USD	Stryker	128.437	0,03
8.093	USD	Morgan Stanley	660.955	0,14	9.935	USD	Surgery Partners	290.599	0,06
2.315	USD	Morningstar	542.266	0,11	637	USD	Take-Two Interactive Software	89.428	0,02
600	USD	Morphic Holding	13.746	-					
605	USD	MSCI	310.413	0,06					

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
28.576	USD	Targa Resources	2.449.534	0,51
9.007	USD	Tenaris	284.621	0,06
837	USD	Tesla	209.434	0,04
104	USD	Thermo Fisher Scientific	52.642	0,01
1.599	USD	Tidewater	113.641	0,02
2.678	USD	T-Mobile US	375.054	0,08
22.847	USD	Tradeweb Markets	1.832.329	0,38
2.490	USD	Trane Technologies	505.246	0,10
5.779	USD	Uber Technologies	265.776	0,05
2.750	USD	United States Steel	89.320	0,02
2.417	USD	United Therapeutics	545.928	0,11
1.778	USD	UnitedHealth Group	896.450	0,19
9.235	USD	Valaris	692.440	0,14
502	USD	Valero Energy	71.138	0,01
28	USD	Vaxcyte	1.427	-
1.902	USD	Veeva Systems	386.962	0,08
3.847	USD	Veracyte	85.904	0,02
674	USD	Verisk Analytics	159.226	0,03
1.706	USD	Vertex Pharmaceuticals	593.244	0,12
67	USD	Vicor	3.946	-
41.350	USD	Viper Energy Partners	1.152.838	0,24
706	USD	Visa	162.387	0,03
5.488	USD	Vistra	182.092	0,04
1.498	USD	Waste Connections	201.181	0,04
1.205	USD	Waters	330.423	0,07
16.534	USD	Wells Fargo	675.579	0,14
4.635	USD	Welltower	379.699	0,08
5.127	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	544.846	0,11
7.854	USD	Williams	264.601	0,05
102.044	USD	WisdomTree	714.308	0,15
2.196	USD	Workday	471.811	0,10
9.208	USD	WW International	101.933	0,02
2.866	USD	Zoetis	498.627	0,10
2.417	USD	Zoom Video Communications	169.045	0,03
Summe Aktien			168.653.297	34,87
Anleihen				
Österreich			775.033	0,16
1.000.000	EUR	UNIQA Insurance Group 09/12/41, variabel	775.033	0,16
Frankreich			540.077	0,11
300.000	EUR	Orange perpetual, variabel	313.057	0,06
214.190	EUR	Vallourec 30/06/26, 8.50%	227.020	0,05

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Deutschland			3.224.422	0,67
1.200.000	EUR	Allianz 07/09/38, variabel	1.230.110	0,25
400.000	EUR	Allianz 06/07/47, variabel	396.767	0,08
1.500.000	EUR	Allianz 25/07/53, variabel	1.597.545	0,34
Hongkong			1.223.941	0,25
620.000	USD	Melco Resorts Finance 21/07/28, 5.75%	543.864	0,11
825.000	USD	Melco Resorts Finance 04/12/29, 5.38%	680.077	0,14
Mexiko			12.029.713	2,49
2.420.835.400	MXN	Mexico Cetes 23/01/25, ZCP	12.029.713	2,49
Niederlande			617.873	0,13
600.000	EUR	NN Group 03/11/43, variabel	617.873	0,13
Peru			3.574.577	0,74
13.670.000	PEN	Peru Government Bond 12/08/31, 6.95%	3.574.577	0,74
Südkorea			200.302	0,04
200.000	USD	Korea Development Bank 09/03/24, variabel	200.302	0,04
Supranational			1.370.438	0,28
127.500.000	ZAR	Asian Development Bank 30/04/40, ZCP	1.131.986	0,23
13.000.000	TRY	European Bank for Reconstruction & Development 15/10/26, ZCP	192.356	0,04
3.800.000	TRY	International Finance 09/05/27, ZCP	46.096	0,01
USA			821.586	0,17
500.000	USD	United States Treasury Note 31/10/23, variabel	500.018	0,10
504.000	USD	Williams 15/10/51, 3.50%	321.568	0,07
Summe Anleihen			24.377.962	5,04
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			193.031.259	39,91

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
Anleihen				
Kanada			5.572.007	1,16
1.500.000	CAD	Ontario Treasury Bill 18/10/23, ZCP	1.101.859	0,23
1.750.000	CAD	Ontario Treasury Bill 31/01/24, ZCP	1.269.429	0,26

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 30. September 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
1.000.000	CAD	Province of British Columbia Canada 04/10/23, ZCP	735.885	0,15
860.000	CAD	Quebec Treasury Bill 20/10/23, ZCP	631.617	0,13
2.500.000	CAD	Saskatchewan Canada Coupon Strip 02/11/23, ZCP	1.833.217	0,39
Italien			1.035.199	0,21
245.000	USD	Telecom Italia Capital 15/11/33, 6.38%	212.687	0,04
434.000	USD	Telecom Italia Capital 18/07/36, 7.20%	386.551	0,08
476.000	USD	Telecom Italia Capital 04/06/38, 7.72%	435.961	0,09
Macau			1.899.763	0,39
1.805.000	USD	Wynn Macau 07/03/29, 4.50%	1.899.763	0,39
Südkorea			498.039	0,10
500.000	USD	Korea Development Bank 27/10/23, ZCP	498.039	0,10
USA			251.921.587	52,10
905.000	USD	Arsenal AIC Parent 01/10/30, 8.00%	901.624	0,19
255.000	USD	Diamond Foreign Asset 01/10/30, 8.50%	255.279	0,05
1.117.000	USD	Fluor 15/08/29, 1.13%	1.158.608	0,24
1.280.000	USD	Frontier Communications Holdings 15/05/30, 8.75%	1.216.672	0,26
850.000	USD	Ionis Pharmaceuticals 15/06/28, 1.75%	896.325	0,19
1.050.000	USD	Owens-Brockway Glass Container 15/05/31, 7.25%	1.027.688	0,21
980.000	USD	Spirit Loyalty Cayman 20/09/25, 8.00%	980.380	0,20
400.000	USD	Tidewater 03/07/28, 10.38%	414.750	0,09
465.500	USD	Transocean 15/02/30, 8.75%	476.388	0,10
19.945.000	USD	United States Treasury Bill 03/10/23, ZCP	19.936.236	4,12
4.505.000	USD	United States Treasury Bill 05/10/23, ZCP	4.501.207	0,93
35.505.000	USD	United States Treasury Bill 10/10/23, ZCP	35.451.622	7,33
13.490.000	USD	United States Treasury Bill 12/10/23, ZCP	13.466.482	2,78
17.565.000	USD	United States Treasury Bill 17/10/23, ZCP	17.519.756	3,62
29.491.000	USD	United States Treasury Bill 19/10/23, ZCP	29.409.041	6,08
9.295.000	USD	United States Treasury Bill 24/10/23, ZCP	9.262.268	1,92

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermö- gen
18.775.000	USD	United States Treasury Bill 26/10/23, ZCP	18.703.469	3,87
10.370.000	USD	United States Treasury Bill 31/10/23, ZCP	10.322.861	2,13
2.320.000	USD	United States Treasury Bill 02/11/23, ZCP	2.308.819	0,48
14.710.000	USD	United States Treasury Bill 07/11/23, ZCP	14.627.915	3,02
6.525.000	USD	United States Treasury Bill 09/11/23, ZCP	6.486.754	1,34
3.955.000	USD	United States Treasury Bill 14/11/23, ZCP	3.928.881	0,81
985.000	USD	United States Treasury Bill 16/11/23, ZCP	978.207	0,20
11.975.000	USD	United States Treasury Bill 21/11/23, ZCP	11.883.071	2,46
4.390.000	USD	United States Treasury Bill 24/11/23, ZCP	4.354.473	0,90
18.415.000	USD	United States Treasury Bill 28/11/23, ZCP	18.262.319	3,78
165.000	USD	United States Treasury Bill 30/11/23, ZCP	163.560	0,03
10.315.000	USD	United States Treasury Bill 07/12/23, ZCP	10.211.773	2,11
9.980.000	USD	United States Treasury Bill 21/12/23, ZCP	9.859.156	2,04
250.000	USD	United States Treasury Bill 18/01/24, ZCP	245.967	0,05
1.875.000	USD	Viking Cruises 15/07/31, 9.13%	1.880.996	0,40
915.000	USD	Viking Ocean Cruises Ship VII 15/02/29, 5.63%	829.040	0,17
Summe Anleihen			260.926.595	53,96
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			260.926.595	53,96

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen				
Schweiz				
1.867.000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7.25%	-	-
200.000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7.50%	-	-
325.000	USD	Credit Suisse Group perpetual *, 7.50%	-	-
Summe Anleihen			-	-
Summe sonstige Wertpapiere			-	-
Summe Kapitalanlagen			453.957.854	93,87
Sonstiges Nettovermögen			29.648.305	6,13
Nettoinventarwert			483.606.159	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 69 bis 144 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023

Die Gesellschaft

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

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

Anteilsklassen

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

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

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

Ausgabeaufschlag

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

Anteilsklassen	Ausgabeaufschlag
A ¹ -, A2- und K-Anteile	Bis zu 3,09278 % des Nettoinventarwerts je Anteil
A1-Anteile	Bis zu 2,04081 % des Nettoinventarwerts je Anteil
C-, C1-, E- und F-Anteile	Bis zu 1,01010 % des Nettoinventarwerts je Anteil
I-, IF-, IZ-, N-, PI-, R-, R1-, R2-, R3-, R4-, R5-, S-, X-, Y-, Y1- und Y2-Anteile	Kein Ausgabeaufschlag

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

Vertriebsgebühr

Zum Zeitpunkt dieses Berichts fällt für alle A1-Anteilsklassen von Schroder GAIA eine Vertriebsgebühr von 0,50 % an. Auf andere zur Anlage angebotene Anteilsklassen der Gesellschaft wird keine weitere Vertriebsgebühr erhoben.

Swing-Pricing

Der Nettoinventarwert je Anteil eines Teilfonds kann verwässert werden, wenn Anleger Anteile eines Teilfonds zu einem Kurs kaufen oder verkaufen, der die Handels- und sonstigen Kosten im Zusammenhang mit vom Anlageverwalter zur Berücksichtigung von Mittelzu- oder -abflüssen vorgenommenen Wertpapiertransaktionen nicht berücksichtigt. Um diesen Auswirkungen entgegenzuwirken, kann ein Swing-Pricing-Mechanismus angewandt werden, um die Interessen der 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. Derartige Anpassungen können von Teilfonds zu Teilfonds unterschiedlich ausfallen und betragen maximal 2 % des ursprünglichen Nettoinventarwerts je Anteil.

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

Am 30. September 2023, dem letzten Berechnungstag des Berichtsjahrs, wurden für keinen der Teilfonds Swing-Pricing-Anpassungen vorgenommen.

Mindestanlage bei Erstzeichnung, Mindestanlage bei weiteren Zeichnungen und Mindestanlagebestand

Teilfonds	Anteilsklassen	Mindestanlage bei Erstzeichnung	Mindestanlage bei Folgezeichnungen	Mindestanlagebestand
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	A- und C-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000
	I-Anteile	USD 5.000.000	USD 2.500.000	USD 5.000.000
	IZ-Anteile	USD 100.000.000	USD 20.000.000	USD 100.000.000
Schroder GAIA BlueTrend	A-, C-, E- und N-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000
Schroder GAIA Cat Bond	A-, C-, F- und PI-Anteile	USD 100.000	USD 50.000	USD 100.000
	I-Anteile	USD 5.000.000	USD 2.500.000	USD 5.000.000
	IF-Anteile	USD 1.000.000	USD 500.000	USD 1.000.000
	Y-, Y1- und Y2*-Anteile	USD 100.000.000	USD 2.500.000	USD 100.000.000

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

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

Teilfonds	Anteilsklassen	Mindestanlage bei Erstzeichnung	Mindestanlage bei Folgezeichnungen	Mindestanlagebestand
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A-, A1-, C- und E-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000
Schroder GAIA Egerton Equity	A-, A1-, C- und E-Anteile	EUR 10.000	EUR 5.000	EUR 10.000
	X-Anteile	EUR 100.000.000	EUR 2.500.000	EUR 100.000.000
Schroder GAIA Helix	A-, C-, C1-, E- und S-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000
	I-Anteile	USD 5.000.000	USD 2.500.000	USD 5.000.000
	IZ-Anteile	USD 100.000.000	USD 20.000.000	USD 100.000.000
	X-Anteile	USD 100.000.000	USD 2.500.000	USD 100.000.000
Schroder GAIA Oaktree Credit	A2-, C- und E-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000
	I-Anteile	USD 5.000.000	USD 2.500.000	USD 5.000.000
Schroder GAIA SEG US Equity*	C-, K- und R4-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000
	IZ-Anteile	USD 100.000.000	USD 20.000.000	USD 100.000.000
	R1-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	Entfällt
	R2- und R5-Anteile	USD 10.000.000	Entfällt	USD 10.000.000
	R3-Anteile	USD 500.000	Entfällt	Entfällt
Schroder GAIA Sirius US Equity	A-, C- und E-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000
	X-Anteile	USD 100.000.000	USD 2.500.000	USD 100.000.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C- und K-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A-, C-, C1- und E-Anteile	USD 10.000	USD 5.000	USD 10.000

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. Teilfonds, die während des Jahres aufgelöst wurden, werden nach dem Nicht-Fortführungsprinzip ausgewiesen.

Zum Bilanzstichtag betrug der verwahrte Barbetrag für den aufgelösten Teilfonds Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return* 1.994 GBP.

Nettoinventarwert

Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil

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

Der Abschluss wird auf der Grundlage des letzten während des Geschäftsjahres berechneten NIW (29. September 2023 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.

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Nettoinventarwert (Forts.)

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

Der Gesamtabchluss 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.

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 2023 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 MAGNIT PJSC CFD auf TRINITY LIMITED
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Clementia Pharmaceuticals

Besteuerung

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

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

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

Von der Gesellschaft vereinnahmte Zins- und Dividendenerträge unterliegen gegebenenfalls einer nicht erstattungsfähigen Quellensteuer in den Herkunftsländern. 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. Die für das Berichtsjahr tatsächlich anfallenden Gebühren sind in der folgenden Tabelle dargestellt:

Teilfonds	Anteilsklasse	Managementgebühren
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	A-Anteile	2,00 %
	C- und IZ-Anteile	1,25 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA BlueTrend	A-Anteile	1,60 %
	C-, E- und N-Anteile	1,00 %
Schroder GAIA Cat Bond	A- und F-Anteile	1,50 %
	C- und IF-Anteile	1,10 %
	PI-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,10 % (0,46 %)
	Y-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,10 % (0,88 %)
	Y1-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,50 % (1,28 %)
	Y2*-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,10 % (0,24 %)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	1,00 %
Schroder GAIA Egerton Equity	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C- und E-Anteile	1,25 %
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25 % (1,25 %)
Schroder GAIA Helix	A-Anteile	2,00 %
	C-, C1- und IZ-Anteile	1,00 %
	E-Anteile	0,75 %
	S-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00 % (0,35 %)
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00 % (0,60 %)
	I-Anteile	Entfällt
	Schroder GAIA Oaktree Credit	A2-Anteile
C-Anteile		0,75 %
E-Anteile		0,60 %
I-Anteile		Entfällt

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Managementgebühren (Forts.)

Teilfonds	Anteilsklasse	Managementgebühren
Schroder GAIA SEG US Equity*	C- und R3-Anteile	1,40 %
	IZ-, R2- und R5-Anteile	1,15 %
	K-Anteile	1,90 %
	R1-Anteile	1,75 %
	R4-Anteile	2,30 %
Schroder GAIA Sirius US Equity	A-Anteile	2,00 %
	C-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	1,00 %
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25 % (1,25 %)
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund*	C- und R-Anteile	0,75 %
	K-Anteile	1,25 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C-Anteile	1,40 %
	K-Anteile	1,90 %
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A-Anteile	2,00 %
	C- und C1-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	0,75 %

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

Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 20.167 EUR. Bernard Herman und Eric Bertrand erhielten für das Berichtsjahr jeweils eine Vergütung in Höhe von 17.646 EUR. Hugh Mullan erhielt für das Berichtsjahr eine Vergütung in Höhe von 16.000 EUR. Die verbleibenden Verwaltungsratsmitglieder verzichteten auf ihr Honorar.

Performancegebühren

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

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

Nähere Einzelheiten zur Berechnung der während des Berichtsjahres angefallenen Performancegebühren sind in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt. Weitere Angaben zur Berechnung der Performancegebühren sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Die für das Jahr zahlbaren Gebühren sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Fällige Performancegebühren“ ausgewiesen. Die für die einzelnen Anteilsklassen während des Berichtsjahres in Rechnung gestellten Performancegebühren sind auf den Seiten 143-144 aufgeführt.

Teilfonds	Anlageverwalter	Benchmark
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	Schroder Investment Management (Singapore) Ltd.	
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 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	

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Performancegebühren (Forts.)

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

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

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

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

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

Gebühren der Verwahrstelle und der Verwaltungsstelle

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

Wiederanlage von Barsicherheiten

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

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

Bei Fälligkeit der Terminkontrakte zu erhaltende oder zu zahlende Sicherheiten sind in der Nettovermögensaufstellung als „Zu erhaltende/zahlende Nettosicherheiten auf Devisenterminkontrakte für Anteilklassen mit Währungsabsicherung“ ausgewiesen. Forderungen nach zu erhaltenden oder zu zahlenden Sicherheiten sind in der Nettovermögensaufstellung als „Zu erhaltende/zahlende Sicherheitenforderungen 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 2023 waren die folgenden Teilfonds in Devisenterminkontrakten engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*					
Absicherung des Portfolios					
AUD	2.413.000	USD	1.616.651	17. Okt. 2023	(64.417)

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

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short* (Forts.)					
GBP	620.000	USD	797.444	17. Okt. 2023	(40.918)
NZD	260.000	USD	161.640	17. Okt. 2023	(5.809)
SGD	1.267.000	USD	947.037	17. Okt. 2023	(19.611)
USD	57.688	AUD	86.000	17. Okt. 2023	2.366
USD	114.371	SGD	153.000	17. Okt. 2023	2.378
USD					(126.011)
Schroder GAIA BlueTrend					
Absicherung des Portfolios					
AUD	55.800.000	USD	35.921.816	18. Okt. 2023	(25.428)
AUD	2.005.000	USD	1.288.128	25. Okt. 2023	2.044
BRL	4.930.608	USD	980.018	25. Okt. 2023	(2.282)
BRL	4.930.608	USD	1.008.980	22. Nov. 2023	(34.673)
BRL	187.298.489	USD	37.622.045	20. Dez. 2023	(726.042)
CAD	90.601.901	USD	67.179.547	18. Okt. 2023	(460.374)
CAD	3.880.000	USD	2.884.559	25. Okt. 2023	(27.044)
CHF	18.676.886	USD	20.914.584	18. Okt. 2023	(477.470)
CLP	3.637.878.166	USD	4.045.927	20. Dez. 2023	22.878
CNH	21.916.061	USD	3.000.813	10. Okt. 2023	3.032
CNH	147.421.526	USD	20.209.290	18. Okt. 2023	2.768
EUR	39.200.000	USD	41.863.093	18. Okt. 2023	(392.889)
EUR	4.660.000	USD	4.940.766	25. Okt. 2023	(9.402)
GBP	17.900.000	USD	22.210.186	18. Okt. 2023	(368.370)
GBP	565.000	USD	685.911	25. Okt. 2023	3.540
HKD	5.475.000	USD	700.223	25. Okt. 2023	(718)
HUF	3.793.154.828	USD	10.512.665	18. Okt. 2023	(243.911)
IDR	110.614.063.072	USD	7.182.369	20. Dez. 2023	(26.542)
ILS	52.138.096	USD	13.659.311	18. Okt. 2023	19.808
INR	2.173.828.577	USD	26.131.060	20. Dez. 2023	(48.221)
JPY	3.096.468.334	USD	21.039.124	18. Okt. 2023	(264.463)
JPY	76.965.000	USD	517.538	25. Okt. 2023	(490)
KRW	38.339.566.302	USD	28.942.831	20. Dez. 2023	(396.402)
MXN	524.985.389	USD	30.242.235	18. Okt. 2023	(195.405)
MXN	10.875.000	USD	621.308	25. Okt. 2023	331
MXN	29.387.252	USD	1.719.178	20. Dez. 2023	(55.436)
NOK	252.831.229	USD	23.546.771	18. Okt. 2023	99.808
NZD	43.000.000	USD	25.513.478	18. Okt. 2023	258.604
PHP	377.054.754	USD	6.639.763	20. Dez. 2023	24.278
PLN	38.082.789	USD	8.801.226	18. Okt. 2023	(87.443)
SEK	290.762.405	USD	26.116.994	18. Okt. 2023	512.267
SEK	8.440.000	USD	776.115	25. Okt. 2023	(2.914)
SGD	27.668.089	USD	20.285.524	18. Okt. 2023	(31.943)
THB	522.758.389	USD	14.506.077	18. Okt. 2023	(131.063)
TWD	772.103.965	USD	24.311.656	20. Dez. 2023	(153.587)
USD	72.510.912	AUD	113.300.000	18. Okt. 2023	(375.479)
USD	2.944.107	AUD	4.580.000	25. Okt. 2023	(3.020)
USD	1.012.300	BRL	4.930.608	25. Okt. 2023	34.564
USD	26.828.996	BRL	134.810.127	20. Dez. 2023	272.697
USD	96.812.843	CAD	131.627.307	18. Okt. 2023	(117.411)
USD	2.581.958	CAD	3.475.000	25. Okt. 2023	22.714

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)						
USD	36.558.871	CHF	32.765.875	18. Okt. 2023	704.932	
USD	195.579	CHF	175.000	25. Okt. 2023	3.936	
USD	13.345.213	CLP	11.951.467.812	20. Dez. 2023	(21.974)	
USD	2.544.675	CNH	18.598.468	10. Okt. 2023	(4.456)	
USD	34.403.668	CNH	250.619.471	18. Okt. 2023	42.770	
USD	10.021	CZK	230.000	25. Okt. 2023	62	
USD	79.358.832	EUR	74.000.000	18. Okt. 2023	1.073.245	
USD	11.210.371	EUR	10.535.000	25. Okt. 2023	61.892	
USD	37.248.098	GBP	30.100.000	18. Okt. 2023	519.686	
USD	1.808.700	GBP	1.480.000	25. Okt. 2023	2.704	
USD	1.949.640	HKD	15.240.000	25. Okt. 2023	2.525	
USD	8.202.775	HUF	2.992.813.561	18. Okt. 2023	100.690	
USD	5.743	HUF	2.125.000	25. Okt. 2023	(2)	
USD	21.664.174	IDR	333.227.157.701	20. Dez. 2023	107.095	
USD	40.669.273	ILS	155.615.198	18. Okt. 2023	(158.438)	
USD	45.066.044	INR	3.752.545.541	20. Dez. 2023	40.856	
USD	56.453.342	JPY	8.284.130.483	18. Okt. 2023	873.899	
USD	1.581.685	JPY	233.825.000	25. Okt. 2023	10.858	
USD	3.726.232	KRW	4.934.500.498	25. Okt. 2023	64.968	
USD	57.330.963	KRW	75.745.408.999	20. Dez. 2023	933.324	
USD	23.841.424	MXN	414.744.151	18. Okt. 2023	104.104	
USD	58.192.513	NOK	622.906.282	18. Okt. 2023	(66.123)	
USD	52.965.452	NZD	89.500.000	18. Okt. 2023	(676.443)	
USD	26.834	NZD	45.000	25. Okt. 2023	(137)	
USD	17.879.830	PHP	1.016.196.657	20. Dez. 2023	(80.362)	
USD	13.057.729	PLN	56.686.832	18. Okt. 2023	87.128	
USD	23.121	PLN	100.000	25. Okt. 2023	245	
USD	57.642.691	SEK	638.131.350	18. Okt. 2023	(800.101)	
USD	48.105.217	SGD	65.329.882	18. Okt. 2023	282.476	
USD	249.163	SGD	340.000	25. Okt. 2023	197	
USD	31.435.397	THB	1.110.961.147	18. Okt. 2023	885.750	
USD	161.287	THB	5.819.287	25. Okt. 2023	1.166	
USD	818.656	TRY	22.810.000	25. Okt. 2023	9.230	
USD	49.247.925	TWD	1.560.655.003	20. Dez. 2023	417.180	
USD	21.699.379	ZAR	415.854.038	18. Okt. 2023	(235.356)	
USD	800.615	ZAR	15.060.000	25. Okt. 2023	6.769	
ZAR	207.315.207	USD	10.955.533	18. Okt. 2023	(20.438)	
					USD	894.768
Absicherung der Anteilsklasse						
BRL	224.406.533	USD	45.379.115	31. Okt. 2023	(916.609)	
CHF	1.906.587	USD	2.112.361	31. Okt. 2023	(23.060)	
EUR	101.374.535	USD	108.063.572	31. Okt. 2023	(758.048)	
GBP	150.073.235	USD	183.895.193	31. Okt. 2023	(758.230)	
SEK	47.683.171	USD	4.275.578	31. Okt. 2023	93.867	
USD	29.481	BRL	145.862	31. Okt. 2023	581	
USD	247.368	CHF	225.623	31. Okt. 2023	122	
USD	47.171	EUR	44.586	31. Okt. 2023	(26)	
USD	293.649	GBP	240.700	31. Okt. 2023	(82)	
USD	7.704	SEK	85.043	31. Okt. 2023	(89)	
					USD	(2.361.574)
					USD	(1.466.806)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	
Schroder GAIA Cat Bond						
Absicherung des Portfolios						
USD	81.842.361	EUR	76.300.000	24. Nov. 2023	991.766	
USD	12.821.998	NZD	21.500.000	24. Nov. 2023	(64.345)	
					USD	927.421
Absicherung der Anteilsklasse						
CHF	234.220.251	USD	259.541.832	31. Okt. 2023	(2.875.605)	
EUR	814.024.714	USD	867.845.994	31. Okt. 2023	(6.196.170)	
GBP	6.265.490	USD	7.678.003	31. Okt. 2023	(32.118)	
JPY	1.343.819	USD	9.114	31. Okt. 2023	(76)	
SEK	7.364.057.909	USD	660.208.219	31. Okt. 2023	14.596.968	
SGD	434.721	USD	318.975	31. Okt. 2023	(561)	
USD	463.175	CHF	418.618	31. Okt. 2023	4.440	
USD	3.979.253	EUR	3.732.687	31. Okt. 2023	28.183	
USD	10.774	GBP	8.803	31. Okt. 2023	32	
USD	1.811.842	SEK	20.123.421	31. Okt. 2023	(32.167)	
					USD	5.492.926
					USD	6.420.347
Schroder GAIA Contour Tech Equity						
Absicherung des Portfolios						
AUD	1.193.873	USD	773.711	10. Nov. 2023	(5.054)	
CAD	291.341	USD	215.463	10. Nov. 2023	(849)	
EUR	950.698	USD	1.032.703	10. Nov. 2023	(25.935)	
GBP	721.264	USD	901.987	10. Nov. 2023	(21.769)	
JPY	212.093.571	USD	1.463.510	10. Nov. 2023	(34.830)	
NOK	11.691.040	USD	1.106.129	10. Nov. 2023	(11.988)	
USD	1.076.326	AUD	1.671.172	10. Nov. 2023	367	
USD	215.726	CAD	291.341	10. Nov. 2023	1.111	
USD	1.239.994	EUR	1.149.245	10. Nov. 2023	22.971	
USD	643.889	GBP	511.490	10. Nov. 2023	19.675	
USD	1.528.471	JPY	221.628.201	10. Nov. 2023	35.565	
USD	695.556	NOK	7.357.064	10. Nov. 2023	7.022	
					USD	(13.714)
Absicherung der Anteilsklasse						
CHF	2.464.601	USD	2.731.049	31. Okt. 2023	(30.257)	
EUR	43.535.772	USD	46.414.275	31. Okt. 2023	(331.412)	
GBP	12.009.567	USD	14.717.046	31. Okt. 2023	(61.564)	
SEK	66.870.943	USD	5.995.325	31. Okt. 2023	132.391	
SGD	747.836	USD	548.721	31. Okt. 2023	(965)	
USD	72.425	EUR	68.844	31. Okt. 2023	(447)	
USD	89.827	GBP	73.997	31. Okt. 2023	(473)	
					USD	(292.727)
					USD	(306.441)
Schroder GAIA Egerton Equity						
Absicherung des Portfolios						
CHF	6.771.000	EUR	7.097.931	12. Okt. 2023	(97.252)	
EUR	25.478.509	CAD	37.232.000	12. Okt. 2023	(442.678)	
EUR	3.060.313	INR	273.592.000	13. Okt. 2023	(53.212)	
EUR	1.999.592	JPY	313.780.000	12. Okt. 2023	11.361	
EUR	3.831.776	MXN	72.008.000	12. Okt. 2023	(69.076)	
EUR	2.001.169	SEK	23.863.000	12. Okt. 2023	(64.674)	

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)					
EUR	259.973.507	USD	278.479.000	12. Okt. 2023	(3.328.752)
GBP	7.320.000	EUR	8.525.893	12. Okt. 2023	(81.048)
KRW	3.502.142.000	EUR	2.445.630	13. Okt. 2023	9.481
USD	18.406.000	EUR	17.361.900	12. Okt. 2023	40.997
					EUR (4.074.853)
Absicherung der Anteilsklasse					
EUR	483.916	GBP	421.265	31. Okt. 2023	(1.747)
EUR	3.721.999	USD	3.966.374	31. Okt. 2023	(25.145)
GBP	21.233.219	EUR	24.416.663	31. Okt. 2023	62.407
USD	201.528.595	EUR	189.049.977	31. Okt. 2023	1.339.681
					EUR 1.375.196
					EUR (2.699.657)
Schroder GAIA Helix					
Absicherung des Portfolios					
AUD	18.411.000	USD	12.208.045	17. Okt. 2023	(319.374)
AUD	10.669.169	USD	6.909.139	25. Jan. 2024	4.579
BRL	4.240.000	USD	856.373	10. Okt. 2023	(10.235)
CAD	1.684.000	USD	1.246.767	25. Jan. 2024	1.111
CHF	557.000	EUR	583.482	25. Jan. 2024	(4.306)
CHF	6.016.000	USD	6.802.924	25. Jan. 2024	(139.100)
DKK	4.044.000	EUR	542.950	25. Jan. 2024	38
DKK	21.383.000	USD	3.084.548	25. Jan. 2024	(27.446)
EUR	100.436	GBP	87.000	25. Jan. 2024	665
EUR	400.355	NOK	4.583.000	25. Jan. 2024	(5.768)
EUR	30.021.000	USD	32.353.452	25. Jan. 2024	(387.415)
GBP	6.295.000	EUR	7.256.797	25. Jan. 2024	(37.048)
GBP	4.703.000	USD	5.990.889	17. Okt. 2023	(250.153)
GBP	21.502.000	USD	26.795.316	25. Jan. 2024	(528.679)
HKD	377.871.000	USD	48.388.596	25. Jan. 2024	(29.828)
HUF	60.000.000	USD	175.173	10. Okt. 2023	(11.809)
INR	398.497.504	USD	4.769.855	25. Jan. 2024	3.109
JPY	6.109.857.581	USD	42.217.834	25. Jan. 2024	(471.446)
MXN	4.480.000	USD	260.449	10. Okt. 2023	(2.963)
NOK	14.280.000	EUR	1.236.987	25. Jan. 2024	29.114
NOK	18.628.000	USD	1.736.510	25. Jan. 2024	19.643
NZD	2.069.000	USD	1.273.726	17. Okt. 2023	(30.563)
NZD	185.000	USD	109.350	25. Jan. 2024	1.803
SEK	13.450.000	EUR	1.140.310	25. Jan. 2024	31.314
SEK	15.282.000	USD	1.375.348	25. Jan. 2024	39.804
SGD	9.342.000	USD	6.954.605	17. Okt. 2023	(105.853)
SGD	5.359.000	USD	3.954.757	25. Jan. 2024	(7.016)
THB	10.870.000	USD	319.199	27. Okt. 2023	(20.053)
USD	3.258.763	AUD	4.909.000	17. Okt. 2023	88.838
USD	239.553	AUD	374.000	25. Jan. 2024	(2.802)
USD	846.339	BRL	4.240.000	10. Okt. 2023	201
USD	256.619	BRL	1.295.000	17. Nov. 2023	(511)
USD	416.441	BRL	2.110.000	29. Dez. 2023	(541)
USD	3.129.735	BRL	15.566.489	25. Jan. 2024	62.616
USD	169.683	COP	714.980.000	17. Nov. 2023	(4.842)
USD	9.958.339	EUR	9.243.657	25. Jan. 2024	115.791

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)					
USD	1.480.142	GBP	1.158.000	17. Okt. 2023	66.624
USD	8.161.145	GBP	6.545.022	25. Jan. 2024	165.809
USD	749.408	HKD	5.850.000	25. Jan. 2024	743
USD	339.275	HUF	123.550.000	10. Okt. 2023	2.881
USD	69.000	JPY	10.244.982	02. Nov. 2023	(29)
USD	3.890.426	JPY	561.912.098	25. Jan. 2024	51.089
USD	508.809	MXN	8.960.000	10. Okt. 2023	(6.163)
USD	425.268	NZD	694.000	17. Okt. 2023	8.277
USD	2.304.257	SGD	3.070.000	17. Okt. 2023	53.597
USD	302.558	THB	10.870.000	27. Okt. 2023	3.412
					USD (1.652.885)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	656.381	USD	727.341	31. Okt. 2023	(7.632)
EUR	207.663.801	USD	221.394.084	31. Okt. 2023	(1.268.767)
GBP	12.850.763	USD	15.744.503	31. Okt. 2023	(56.712)
JPY	1.224.970	USD	8.308	31. Okt. 2023	(57)
SEK	100.808	USD	9.058	31. Okt. 2023	231
SGD	30.307	USD	22.238	31. Okt. 2023	(5)
USD	891.213	EUR	841.854	31. Okt. 2023	(1.160)
USD	749.202	GBP	615.628	31. Okt. 2023	(2.336)
					USD (1.336.438)
					USD (2.989.323)
Schroder GAIA Oaktree Credit					
Absicherung des Portfolios					
AUD	72.997	USD	47.552	19. Okt. 2023	(590)
EUR	456.200	USD	500.720	19. Okt. 2023	(18.080)
GBP	94.130	USD	122.554	19. Okt. 2023	(7.694)
USD	1.035.277	AUD	1.500.260	19. Okt. 2023	70.116
USD	20.332.721	EUR	18.134.709	19. Okt. 2023	1.146.936
USD	2.797.420	GBP	2.156.923	19. Okt. 2023	165.499
					USD 1.356.187
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	108.298	USD	120.007	31. Okt. 2023	(1.330)
EUR	12.420.229	USD	13.241.410	31. Okt. 2023	(94.524)
GBP	1.917.224	USD	2.349.437	31. Okt. 2023	(9.817)
USD	627	EUR	596	31. Okt. 2023	(4)
USD	66.622	GBP	54.434	31. Okt. 2023	196
					USD (105.479)
					USD 1.250.708
Schroder GAIA SEG US Equity*					
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	4.542.542	USD	5.033.328	31. Okt. 2023	(55.464)
EUR	173.779.620	USD	185.268.401	31. Okt. 2023	(1.321.675)
GBP	10.460.599	USD	12.818.671	31. Okt. 2023	(53.421)
USD	138.144	CHF	125.663	31. Okt. 2023	439
USD	8.165.435	EUR	7.724.537	31. Okt. 2023	(11.031)
USD	361.274	GBP	296.502	31. Okt. 2023	(549)
					USD (1.441.701)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity					
Absicherung des Portfolios					
CHF	130.000	USD	144.806	20. Dez. 2023	(1.501)
DKK	6.165.000	USD	885.680	20. Dez. 2023	(7.683)
EUR	113.000	USD	119.887	20. Dez. 2023	36
GBP	515.000	USD	630.857	20. Dez. 2023	(2.148)
USD	52.700	CAD	71.000	20. Dez. 2023	360
USD	2.436.702	CHF	2.161.000	20. Dez. 2023	54.540
USD	320.788	DKK	2.234.000	20. Dez. 2023	2.630
USD	7.632.716	EUR	7.137.000	20. Dez. 2023	58.470
USD	15.912.993	GBP	12.828.000	20. Dez. 2023	252.647
					USD 357.351
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	3.154.466	USD	3.495.491	31. Okt. 2023	(38.724)
EUR	22.221.133	USD	23.690.335	31. Okt. 2023	(169.140)
GBP	4.057.376	USD	4.972.109	31. Okt. 2023	(20.821)
USD	266.371	CHF	241.998	31. Okt. 2023	1.182
USD	190.644	EUR	180.259	31. Okt. 2023	(162)
USD	50.554	GBP	41.297	31. Okt. 2023	158
					USD (227.507)
					USD 129.844
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
AUD	12.871.001	USD	8.248.094	20. Dez. 2023	50.402
BRL	4.831.206	USD	964.148	11. Okt. 2023	(4.253)
BRL	4.831.206	USD	962.142	03. Nov. 2023	(5.299)
CAD	6.764.541	USD	4.962.246	20. Dez. 2023	24.482
CHF	4.349.094	USD	4.941.344	20. Dez. 2023	(147.152)
CNH	28.336.840	USD	3.902.307	20. Dez. 2023	(5.646)
EUR	15.481.548	USD	16.658.139	20. Dez. 2023	(228.118)
GBP	18.363.255	USD	23.061.089	20. Dez. 2023	(643.337)
ILS	532.724	USD	140.021	20. Dez. 2023	212
INR	580.429	USD	6.973	11. Okt. 2023	14
JPY	570.467.507	USD	3.941.162	20. Dez. 2023	(72.704)
MXN	164.708.751	USD	9.219.892	20. Dez. 2023	105.001
NOK	13.392.484	USD	1.252.960	20. Dez. 2023	1.860
NZD	12.220.921	USD	7.198.797	20. Dez. 2023	126.058
PLN	22.487.660	USD	5.344.162	20. Dez. 2023	(212.700)
SEK	13.828.772	USD	1.251.751	20. Dez. 2023	19.122
SGD	2.244.512	USD	1.655.866	20. Dez. 2023	(7.961)
TWD	3.409.000	USD	105.804	11. Okt. 2023	(84)
USD	4.385.933	AUD	6.846.185	20. Dez. 2023	(28.102)
USD	9.805.663	CAD	13.359.424	20. Dez. 2023	(42.723)
USD	19.388.527	CHF	17.060.027	20. Dez. 2023	582.532
USD	7.205.545	CNH	52.346.240	20. Dez. 2023	7.299
USD	1.626.998	CZK	36.861.741	20. Dez. 2023	32.698
USD	17.779.829	EUR	16.481.548	20. Dez. 2023	288.544
USD	10.417.843	GBP	8.293.167	20. Dez. 2023	293.594
USD	650.820	HUF	239.934.747	20. Dez. 2023	7.717

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)						
USD	502.317	ILS	1.908.000	20. Dez. 2023	61	
USD	6.968	INR	580.429	11. Okt. 2023	(19)	
USD	6.963	INR	580.429	03. Nov. 2023	(16)	
USD	24.304.146	JPY	3.522.754.518	20. Dez. 2023	415.620	
USD	1.336.913	KRW	1.771.476.748	20. Dez. 2023	17.928	
USD	3.364.683	MXN	60.323.580	20. Dez. 2023	(50.502)	
USD	2.228.991	NOK	23.824.536	20. Dez. 2023	(3.268)	
USD	1.600.275	NZD	2.718.759	20. Dez. 2023	(29.268)	
USD	1.992.637	PLN	8.387.180	20. Dez. 2023	78.765	
USD	1.601.578	SEK	17.694.924	20. Dez. 2023	(24.596)	
USD	5.381.849	SGD	7.295.456	20. Dez. 2023	25.578	
USD	106.488	TWD	3.409.000	11. Okt. 2023	768	
USD	105.804	TWD	3.409.000	02. Nov. 2023	(199)	
USD	292.507	TWD	9.291.179	20. Dez. 2023	1.799	
USD	1.233.774	ZAR	23.953.911	20. Dez. 2023	(22.449)	
ZAR	27.635.984	USD	1.422.890	20. Dez. 2023	26.433	
					USD	578.091
Absicherung der Anteilsklasse						
CHF	2.353.213	USD	2.607.619	31. Okt. 2023	(28.888)	
EUR	70.866.407	USD	75.552.094	31. Okt. 2023	(539.597)	
GBP	71.717.518	USD	87.886.292	31. Okt. 2023	(368.163)	
USD	2.216.637	EUR	2.105.461	31. Okt. 2023	(12.005)	
					USD	(948.653)
					USD	(370.562)
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
Absicherung des Portfolios						
AUD	23.765.000	USD	15.375.656	04. Okt. 2023	(95.419)	
AUD	540.000	USD	344.578	02. Nov. 2023	3.006	
AUD	12.268.000	USD	7.877.988	03. Nov. 2023	18.860	
AUD	700.000	USD	450.639	20. Dez. 2023	682	
BRL	74.618.000	USD	15.233.174	03. Okt. 2023	(388.400)	
BRL	7.356.000	USD	1.406.367	10. Okt. 2023	55.376	
BRL	4.926.000	USD	955.021	13. Okt. 2023	23.436	
BRL	61.968.000	USD	12.291.448	03. Nov. 2023	(18.386)	
BRL	18.178.000	USD	3.654.025	04. Dez. 2023	(67.048)	
BRL	5.419.000	USD	1.112.046	29. Jan. 2024	(49.207)	
BRL	3.404.000	USD	691.800	05. Feb. 2024	(24.682)	
BRL	1.840.000	USD	361.671	12. Mrz. 2024	(2.493)	
BRL	3.506.000	USD	685.837	03. Apr. 2024	(3.088)	
CAD	23.487.000	USD	17.375.944	04. Okt. 2023	(83.597)	
CAD	6.117.000	USD	4.531.673	03. Nov. 2023	(26.087)	
CAD	675.000	USD	501.945	20. Dez. 2023	(4.345)	
CHF	16.544.000	USD	18.573.760	04. Okt. 2023	(497.923)	
CHF	6.750.000	USD	7.410.989	03. Nov. 2023	(11.652)	
CLP	7.123.585.000	USD	7.890.443	04. Okt. 2023	125.358	
CLP	418.500.000	USD	460.782	03. Nov. 2023	9.071	
CLP	760.211.000	USD	852.176	20. Dez. 2023	(1.914)	
CNH	131.100.860	USD	17.985.572	10. Okt. 2023	(16.711)	
CNH	20.890.000	USD	2.860.600	03. Nov. 2023	5.297	
CNH	69.951.000	USD	9.618.616	20. Dez. 2023	500	

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
CNY	1.022.000	USD	140.592	20. Dez. 2023	419
COP	51.697.577.000	USD	12.743.888	04. Okt. 2023	(76.007)
COP	51.697.577.000	USD	12.522.145	03. Nov. 2023	28.831
COP	6.968.060.000	USD	1.699.320	20. Dez. 2023	(25.091)
COP	12.039.800.000	USD	2.836.231	14. Feb. 2024	22.459
COP	12.039.800.000	USD	2.793.782	14. Aug. 2024	(34.427)
COP	11.967.700.000	USD	2.726.400	16. Aug. 2024	15.387
CZK	125.415.000	USD	5.571.782	04. Okt. 2023	(136.445)
CZK	90.445.000	USD	3.921.457	03. Nov. 2023	(6.609)
CZK	42.091.000	USD	1.826.199	20. Dez. 2023	(5.728)
DKK	4.648.000	USD	676.327	04. Okt. 2023	(17.419)
DKK	1.534.000	USD	219.165	31. Okt. 2023	(1.388)
EUR	32.347.000	USD	34.994.208	04. Okt. 2023	(793.965)
EUR	5.085.000	USD	5.408.127	31. Okt. 2023	(25.625)
EUR	14.358.000	USD	15.238.157	03. Nov. 2023	(38.137)
EUR	4.533.000	USD	4.857.619	20. Dez. 2023	(46.908)
EUR	253.000	USD	277.035	17. Jan. 2024	(8.125)
EUR	251.000	USD	268.921	22. Feb. 2024	(1.690)
GBP	546.000	AUD	1.066.141	04. Okt. 2023	(19.320)
GBP	546.000	AUD	1.030.978	03. Nov. 2023	2.670
GBP	7.300.000	USD	9.129.273	04. Okt. 2023	(222.487)
GBP	45.000	USD	54.939	31. Okt. 2023	(24)
GBP	7.275.000	USD	8.881.670	03. Nov. 2023	(3.700)
GBP	1.956.000	USD	2.429.307	20. Dez. 2023	(41.434)
GBP	266.000	USD	325.318	27. Mrz. 2024	(404)
HKD	7.062.000	USD	901.510	04. Okt. 2023	314
HKD	2.740.000	USD	350.804	20. Dez. 2023	(318)
HUF	2.762.130.000	USD	7.862.820	04. Okt. 2023	(364.888)
HUF	2.396.930.000	USD	6.461.656	03. Nov. 2023	7.282
HUF	169.360.000	USD	452.834	13. Nov. 2023	3.441
HUF	952.664.000	USD	2.605.592	20. Dez. 2023	(52.143)
HUF	79.642.000	USD	219.848	27. Dez. 2023	(6.531)
IDR	40.331.000.000	USD	2.597.475	04. Okt. 2023	12.098
IDR	10.835.000.000	USD	704.308	20. Dez. 2023	(3.372)
ILS	22.090.000	USD	5.798.187	04. Okt. 2023	(6.519)
ILS	14.345.000	USD	3.753.126	30. Okt. 2023	12.537
ILS	13.805.000	USD	3.621.317	03. Nov. 2023	3.267
ILS	920.000	USD	239.896	11. Dez. 2023	2.141
ILS	15.706.000	USD	4.106.418	20. Dez. 2023	27.979
ILS	455.000	USD	124.914	07. Feb. 2024	(4.826)
ILS	59.000	USD	15.500	29. Mrz. 2024	112
INR	86.214.677	USD	1.036.000	03. Okt. 2023	2.215
INR	2.242.275.000	USD	27.070.730	04. Okt. 2023	(69.950)
INR	1.563.275.000	USD	18.760.050	03. Nov. 2023	35.600
INR	27.615.000	USD	331.831	08. Dez. 2023	(300)
INR	236.817.000	USD	2.838.243	20. Dez. 2023	3.224
JPY	3.068.158.000	USD	20.996.850	04. Okt. 2023	(462.550)
JPY	2.732.215.000	USD	18.414.974	02. Nov. 2023	(32.471)
JPY	108.500.000	USD	752.198	20. Dez. 2023	(16.437)
KRW	38.133.780.000	USD	28.394.278	05. Okt. 2023	(131.481)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
KRW	3.696.750.000	USD	2.747.086	03. Nov. 2023	(2.811)
KRW	922.270.000	USD	698.806	20. Dez. 2023	(12.112)
KZT	288.500.000	USD	611.365	20. Dez. 2023	(18.648)
KZT	130.750.000	USD	281.002	07. Feb. 2024	(15.116)
KZT	104.550.000	USD	224.501	09. Feb. 2024	(11.981)
MXN	708.712.000	USD	40.780.552	04. Okt. 2023	(120.849)
MXN	1.713.000	USD	99.123	17. Okt. 2023	(1.065)
MXN	215.648.000	USD	12.299.847	03. Nov. 2023	7.418
MXN	46.873.000	USD	2.703.172	30. Nov. 2023	(40.422)
MXN	115.177.000	USD	6.452.962	20. Dez. 2023	67.719
MXN	200.910.000	USD	11.549.250	29. Dez. 2023	(192.233)
MXN	73.810.000	USD	4.165.350	03. Jan. 2024	3.387
MXN	200.910.000	USD	11.054.195	28. Jun. 2024	(50.346)
MXN	98.570.000	USD	5.404.205	03. Jul. 2024	(10.091)
MXN	191.220.000	USD	10.552.693	08. Jul. 2024	(97.239)
MXN	77.010.000	USD	4.192.421	13. Sep. 2024	(28.678)
NOK	116.690.000	USD	10.938.588	04. Okt. 2023	(29.256)
NOK	115.474.000	USD	10.847.003	03. Nov. 2023	(42.110)
NZD	50.354.000	USD	29.990.265	04. Okt. 2023	189.389
NZD	40.299.000	USD	24.016.733	03. Nov. 2023	136.648
NZD	650.000	USD	385.849	20. Dez. 2023	3.742
PEN	2.485.000	USD	671.658	04. Okt. 2023	(15.577)
PEN	2.485.000	USD	651.786	03. Nov. 2023	3.091
PEN	1.560.000	USD	417.783	20. Dez. 2023	(7.664)
PHP	37.390.000	USD	657.118	04. Okt. 2023	3.788
PHP	14.395.000	USD	253.536	20. Dez. 2023	881
PLN	39.605.000	USD	9.263.949	04. Okt. 2023	(198.412)
PLN	3.670.000	USD	849.086	20. Dez. 2023	(11.628)
RON	7.435.000	USD	1.598.988	20. Dez. 2023	(20.626)
SEK	54.930.000	USD	4.978.309	04. Okt. 2023	49.548
SEK	1.438.000	USD	129.738	31. Okt. 2023	2.033
SEK	120.210.000	USD	10.920.657	03. Nov. 2023	96.207
SGD	10.127.000	USD	7.475.595	04. Okt. 2023	(67.082)
SGD	3.653.000	USD	2.679.371	03. Nov. 2023	(3.339)
SGD	1.045.000	USD	769.360	20. Dez. 2023	(2.129)
THB	402.555.000	USD	11.019.847	04. Okt. 2023	36.471
THB	58.149.000	USD	1.630.328	12. Dez. 2023	(23.207)
THB	83.898.000	USD	2.342.339	20. Dez. 2023	(21.621)
THB	2.399.000	USD	65.690	26. Dez. 2023	711
THB	44.722.000	USD	1.234.155	07. Feb. 2024	8.606
TRY	154.728.000	USD	5.666.595	04. Okt. 2023	(32.587)
TRY	7.878.000	USD	272.336	20. Dez. 2023	(9.268)
TWD	263.375.000	USD	8.232.556	04. Okt. 2023	(72.486)
TWD	16.955.000	USD	528.605	31. Okt. 2023	(1.517)
TWD	33.380.000	USD	1.037.613	03. Nov. 2023	472
TWD	21.620.000	USD	677.997	20. Dez. 2023	(1.536)
USD	15.289.369	AUD	23.765.000	04. Okt. 2023	9.132
USD	5.005.069	AUD	7.760.000	03. Nov. 2023	9.997
USD	761.459	AUD	1.180.000	20. Dez. 2023	662

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	14.932.832	BRL	74.618.000	03. Okt. 2023	88.058
USD	1.961.946	BRL	9.435.000	10. Okt. 2023	87.077
USD	970.534	BRL	4.710.000	13. Okt. 2023	34.981
USD	160.755	BRL	809.000	24. Nov. 2023	932
USD	2.068.685	BRL	10.296.000	04. Dez. 2023	37.025
USD	897.335	BRL	4.545.000	29. Jan. 2024	5.915
USD	538.030	BRL	2.734.000	05. Feb. 2024	2.219
USD	173.991	BRL	875.000	09. Feb. 2024	2.583
USD	18.101.077	CAD	24.487.000	04. Okt. 2023	72.481
USD	1.092.966	CAD	1.500.000	18. Okt. 2023	(11.632)
USD	634.405	CAD	860.000	20. Okt. 2023	1.084
USD	1.863.536	CAD	2.500.000	02. Nov. 2023	22.143
USD	1.778.035	CAD	2.400.000	03. Nov. 2023	10.272
USD	11.697.830	CAD	15.860.000	20. Dez. 2023	6.053
USD	1.309.495	CAD	1.750.000	31. Jan. 2024	18.557
USD	18.444.720	CHF	16.544.000	04. Okt. 2023	368.885
USD	1.834.952	CHF	1.676.000	03. Nov. 2023	(2.276)
USD	503.832	CHF	447.000	20. Dez. 2023	11.085
USD	8.258.946	CLP	7.123.585.000	04. Okt. 2023	243.145
USD	7.382.522	CLP	6.705.085.000	03. Nov. 2023	(145.333)
USD	1.589.460	CLP	1.432.300.000	20. Dez. 2023	(12.504)
USD	17.994.012	CNH	131.139.485	10. Okt. 2023	19.858
USD	6.536.291	CNH	47.828.000	03. Nov. 2023	(25.227)
USD	265.715	CNH	1.870.000	12. Dez. 2023	8.684
USD	9.439.949	CNH	68.771.000	20. Dez. 2023	(16.903)
USD	113.155	CNH	796.000	18. Jan. 2024	3.494
USD	432.617	CNH	3.120.000	05. Feb. 2024	2.260
USD	124.757	CNH	900.000	20. Feb. 2024	489
USD	25.092	CNH	181.000	23. Feb. 2024	95
USD	848.427	CNY	6.180.000	03. Nov. 2023	(195)
USD	754.378	CNY	5.458.000	18. Jan. 2024	(909)
USD	12.626.160	COP	51.697.577.000	04. Okt. 2023	(41.721)
USD	1.010.085	COP	4.146.400.000	03. Nov. 2023	3.435
USD	344.264	COP	1.404.400.000	20. Dez. 2023	6.826
USD	2.885.513	COP	12.039.800.000	14. Feb. 2024	26.824
USD	2.816.310	COP	11.967.700.000	16. Feb. 2024	(24.047)
USD	2.747.558	COP	12.039.800.000	14. Aug. 2024	(11.797)
USD	3.092.335	CZK	70.350.000	04. Okt. 2023	43.450
USD	147.191	CZK	3.390.000	03. Nov. 2023	457
USD	2.405.891	CZK	54.910.000	20. Dez. 2023	30.989
USD	681.975	DKK	4.658.000	04. Okt. 2023	21.649
USD	1.018.673	DKK	7.130.000	31. Okt. 2023	6.451
USD	1.424	DKK	10.000	03. Nov. 2023	4
USD	343.091	DKK	2.375.000	20. Dez. 2023	4.852
USD	75.000	EGP	2.370.000	27. Nov. 2023	(901)
USD	37.580.671	EUR	34.937.000	04. Okt. 2023	642.041
USD	26.746.832	EUR	25.137.000	31. Okt. 2023	139.174
USD	20.229.504	EUR	19.088.000	03. Nov. 2023	22.093
USD	10.988.043	EUR	10.236.000	20. Dez. 2023	124.937

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	797.916	EUR	708.000	17. Jan. 2024	45.393
USD	716.145	EUR	653.000	22. Feb. 2024	20.917
USD	775.490	EUR	723.000	25. Mrz. 2024	4.586
USD	20.462.168	GBP	16.199.000	04. Okt. 2023	697.651
USD	2.333.556	GBP	1.908.000	31. Okt. 2023	5.191
USD	14.231.118	GBP	11.635.000	03. Nov. 2023	32.467
USD	2.979.254	GBP	2.390.000	20. Dez. 2023	61.558
USD	963.910	HKD	7.550.000	04. Okt. 2023	(231)
USD	62.369	HKD	488.000	03. Nov. 2023	7
USD	471.091	HKD	3.681.000	20. Dez. 2023	237
USD	7.476.289	HUF	2.676.200.000	04. Okt. 2023	211.618
USD	4.910.466	HUF	1.823.000.000	03. Nov. 2023	(9.526)
USD	704.601	HUF	253.621.000	13. Nov. 2023	21.316
USD	1.572.270	HUF	582.100.000	20. Dez. 2023	12.054
USD	466.829	HUF	164.394.000	27. Dez. 2023	26.510
USD	697.850	HUF	263.194.000	28. Dez. 2023	(7.029)
USD	2.638.339	IDR	40.331.000.000	04. Okt. 2023	28.765
USD	2.595.887	IDR	40.331.000.000	03. Nov. 2023	(13.535)
USD	2.071.669	IDR	31.931.000.000	20. Dez. 2023	5.994
USD	18.774.405	ILS	71.255.000	04. Okt. 2023	92.410
USD	13.008.058	ILS	49.690.000	03. Nov. 2023	(38.344)
USD	8.851.943	ILS	33.923.000	20. Dez. 2023	(77.842)
USD	1.036.000	INR	85.697.920	03. Okt. 2023	4.008
USD	26.937.691	INR	2.242.275.000	04. Okt. 2023	(63.090)
USD	604.538	INR	50.092.000	08. Dez. 2023	3.159
USD	906.844	INR	75.680.000	20. Dez. 2023	(1.208)
USD	222.487	INR	18.640.000	11. Mrz. 2024	(263)
USD	25.681.878	JPY	3.748.015.000	04. Okt. 2023	597.491
USD	4.378.687	JPY	647.900.000	31. Okt. 2023	21.216
USD	14.916.599	JPY	2.211.857.000	02. Nov. 2023	35.096
USD	797.619	JPY	115.501.000	20. Dez. 2023	14.382
USD	658.288	JPY	94.438.000	21. Mrz. 2024	8.081
USD	28.539.066	KRW	38.133.780.000	05. Okt. 2023	276.271
USD	12.452.680	KRW	16.646.120.000	03. Nov. 2023	95.462
USD	1.401.631	KRW	1.855.118.000	20. Dez. 2023	20.369
USD	612.258	KZT	288.500.000	20. Dez. 2023	19.541
USD	265.887	KZT	130.750.000	07. Feb. 2024	2
USD	212.500	KZT	104.550.000	09. Feb. 2024	(20)
USD	55.565.204	MXN	949.528.000	04. Okt. 2023	1.089.583
USD	1.145.181	MXN	20.071.000	17. Okt. 2023	(3.760)
USD	20.908.337	MXN	371.634.000	03. Nov. 2023	(301.218)
USD	556.233	MXN	10.213.000	30. Nov. 2023	(23.944)
USD	17.624.491	MXN	314.813.000	20. Dez. 2023	(198.469)
USD	11.376.557	MXN	200.910.000	29. Dez. 2023	19.540
USD	5.561.229	MXN	98.570.000	03. Jan. 2024	(5.936)
USD	10.867.090	MXN	191.220.000	08. Jan. 2024	76.566
USD	404.688	MXN	7.078.000	17. Jan. 2024	5.906
USD	4.324.666	MXN	77.010.000	13. Mrz. 2024	27.866
USD	73.348	MXN	1.332.000	27. Mrz. 2024	(792)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
USD	11.197.669	MXN	200.910.000	28. Jun. 2024	193.820	
USD	4.039.558	MXN	73.810.000	03. Jul. 2024	402	
USD	4.868.143	NOK	52.046.000	04. Okt. 2023	2.371	
USD	5.956.323	NOK	63.621.000	03. Nov. 2023	3.312	
USD	197.959	NOK	2.110.000	20. Dez. 2023	261	
USD	29.914.713	NZD	50.354.000	04. Okt. 2023	(264.942)	
USD	16.237.856	NZD	27.210.000	03. Nov. 2023	(70.576)	
USD	370.113	NZD	625.000	20. Dez. 2023	(4.494)	
USD	652.916	PEN	2.485.000	04. Okt. 2023	(3.164)	
USD	1.120.644	PEN	4.245.000	03. Nov. 2023	1.951	
USD	5.334.039	PEN	19.899.000	20. Dez. 2023	102.664	
USD	658.367	PHP	37.390.000	04. Okt. 2023	(2.539)	
USD	656.748	PHP	37.390.000	03. Nov. 2023	(4.387)	
USD	1.761.901	PHP	100.260.000	20. Dez. 2023	(10.087)	
USD	30.446.088	PLN	127.664.000	04. Okt. 2023	1.223.954	
USD	23.248.008	PLN	101.509.000	03. Nov. 2023	33.179	
USD	1.891.995	PLN	8.207.000	20. Dez. 2023	19.238	
USD	410.934	RON	1.910.000	20. Dez. 2023	5.463	
USD	17.231.465	SEK	188.528.000	04. Okt. 2023	(24.895)	
USD	22.826.494	SEK	248.228.000	03. Nov. 2023	77.186	
USD	1.062.463	SEK	11.764.000	20. Dez. 2023	(18.656)	
USD	11.576.567	SGD	15.700.000	04. Okt. 2023	91.068	
USD	4.094.032	SGD	5.573.000	03. Nov. 2023	11.490	
USD	3.645.903	SGD	4.950.000	20. Dez. 2023	11.648	
USD	11.432.345	THB	402.555.000	04. Okt. 2023	376.028	
USD	11.039.490	THB	402.555.000	03. Nov. 2023	(45.828)	
USD	6.049.019	THB	214.171.000	20. Dez. 2023	124.797	
USD	2.784.627	TRY	76.068.000	04. Okt. 2023	14.813	
USD	202.242	TRY	5.876.000	20. Dez. 2023	6.027	
USD	8.206.215	TWD	263.375.000	04. Okt. 2023	46.146	
USD	6.177.353	TWD	198.826.000	03. Nov. 2023	(5.939)	
USD	845.957	TWD	27.085.000	20. Dez. 2023	(1.496)	
USD	164.283	ZAR	3.032.000	03. Okt. 2023	4.145	
USD	21.365.187	ZAR	399.751.000	04. Okt. 2023	253.786	
USD	23.028.265	ZAR	433.771.000	03. Nov. 2023	182.203	
USD	369.035	ZAR	7.115.000	13. Nov. 2023	(5.359)	
USD	1.829.434	ZAR	35.219.000	20. Dez. 2023	(17.569)	
UYU	14.325.000	USD	372.461	20. Dez. 2023	(5.210)	
ZAR	6.464.000	USD	341.045	03. Okt. 2023	356	
ZAR	11.910.000	USD	633.133	04. Okt. 2023	(4.150)	
ZAR	69.110.000	USD	3.634.590	03. Nov. 2023	5.330	
ZAR	13.250.000	USD	691.812	13. Nov. 2023	5.408	
ZAR	11.412.000	USD	598.269	20. Dez. 2023	214	
ZAR	13.044.000	USD	674.387	28. Dez. 2023	9.186	
					USD	2.922.430
Absicherung der Anteilsklasse						
BRL	110.852.741	USD	22.416.457	31. Okt. 2023	(452.789)	
CHF	11.414.698	USD	12.647.970	31. Okt. 2023	(139.369)	
EUR	160.719.193	USD	171.345.753	31. Okt. 2023	(1.223.567)	

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
GBP	84.923.882	USD	104.070.204	31. Okt. 2023	(436.121)
SGD	2.626.613	USD	1.927.270	31. Okt. 2023	(3.392)
USD	750.891	BRL	3.761.339	31. Okt. 2023	5.642
USD	610.222	EUR	580.048	31. Okt. 2023	(3.762)
USD	955.784	GBP	787.057	31. Okt. 2023	(4.675)
				USD	(2.258.033)
				USD	664.397

Die Devisenterminkontrakte bezogen sich auf die folgenden Kontrahenten:

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	ANZ	2.366
	Canadian Imperial Bank of Commerce	(3.978)
	Citi Bank	(5.809)
	Royal Bank of Canada	(95.630)
	Standard Chartered Bank	(18.253)
	State Street	(5.227)
	The Bank of New York Mellon	(1.858)
	UBS	2.378
	USD	(126.011)
Schroder GAIA BlueTrend	HSBC	(2.361.574)
	UBS	894.768
		USD
Schroder GAIA Cat Bond	Brown Brothers Harriman & Co	927.421
	HSBC	5.492.926
		USD
Schroder GAIA Contour Tech Equity	HSBC	(292.727)
	Morgan Stanley	(13.714)
		USD
Schroder GAIA Egerton Equity	Brown Brothers Harriman & Co	(4.031.122)
	HSBC	1.331.465
		EUR
Schroder GAIA Helix	Goldman Sachs	(1.651.599)
	HSBC	(1.336.438)
	J.P. Morgan	(1.286)
		USD
Schroder GAIA Oaktree Credit	HSBC	(105.479)
	State Street	1.356.187
		USD
Schroder GAIA SEG US Equity*	HSBC	(1.441.701)
		USD

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity	HSBC	(227.507)
	Morgan Stanley	357.351
		USD 129.844
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	222.618
	Deutsche Bank	(344.367)
	HSBC	(948.653)
	Morgan Stanley	19.726
	Newedge Group	680.114
		USD (370.562)
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Bank of America	74.386
	Barclays Bank	1.866.336
	BNP Paribas	14.277
	Citi Bank	(14.489)
	Deutsche Bank	(148.377)
	Goldman Sachs	236.711
	HSBC	(2.009.491)
	J.P. Morgan	(88.341)
	Morgan Stanley	250.519
	Standard Chartered Bank	(50.403)
UBS	533.269	
		USD 664.397

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 2023 war der folgende Teilfonds in offenen Kassageschäften engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Abrechnungsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
EUR	1.985.321	USD	2.086.122	02. Okt. 2023	12.860
EUR	10.896	USD	11.518	04. Okt. 2023	1
GBP	819.000	USD	998.312	02. Okt. 2023	950
THB	2.577.600	USD	70.673	03. Okt. 2023	116
USD	964.698	BRL	4.831.206	11. Okt. 2023	3.560
					USD 17.487

Kontrahenten von Kassageschäften

Fonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Brown Brothers Harriman & Co	12.861
	Deutsche Bank	3.676
	Morgan Stanley	950
		USD 17.487

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Terminkontrakte

Terminkontrakte wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Terminkontrakten“ aufgeführt. Zum 30. September 2023 hielten die folgenden Teilfonds offene Terminkontrakte auf Indizes (mit Marktwert Risiken), Rentenwerte und Währungen:

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Sep. 24	9	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(2.134.575)	94,82	1.238
Dez. 24	11	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(2.614.563)	95,09	(412)
Mrz. 25	11	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(2.622.938)	95,41	(838)
Jun. 26	115	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(27.677.238)	96,06	59.988
Sep. 26	122	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(29.374.813)	96,07	74.988
Dez. 26	121	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(29.134.863)	96,07	75.200
Mrz. 27	120	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(28.896.075)	96,06	79.575
Jun. 27	122	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(29.382.738)	96,04	92.063
Sep. 27	116	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(27.935.838)	96,01	94.388
Dez. 27	113	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(27.214.800)	95,97	103.275
Dez. 23	285	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(181.146.654)	9,90	(171.616)
Mrz. 24	277	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(176.224.238)	9,89	60.075
Jun. 24	224	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	(142.375.854)	9,89	(71.381)
Sep. 24	25	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	15.904.506	9,89	(4.826)
Okt. 23	18	Amsterdam Index Future	Morgan Stanley	EUR	2.810.012	730,25	(30.607)
Dez. 23	422	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(31.008.736)	111,97	627.733
Dez. 23	1.719	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(117.248.561)	105,34	822.145
Mrz. 24	360	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(62.575.722)	94,33	74.342
Jun. 24	65	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(11.306.976)	94,39	14.228
Sep. 24	58	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(10.116.391)	94,62	15.231
Dez. 24	40	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(6.998.049)	94,82	17.007
Okt. 23	1.717	BIST 30 Index Future	Morgan Stanley	TRY	5.535.933	9.078,75	149.358
Okt. 23	42	CAC 40 Index Future	Morgan Stanley	EUR	(3.163.741)	7.151,50	(11.846)
Dez. 23	956	Canada 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	(82.955.708)	115,13	1.921.819
Okt. 23	18	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(304.450)	17,77	(15.432)
Nov. 23	27	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(479.700)	18,25	(12.950)
Dez. 23	3	Dax Index Future	Morgan Stanley	EUR	1.255.246	15.526,00	(24.132)
Dez. 23	11	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	J.P. Morgan	USD	(1.872.905)	33.725,00	18.030
Dez. 23	4	E-mini S&P 500 ESG Future	Morgan Stanley	USD	806.680	383,22	(40.240)
Dez. 23	5	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	1.119.100	4.325,50	(37.725)
Jun. 24	66	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(16.779.720)	96,19	(264)
Sep. 24	43	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(10.957.497)	96,40	1.784
Dez. 24	45	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(11.490.735)	96,62	(714)
Mrz. 26	318	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(81.585.007)	97,00	55.175
Dez. 23	36	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(4.920.103)	122,36	262.959
Dez. 23	43	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	(1.889.200)	4.204,00	(22.012)
Dez. 23	189	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(23.251.221)	115,75	122.028
Dez. 23	152	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(18.174.941)	109,73	541.111
Dez. 23	87	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(11.987.513)	128,64	155.109
Dez. 23	364	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(48.333.832)	123,20	921.668
Dez. 23	54	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	5.112.445	7.671,00	(58.376)
Okt. 23	782	FTSE China A50 Future	Morgan Stanley	USD	(9.822.160)	12.598,00	(29.476)
Dez. 23	20	FTSE MIB Index Future	Morgan Stanley	EUR	3.058.968	28.283,00	(68.748)
Okt. 23	166	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	9.458.862	1.425,00	3.138
Dez. 23	166	FTSE/JSE Top 40 Future	Morgan Stanley	ZAR	(6.067.231)	67.450,00	153.611
Okt. 23	71	Hang Seng Index Future	Morgan Stanley	HKD	(7.953.377)	17.889,00	(156.233)
Okt. 23	156	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	(6.045.544)	6.181,00	(111.027)
Okt. 23	1	IBEX 35 Index Future	Morgan Stanley	EUR	(99.001)	9.440,00	(804)
Sep. 24	59	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	17.016.872	94,74	32.988
Dez. 24	51	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	14.745.335	94,93	21.459
Mrz. 25	46	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	13.338.087	95,13	9.746

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Jun. 26	215	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(62.661.574)	95,71	(105.401)
Okt. 23	137	IFSC Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	5.424.100	19.710,50	(23.423)
Dez. 23	110	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	(107.208.211)	144,96	505.855
Dez. 23	83	KOSPI2 Index Future	J.P. Morgan	KRW	(5.055.599)	329,00	(3.502)
Dez. 23	126	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(14.544.189)	94,16	68.728
Okt. 23	3.066	Mini Bovespa Future	Morgan Stanley	BRL	(14.264.313)	117.222,00	(35.859)
Dez. 23	93	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(9.597.990)	2.041,50	105.015
Dez. 23	355	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(17.410.629)	955,50	450.504
Okt. 23	252	MSCI Singapore Index ETS Future	Morgan Stanley	SGD	(5.196.119)	285,65	(69.704)
Dez. 23	6	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1.772.930)	14.866,50	(11.050)
Dez. 23	17	Nikkei 225 (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	3.743.575	31.860,00	(119.244)
Dez. 23	17	Nikkei 225 (SGX) Future	Morgan Stanley	JPY	1.870.483	32.005,00	(50.070)
Okt. 23	125	OMXS30 Index Future	Morgan Stanley	SEK	(2.483.398)	2.160,00	12.127
Dez. 23	66	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(6.163.745)	1.798,60	228.365
Dez. 23	10	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(2.565.880)	2.520,40	45.480
Dez. 23	49	S&P/TSX 60 Index Future	J.P. Morgan	CAD	(8.499.908)	1.176,30	12.708
Dez. 23	937	SET 50 Index Future	J.P. Morgan	THB	(4.726.681)	901,60	86.521
Dez. 23	762	Short-Term Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(84.249.301)	104,15	343.511
Dez. 23	811	South Korea 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	(65.252.942)	107,90	404.194
Dez. 23	2.421	South Korea 3 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	(185.034.341)	103,05	149.170
Dez. 23	13	SPI 200 Future	Morgan Stanley	AUD	(1.476.374)	7.086,00	(4.308)
Dez. 23	16	Stoxx Euro ESG-X Index Future	Morgan Stanley	EUR	290.934	168,90	(5.223)
Dez. 23	58	Swiss Market Index Future	Morgan Stanley	CHF	(6.981.286)	11.002,00	10.007
Dez. 23	75	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	11.798.452	2.323,50	(137.418)
Dez. 23	191	WIG20 Index Future	Morgan Stanley	PLN	1.733.144	1.944,00	(33.287)
						USD	7.535.496
Schroder GAIA Helix							
Okt. 23	29	CBOE VIX Future	Goldman Sachs	USD	463.314	17,77	52.051
Dez. 23	34	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	7.248.508	4.325,50	104.843
Dez. 23	57	Euro Stoxx 50 Future	Goldman Sachs	EUR	(2.565.458)	4.204,00	28.397
Dez. 23	135	Euro Stoxx Future	J.P. Morgan	EUR	(3.232.904)	444,00	59.830
Dez. 23	151	FTSE 100 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(13.938.471)	7.671,00	(199.415)
Dez. 23	134	FTSE 250 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(6.083.011)	18.358,00	77.974
Dez. 23	233	MSCI Asia Future	J.P. Morgan	USD	(12.439.800)	520,10	321.470
Dez. 23	397	MSCI China Future	J.P. Morgan	USD	9.073.119	445,60	(227.959)
Dez. 23	80	MSCI EAFE Index Future	J.P. Morgan	USD	(8.433.150)	2.041,50	267.150
Dez. 23	128	MSCI Emerging Market Index Future	J.P. Morgan	USD	(6.354.970)	955,50	239.770
Dez. 23	829	MSCI Europe Future	J.P. Morgan	EUR	(26.071.931)	293,65	298.160
Dez. 23	145	MSCI Poland Future	Goldman Sachs	USD	(2.327.815)	158,40	31.014
Dez. 23	332	MSCI World Index Future	J.P. Morgan	USD	(30.854.027)	9.019,00	910.946
Dez. 23	142	MSCI World Small Cap Index Future	J.P. Morgan	USD	(8.621.582)	591,40	223.702
Dez. 23	48	SPI 200 Future	J.P. Morgan	AUD	(5.483.754)	7.086,00	(4.211)
Dez. 23	79	Topix Index Future	J.P. Morgan	JPY	(12.448.953)	2.323,50	148.299
Dez. 23	5	US 10 Year Note Future (CBT)	Goldman Sachs	USD	(545.703)	108,06	5.391
Dez. 23	3	US Ultra Bond Future (CBT)	Goldman Sachs	USD	(373.257)	118,69	17.194
						USD	2.354.606
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Jun. 24	43	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(10.174.188)	94,63	2.000
Sep. 24	122	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(28.971.692)	94,82	53.117
Dez. 24	95	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(22.653.638)	95,09	69.763

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Mrz. 25	93	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(22.234.963)	95,41	52.138
Jun. 25	61	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(14.607.583)	95,70	14.096
Sep. 25	16	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(3.825.613)	95,89	(9.788)
Dez. 25	39	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	9.374.488	96,00	(14.975)
Mrz. 26	37	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	8.883.700	96,05	463
Dez. 23	14	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(3.567.611)	96,01	15.066
Jun. 24	63	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(16.176.348)	96,19	159.090
Sep. 24	54	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	13.895.040	96,40	(136.702)
Dez. 24	80	3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	20.602.978	96,62	(173.737)
Dez. 23	24	Australia 10 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	(1.771.658)	111,97	43.828
Dez. 23	22	Australia 3 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	1.500.209	105,34	(10.168)
Dez. 23	3	Australian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	193.835	64,55	(185)
Jun. 24	7	Bankers' Acceptance Future	Citi Bank	CAD	(1.220.394)	94,39	4.251
Dez. 23	3	British Pound Future	Morgan Stanley	USD	232.706	122,10	(3.769)
Okt. 23	7	CAC 40 Index Future	Citi Bank	EUR	(534.889)	7.151,50	5.625
Dez. 23	193	Canada 10 Year Bond Future	Citi Bank	CAD	(16.863.729)	115,13	504.377
Dez. 23	3	Canadian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(222.195)	73,84	690
Okt. 23	72	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(1.261.243)	17,77	(18.283)
Nov. 23	42	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(705.002)	18,25	(61.342)
Dez. 23	3	Dax Index Future	Newedge Group	EUR	(1.228.498)	15.526,00	(2.617)
Dez. 23	182	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Morgan Stanley	USD	(31.680.531)	33.725,00	990.781
Okt. 23	2	Dubai IRD FX Future	Newedge Group	USD	48.168	120,26	(64)
Dez. 23	29	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	6.290.825	4.325,50	(18.850)
Dez. 23	6	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Newedge Group	EUR	(843.707)	122,36	67.516
Dez. 23	2	Euro FX Future	Morgan Stanley	USD	267.510	1,06	(2.198)
Dez. 23	596	Euro Stoxx 50 Future	Newedge Group	EUR	26.944.277	4.204,00	(453.991)
Dez. 23	69	Euro Stoxx Bank Future	Morgan Stanley	EUR	398.149	111,95	10.190
Dez. 23	108	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(13.397.788)	115,75	181.106
Dez. 23	97	Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	11.612.527	109,73	(359.359)
Dez. 23	319	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(44.616.139)	128,64	1.230.660
Dez. 23	130	Euro-OAT Future	Newedge Group	EUR	(17.472.874)	123,20	539.959
Dez. 23	155	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(17.279.572)	104,99	74.467
Dez. 23	199	FTSE 100 Index Future	Newedge Group	GBP	18.467.360	7.671,00	157.820
Okt. 23	180	FTSE China A50 Future	Newedge Group	USD	(2.255.897)	12.598,00	(11.743)
Dez. 23	65	FTSE/JSE Top 40 Future	Newedge Group	ZAR	(2.377.999)	67.450,00	62.425
Okt. 23	8	IBEX 35 Index Future	Newedge Group	EUR	794.883	9.440,00	3.552
Mrz. 24	9	ICE 3 Month SONIA Index Future	Newedge Group	GBP	2.594.634	94,61	2.623
Okt. 23	99	IFSC Nifty 50 Future	Newedge Group	USD	3.904.278	19.710,50	(1.599)
Dez. 23	30	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Newedge Group	JPY	29.304.202	144,96	(203.560)
Dez. 23	2	Japanese Yen Future	Morgan Stanley	USD	(172.493)	67,78	3.055
Dez. 23	41	KOSDAQ150 Index Future	Newedge Group	KRW	421.777	1.330,00	(17.672)
Dez. 23	150	KOSPI2 Index Future	Newedge Group	KRW	(9.383.911)	329,00	240.959
Dez. 23	144	Long Gilt Future	Newedge Group	GBP	16.605.426	94,16	(62.042)
Dez. 23	7	Mexican Peso Future	Morgan Stanley	USD	198.954	5,67	(434)
Dez. 23	16	MSCI EAFE Index Future	Citi Bank	USD	(1.691.965)	2.041,50	58.765
Dez. 23	169	MSCI Emerging Market Index Future	Citi Bank	USD	(8.362.618)	955,50	288.643
Okt. 23	0	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	571	282,40	(571)
Okt. 23	149	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	(3.060.951)	285,65	(52.571)
Dez. 23	9	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	2.739.095	14.866,50	(63.125)
Dez. 23	1	New Zealand Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(59.245)	60,02	(770)
Dez. 23	3	Nikkei 225 (OSE) Future	Newedge Group	JPY	662.540	31.860,00	(22.952)
Dez. 23	31	Nikkei 225 (YEN) Future	Morgan Stanley	JPY	(3.374.030)	31.825,00	73.123
Okt. 23	51	OMXS30 Index Future	Newedge Group	SEK	(1.013.091)	2.160,00	4.813
Dez. 23	239	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(22.302.080)	1.798,60	808.810

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (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. 23	10	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	2.605.300	2.520,40	(84.900)
Dez. 23	29	S&P/TSX 60 Index Future	Citi Bank	CAD	5.184.237	1.176,30	(161.200)
Dez. 23	22	SET 50 Index Future	Newedge Group	THB	110.989	901,60	(2.042)
Dez. 23	58	Short-Term Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	6.437.743	104,15	(51.213)
Dez. 23	150	South Korea 10 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	12.041.411	107,90	(47.191)
Dez. 23	16	South Korea 3 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	1.222.232	103,05	(356)
Dez. 23	66	SPI 200 Future	Newedge Group	AUD	7.654.159	7.086,00	(136.852)
Dez. 23	3	Stoxx 600 Bank Future	Newedge Group	EUR	(24.824)	162,05	(875)
Dez. 23	99	Stoxx Europe 600 Future	Newedge Group	EUR	2.402.334	453,20	(30.563)
Dez. 23	1	Swiss Franc Future	Morgan Stanley	USD	140.994	110,16	(3.294)
Okt. 23	71	TAIEX Future	Newedge Group	TWD	7.373.033	16.367,00	(173.287)
Dez. 23	44	Topix Index Future	Newedge Group	JPY	(6.907.388)	2.323,50	66.247
Dez. 23	1	UD Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	104.340	105,82	1.475
Dez. 23	427	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	47.281.344	108,06	(1.138.657)
Dez. 23	38	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(4.397.336)	111,56	157.961
Dez. 23	98	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	19.958.844	101,36	(93.172)
Dez. 23	4	US 3 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	832.109	103,14	(6.953)
Dez. 23	220	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(23.382.241)	105,36	203.179
Okt. 23	20	US Dollar Index Future	Newedge Group	KRW	196.532	1.349,00	3.409
Dez. 23	64	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(7.684.805)	113,78	402.805
Dez. 23	34	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(4.338.688)	118,69	303.313
Okt. 23	144	VSTOXX Mini Future	Newedge Group	EUR	(252.212)	17,70	(17.260)
Dez. 23	15	WIG20 Index Future	Newedge Group	PLN	(136.793)	1.944,00	3.296
						USD	3.214.574
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Okt. 23	55	30 Day Fed Funds Future	Morgan Stanley	USD	(21.686.214)	94,67	(11.303)
Dez. 23	183	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(13.515.865)	111,97	341.165
Dez. 23	24	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	1.637.996	105,34	(12.497)
Dez. 23	21	Canada 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	1.812.310	115,13	(32.277)
Dez. 23	2	Canada 5 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	(160.869)	107,98	1.870
Dez. 23	18	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	3.916.625	4.325,50	(23.675)
Dez. 23	17	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(2.218.724)	122,36	19.517
Dez. 23	36	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(4.449.701)	115,75	44.140
Dez. 23	4	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(473.130)	109,73	9.082
Dez. 23	10	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(1.383.840)	128,64	23.793
Dez. 23	40	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(5.330.506)	123,20	120.379
Dez. 23	318	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	35.330.251	104,99	(32.037)
Okt. 23	140	FTSE China A50 Future	Morgan Stanley	USD	(1.772.050)	12.598,00	8.330
Dez. 23	89	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(10.348.022)	94,16	123.291
Dez. 23	61	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(6.402.250)	2.041,50	175.675
Okt. 23	1	MSCI Singapore Index ETS Future	Morgan Stanley	SGD	(20.505)	285,65	(391)
Dez. 23	2	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(187.245)	1.798,60	7.385
Dez. 23	4	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	(629.617)	2.323,50	7.695
Dez. 23	199	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	21.818.530	108,06	(314.092)
Dez. 23	4	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	453.719	111,56	(7.469)
Dez. 23	140	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	28.357.930	101,36	21.602
Dez. 23	279	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	29.298.808	105,36	96.457
Dez. 23	61	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	7.535.914	113,78	(595.258)
Dez. 23	75	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(9.318.984)	118,69	417.422
						USD	388.804

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Optionskontrakte

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

Zum 30. September 2023 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)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend						
(5.006.764)	Put auf UBS ETC Linked to a Systematica Strategy Delta-1 Basket on Commodity Future Ausübungskurs 56,57 Läuft am 02. Okt. 2023 ab	UBS	USD	(26.263)	-	26.263
				USD	-	26.263
Schroder GAIA Contour Tech Equity						
(251)	Call auf Meta Platforms, Inc. Ausübungskurs 305,00 Läuft am 19. Jan. 2024 ab	Morgan Stanley	USD	(714.331)	(639.423)	74.908
(239)	Call auf Netflix, Inc. Ausübungskurs 430,00 Läuft am 19. Jan. 2024 ab	Bank of America	USD	(917.503)	(393.155)	524.348
250	Call auf NVIDIA Corp. Ausübungskurs 500,00 Läuft am 19. Jan. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	748.670	563.750	(184.920)
(250)	Call auf NVIDIA Corp. Ausübungskurs 780,00 Läuft am 17. Jan. 2025 ab	Goldman Sachs	USD	(587.750)	(583.750)	4.000
344	Call auf Zillow Group, Inc. Ausübungskurs 60,00 Läuft am 16. Feb. 2024 ab	Bank of America	USD	193.672	44.548	(149.124)
				USD	(1.008.030)	269.212
Schroder GAIA Helix						
125	Put auf Deutsche Boerse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 14.900,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	UBS	EUR	82.313	45.493	(36.820)
125	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 7.300,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	Goldman Sachs	GBP	60.304	24.793	(35.511)
61	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 7.400,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	UBS	GBP	29.993	21.778	(8.215)
80	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 7.500,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	Goldman Sachs	GBP	28.854	49.310	20.456
4	Put auf NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 14.000,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	UBS	USD	50.039	27.660	(22.379)
25	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.210,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	UBS	USD	103.417	84.750	(18.667)
30	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.300,00 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	UBS	USD	94.989	191.550	96.561
				USD	445.334	(4.575)
Schroder GAIA SEG US Equity*						
130	Call auf Cloudflare, Inc. Ausübungskurs 100,00 Läuft am 17. Jan. 2025 ab	Goldman Sachs	USD	191.494	102.375	(89.119)
330	Call auf Coherent Corp. Ausübungskurs 55,00 Läuft am 19. Jan. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	201.475	6.600	(194.875)
111	Call auf Estee Lauder Cos., Inc. Ausübungskurs 155,00 Läuft am 16. Jan. 2026 ab	Goldman Sachs	USD	386.907	335.220	(51.687)
47	Call auf Illumina, Inc. Ausübungskurs 200,00 Läuft am 16. Jan. 2026 ab	Goldman Sachs	USD	142.845	102.225	(40.620)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA SEG US Equity* (Forts.)						
1.813	Call auf Intel Corp. Ausübungskurs 30,00 Läuft am 17. Jan. 2025 ab	Goldman Sachs	USD	1.632.709	1.758.610	125.901
206	Call auf JPMorgan Chase & Co. Ausübungskurs 130,00 Läuft am 19. Jan. 2025 ab	Goldman Sachs	USD	649.009	669.500	20.491
176	Call auf PayPal Holdings, Inc. Ausübungskurs 70,00 Läuft am 16. Jan. 2026 ab	Goldman Sachs	USD	270.757	223.080	(47.677)
1.621	Call auf VF Corp. Ausübungskurs 32,50 Läuft am 17. Jan. 2025 ab	Goldman Sachs	USD	181.599	105.365	(76.234)
				USD	3.302.975	(353.820)
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
586	Call auf Canadian Natural Resources Ltd. Ausübungskurs 67,50 Läuft am 20. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	75.805	35.160	(40.645)
9.900	Call auf China Vanke Co., Ltd. Ausübungskurs 16,11 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	CNY	834	13	(821)
(9.900)	Call auf China Vanke Co., Ltd. Ausübungskurs 19,04 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	CNY	(203)	(5)	198
217.478	Call auf Commerzbank AG Ausübungskurs 10,50 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	EUR	89.154	211.548	122.394
1.090.000	Call auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 94,70 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	AUD	7.569	11.614	4.045
657.000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,81 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Barclays Bank	EUR	6.228	684	(5.544)
633.000	Call auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,82 Läuft am 04. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	EUR	6.500	6	(6.494)
659.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,06 Läuft am 26. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	EUR	5.675	4.324	(1.351)
657.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,07 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Citi Bank	EUR	5.378	1.849	(3.529)
656.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,07 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Barclays Bank	EUR	9.629	6.029	(3.600)
637.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,10 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	Citi Bank	EUR	9.844	240	(9.604)
2.826.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,11 Läuft am 21. Mrz. 2024 ab	Bank of America	EUR	20.907	16.960	(3.947)
3.095.000	Call auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,14 Läuft am 12. Okt. 2023 ab	Goldman Sachs	EUR	21.650	-	(21.650)
568.000	Call auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,94 Läuft am 11. Okt. 2023 ab	Citi Bank	GBP	6.725	22	(6.703)
542.000	Call auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,95 Läuft am 04. Okt. 2023 ab	UBS	GBP	6.463	4	(6.459)
571.000	Call auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 180,48 Läuft am 26. Okt. 2023 ab	Bank of America	GBP	7.080	9.443	2.363
1.170.000	Call auf NZD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,60 Läuft am 26. Okt. 2023 ab	Citi Bank	NZD	7.702	9.211	1.509

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1.504.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,00 Läuft am 07. Feb. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	62.911	64.927	2.016
1.507.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,02 Läuft am 21. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	40.901	35.576	(5.325)
971.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,21 Läuft am 29. Sep. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	11.603	-	(11.603)
883.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,23 Läuft am 21. Dez. 2023 ab	HSBC	USD	9.594	13.493	3.899
764.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,49 Läuft am 08. Mrz. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	12.837	11.814	(1.023)
1.491.000	Call auf USD/BRL-Devisenkurs Ausübungskurs 5,52 Läuft am 01. Apr. 2024 ab	Barclays Bank	USD	24.870	25.497	627
693.000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,34 Läuft am 07. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	8.732	12.732	4.000
704.000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,34 Läuft am 19. Dez. 2023 ab	Bank of America	USD	7.982	11.222	3.240
684.000	Call auf USD/CAD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,36 Läuft am 04. Okt. 2023 ab	Citi Bank	USD	4.362	1.583	(2.779)
696.000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,87 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	UBS	USD	11.000	33.632	22.632
699.000	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,89 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Barclays Bank	USD	9.684	19.257	9.573
(2.621.000)	Call auf USD/CHF-Devisenkurs Ausübungskurs 0,95 Läuft am 23. Nov. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	(28.624)	(2.571)	26.053
1.502.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,21 Läuft am 16. Feb. 2024 ab	J.P. Morgan	USD	28.163	24.700	(3.463)
753.000	Call auf USD/CNH-Devisenkurs Ausübungskurs 7,45 Läuft am 21. Feb. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	5.182	4.056	(1.126)
(1.058.000)	Call auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 3.993,00 Läuft am 23. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(18.537)	(35.290)	(16.753)
(1.061.000)	Call auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4.030,00 Läuft am 12. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(19.319)	(23.003)	(3.684)
675.000	Call auf USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 21,88 Läuft am 06. Okt. 2023 ab	Barclays Bank	USD	10.976	34.977	24.001
1.781.000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 361,05 Läuft am 19. Okt. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	25.112	46.486	21.374
1.052.000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 362,30 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Bank of America	USD	15.272	24.454	9.182
1.046.000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 364,15 Läuft am 06. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	17.333	15.169	(2.164)
1.777.000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 364,70 Läuft am 23. Okt. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	26.077	36.951	10.874
867.000	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 386,45 Läuft am 06. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	11.655	5.279	(6.376)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(1.518.000)	Call auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 397,40 Läuft am 22. Dez. 2023 ab	Bank of America	USD	(17.657)	(14.330)	3.327
626.000	Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 15.225,00 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	Citi Bank	USD	9.240	11.255	2.015
629.000	Call auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 15.382,00 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	7.907	9.348	1.441
(1.513.000)	Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,63 Läuft am 05. Feb. 2024 ab	Bank of America	USD	(43.181)	(72.877)	(29.696)
1.036.000	Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,83 Läuft am 31. Okt. 2023 ab	Bank of America	USD	12.309	9.383	(2.926)
(3.027.000)	Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,83 Läuft am 07. Dez. 2023 ab	Citi Bank	USD	(62.977)	(42.917)	20.060
(1.518.000)	Call auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 4,00 Läuft am 27. Mrz. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	(15.217)	(15.289)	(72)
626.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,01 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	UBS	USD	5.471	3.662	(1.809)
629.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,34 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	4.866	4.737	(129)
2.993.000	Call auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,74 Läuft am 06. Mrz. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	36.627	34.276	(2.351)
686.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 142,11 Läuft am 13. Nov. 2023 ab	Barclays Bank	USD	12.883	30.606	17.723
3.390.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 145,00 Läuft am 22. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	36.493	91.817	55.324
709.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 145,67 Läuft am 11. Okt. 2023 ab	UBS	USD	7.912	17.389	9.477
697.000	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 145,95 Läuft am 21. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	12.667	16.142	3.475
(1.052.000)	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 147,00 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Standard Chartered Bank	USD	(10.871)	(17.618)	(6.747)
(1.036.000)	Call auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 148,50 Läuft am 31. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(11.288)	(11.500)	(212)
3.146.000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 17,44 Läuft am 15. Jan. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	100.288	107.303	7.015
(1.046.000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 17,63 Läuft am 06. Okt. 2023 ab	HSBC	USD	(16.745)	(3.820)	12.925
(2.069.000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,01 Läuft am 25. Okt. 2023 ab	Bank of America	USD	(12.718)	(10.845)	1.873
(2.173.000)	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,11 Läuft am 05. Okt. 2023 ab	Bank of America	USD	(18.699)	(1.083)	17.616
1.044.000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 18,23 Läuft am 14. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	10.983	12.905	1.922
1.518.000	Call auf USD/MXN-Devisenkurs Ausübungskurs 19,29 Läuft am 25. Mrz. 2024 ab	Bank of America	USD	20.961	22.007	1.046

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Wahrung	Premie bezahlt/ (erhalten)	Markt-wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1.061.000	Call auf USD/NOK-Devisenkurs Ausungskurs 10,68 Luft am 12. Okt. 2023 ab	HSBC	USD	14.615	9.187	(5.428)
1.058.000	Call auf USD/NOK-Devisenkurs Ausungskurs 10,77 Luft am 23. Okt. 2023 ab	Barclays Bank	USD	13.627	8.491	(5.136)
(2.833.000)	Call auf USD/NOK-Devisenkurs Ausungskurs 11,25 Luft am 10. Jan. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	(55.045)	(23.862)	31.183
618.000	Call auf USD/PHP-Devisenkurs Ausungskurs 56,72 Luft am 04. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	8.053	7.955	(98)
626.000	Call auf USD/SGD-Devisenkurs Ausungskurs 1,34 Luft am 03. Nov. 2023 ab	Citi Bank	USD	5.974	12.944	6.970
629.000	Call auf USD/SGD-Devisenkurs Ausungskurs 1,36 Luft am 15. Dez. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	5.838	6.580	742
(1.502.000)	Call auf USD/THB-Devisenkurs Ausungskurs 36,50 Luft am 22. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(25.411)	(21.099)	4.312
908.000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausungskurs 18,71 Luft am 25. Okt. 2023 ab	UBS	USD	11.386	20.345	8.959
871.000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausungskurs 20,23 Luft am 21. Dez. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	10.403	8.802	(1.601)
1.518.000	Call auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausungskurs 20,41 Luft am 22. Dez. 2023 ab	Citi Bank	USD	18.596	13.410	(5.186)
430	Call auf Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd. Ausungskurs 320,65 Luft am 29. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	346	313	(33)
(430)	Call auf Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd. Ausungskurs 349,80 Luft am 29. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	(133)	(117)	16
348	Call auf JD.com, Inc. Ausungskurs 37,50 Luft am 15. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	66.241	13.746	(52.495)
(348)	Call auf JD.com, Inc. Ausungskurs 42,50 Luft am 15. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(28.609)	(5.220)	23.389
782	Call auf JD.com, Inc. Ausungskurs 145,86 Luft am 28. Dez. 2023 ab	J.P. Morgan	HKD	758	217	(541)
(782)	Call auf JD.com, Inc. Ausungskurs 165,75 Luft am 28. Dez. 2023 ab	J.P. Morgan	HKD	(338)	(91)	247
1.470	Call auf JD.com, Inc. Ausungskurs 165,88 Luft am 28. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	2.579	171	(2.408)
(1.470)	Call auf JD.com, Inc. Ausungskurs 187,52 Luft am 28. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	(1.600)	(79)	1.521
85	Call auf Kweichow Moutai Co., Ltd. Ausungskurs 1.988,82 Luft am 29. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	CNY	147	58	(89)
(85)	Call auf Kweichow Moutai Co., Ltd. Ausungskurs 2.169,62 Luft am 29. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	CNY	(4)	(2)	2
3.571	Call auf Li Ning Co., Ltd. Ausungskurs 47,01 Luft am 28. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	HKD	2.168	142	(2.026)
(3.571)	Call auf Li Ning Co., Ltd. Ausungskurs 53,73 Luft am 28. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	HKD	(1.199)	(51)	1.148

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1.922	Call auf Panasonic Holdings Corp. Ausübungskurs 1.938,20 Läuft am 08. Dez. 2023 ab	J.P. Morgan	JPY	444	192	(252)
4.700	Call auf Ping An Insurance Group Co. of China, Ltd. Ausübungskurs 54,89 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	1.617	343	(1.274)
(4.700)	Call auf Ping An Insurance Group Co. of China, Ltd. Ausübungskurs 62,38 Läuft am 28. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	(713)	(100)	613
2.700	Call auf Shanghai International Airport Co., Ltd. Ausübungskurs 50,90 Läuft am 30. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	CNY	411	5	(406)
(2.700)	Call auf Shanghai International Airport Co., Ltd. Ausübungskurs 57,84 Läuft am 30. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	CNY	(77)	(1)	76
540	Call auf Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd. Ausübungskurs 322,13 Läuft am 30. Okt. 2023 ab	Goldman Sachs	CNY	498	1	(497)
(540)	Call auf Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd. Ausübungskurs 381,78 Läuft am 30. Okt. 2023 ab	Goldman Sachs	CNY	(25)	-	25
460	Call auf Tencent Holdings Ltd. Ausübungskurs 332,86 Läuft am 29. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	HKD	338	359	21
(460)	Call auf Tencent Holdings Ltd. Ausübungskurs 363,12 Läuft am 29. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	HKD	(123)	(128)	(5)
1.090.000	Put auf AUD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 94,70 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	AUD	7.569	2.947	(4.622)
3.685.000	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,64 Läuft am 17. Okt. 2023 ab	Bank of America	AUD	26.829	21.972	(4.857)
3.700.000	Put auf AUD/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 0,64 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	HSBC	AUD	26.874	22.585	(4.289)
657.000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,81 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Barclays Bank	EUR	6.228	17.165	10.937
633.000	Put auf EUR/NZD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,82 Läuft am 04. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	EUR	6.500	21.041	14.541
3.366.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,05 Läuft am 31. Okt. 2023 ab	UBS	EUR	30.471	22.549	(7.922)
659.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,06 Läuft am 26. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	EUR	5.675	6.202	527
657.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,07 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Citi Bank	EUR	5.378	8.411	3.033
656.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,07 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Barclays Bank	EUR	9.629	12.436	2.807
3.228.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,08 Läuft am 04. Okt. 2023 ab	Deutsche Bank	EUR	27.355	76.583	49.228
637.000	Put auf EUR/USD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,10 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	Citi Bank	EUR	9.843	25.481	15.638
568.000	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausübungskurs 1,94 Läuft am 11. Okt. 2023 ab	Citi Bank	GBP	6.725	16.847	10.122

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Wahrung	Premie bezahlt/ (erhalten)	Markt-wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
542.000	Put auf GBP/AUD-Devisenkurs Ausungskurs 1,95 Luft am 04. Okt. 2023 ab	UBS	GBP	6.463	19.366	12.903
571.000	Put auf GBP/JPY-Devisenkurs Ausungskurs 180,48 Luft am 26. Okt. 2023 ab	Bank of America	GBP	7.080	4.995	(2.085)
1.233.000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausungskurs 1,18 Luft am 25. Mrz. 2024 ab	Bank of America	GBP	13.892	14.887	995
2.798.000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausungskurs 1,25 Luft am 10. Okt. 2023 ab	Bank of America	GBP	32.056	81.977	49.921
2.399.000	Put auf GBP/USD-Devisenkurs Ausungskurs 1,25 Luft am 12. Okt. 2023 ab	HSBC	GBP	26.432	73.947	47.515
4.020.000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausungskurs 0,59 Luft am 17. Okt. 2023 ab	UBS	NZD	27.285	9.061	(18.224)
4.040.000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausungskurs 0,59 Luft am 18. Okt. 2023 ab	Bank of America	NZD	26.902	9.257	(17.645)
1.170.000	Put auf NZD/USD-Devisenkurs Ausungskurs 0,60 Luft am 26. Okt. 2023 ab	Citi Bank	NZD	7.702	5.713	(1.989)
(764.000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausungskurs 4,78 Luft am 08. Mrz. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	(10.114)	(7.326)	2.788
(1.491.000)	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausungskurs 4,80 Verfallstermin 01. Apr. 2024	Barclays Bank	USD	(19.562)	(17.740)	1.822
1.504.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausungskurs 5,00 Luft am 07. Feb. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	55.504	31.970	(23.534)
1.507.000	Put auf USD/BRL-Devisenkurs Ausungskurs 5,02 Luft am 21. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	40.901	24.870	(16.031)
693.000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausungskurs 1,34 Luft am 07. Nov. 2023 ab	J.P. Morgan	USD	8.732	1.239	(7.493)
704.000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausungskurs 1,34 Luft am 19. Dez. 2023 ab	Bank of America	USD	7.982	4.487	(3.495)
684.000	Put auf USD/CAD-Devisenkurs Ausungskurs 1,36 Luft am 04. Okt. 2023 ab	Citi Bank	USD	4.362	2.206	(2.156)
696.000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausungskurs 0,87 Luft am 03. Nov. 2023 ab	UBS	USD	11.000	140	(10.860)
699.000	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausungskurs 0,89 Luft am 15. Dez. 2023 ab	Barclays Bank	USD	9.684	3.574	(6.110)
(3.861.000)	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausungskurs 0,92 Luft am 27. Okt. 2023 ab	Bank of America	USD	(159.178)	(48.065)	111.113
(2.621.000)	Put auf USD/CHF-Devisenkurs Ausungskurs 0,93 Luft am 23. Nov. 2023 ab	Goldman Sachs	USD	(111.028)	(65.840)	45.188
753.000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausungskurs 6,99 Luft am 21. Feb. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	5.041	2.191	(2.850)
1.502.000	Put auf USD/CNH-Devisenkurs Ausungskurs 7,21 Luft am 16. Feb. 2024 ab	J.P. Morgan	USD	26.495	16.489	(10.006)
(1.058.000)	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausungskurs 3.993,00 Luft am 23. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(18.537)	(6.072)	12.465

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(1.061.000)	Put auf USD/COP-Devisenkurs Ausübungskurs 4.030,00 Läuft am 12. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(19.319)	(6.175)	13.144
675.000	Put auf USD/CZK-Devisenkurs Ausübungskurs 21,88 Läuft am 06. Okt. 2023 ab	Barclays Bank	USD	10.976	1	(10.975)
1.518.000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 361,95 Läuft am 22. Dez. 2023 ab	Bank of America	USD	13.425	18.687	5.262
1.052.000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 362,30 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Bank of America	USD	15.272	4.508	(10.764)
1.046.000	Put auf USD/HUF-Devisenkurs Ausübungskurs 364,15 Läuft am 06. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	17.333	2.473	(14.860)
626.000	Put auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 15.225,00 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	Citi Bank	USD	9.240	1.116	(8.124)
629.000	Put auf USD/IDR-Devisenkurs Ausübungskurs 15.382,00 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	7.907	5.182	(2.725)
(1.513.000)	Put auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,63 Läuft am 05. Feb. 2024 ab	Bank of America	USD	(39.338)	(11.569)	27.769
(1.518.000)	Put auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,63 Läuft am 27. Mrz. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	(14.741)	(15.829)	(1.088)
1.036.000	Put auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,83 Läuft am 31. Okt. 2023 ab	Bank of America	USD	12.309	15.411	3.102
(3.027.000)	Put auf USD/ILS-Devisenkurs Ausübungskurs 3,83 Läuft am 07. Dez. 2023 ab	Citi Bank	USD	(58.316)	(63.900)	(5.584)
1.616.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 81,34 Läuft am 06. Dez. 2023 ab	Bank of America	USD	6.459	995	(5.464)
626.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,01 Läuft am 03. Nov. 2023 ab	UBS	USD	5.472	1.863	(3.609)
629.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,34 Läuft am 15. Dez. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	4.866	4.104	(762)
2.993.000	Put auf USD/INR-Devisenkurs Ausübungskurs 83,74 Läuft am 06. Mrz. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	36.627	30.780	(5.847)
785.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 115,00 Läuft am 06. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	53.773	-	(53.773)
3.058.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 137,00 Läuft am 18. Mrz. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	31.161	23.828	(7.333)
686.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 142,11 Läuft am 13. Nov. 2023 ab	Barclays Bank	USD	12.876	1.485	(11.391)
709.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 145,67 Läuft am 11. Okt. 2023 ab	UBS	USD	7.912	470	(7.442)
697.000	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 145,95 Läuft am 21. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	12.667	8.949	(3.718)
(1.052.000)	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 147,00 Läuft am 18. Okt. 2023 ab	Standard Chartered Bank	USD	(10.871)	(3.043)	7.828
(1.036.000)	Put auf USD/JPY-Devisenkurs Ausübungskurs 148,50 Läuft am 31. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(11.288)	(9.697)	1.591

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Wahrung	Premie bezahlt/ (erhalten)	Markt-wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1.518.000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausbungskurs 17,10 Lauft am 25. Mrz. 2024 ab	Bank of America	USD	19.915	18.359	(1.556)
3.146.000	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausbungskurs 17,44 Lauft am 15. Jan. 2024 ab	Deutsche Bank	USD	91.026	54.384	(36.642)
(1.046.000)	Put auf USD/MXN-Devisenkurs Ausbungskurs 17,63 Lauft am 06. Okt. 2023 ab	HSBC	USD	(16.745)	(14.845)	1.900
(2.833.000)	Put auf USD/NOK-Devisenkurs Ausbungskurs 9,70 Lauft am 10. Jan. 2024 ab	Goldman Sachs	USD	(55.045)	(4.686)	50.359
1.061.000	Put auf USD/NOK-Devisenkurs Ausbungskurs 10,68 Lauft am 12. Okt. 2023 ab	HSBC	USD	14.615	8.706	(5.909)
1.058.000	Put auf USD/NOK-Devisenkurs Ausbungskurs 10,77 Lauft am 23. Okt. 2023 ab	Barclays Bank	USD	13.627	17.198	3.571
618.000	Put auf USD/PHP-Devisenkurs Ausbungskurs 56,72 Lauft am 04. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	8.053	5.265	(2.788)
626.000	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausbungskurs 1,34 Lauft am 03. Nov. 2023 ab	Citi Bank	USD	5.974	328	(5.646)
629.000	Put auf USD/SGD-Devisenkurs Ausbungskurs 1,36 Lauft am 15. Dez. 2023 ab	Deutsche Bank	USD	5.838	4.111	(1.727)
(1.502.000)	Put auf USD/THB-Devisenkurs Ausbungskurs 36,50 Lauft am 22. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(24.598)	(29.325)	(4.727)
(1.518.000)	Put auf USD/ZAR-Devisenkurs Ausbungskurs 18,45 Lauft am 22. Dez. 2023 ab	Citi Bank	USD	(15.218)	(20.457)	(5.239)
(348)	Put auf JD.com, Inc. Ausbungskurs 27,50 Lauft am 15. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(19.700)	(48.546)	(28.846)
(1.470)	Put auf JD.com, Inc. Ausbungskurs 100,97 Lauft am 28. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	(723)	(623)	100
(782)	Put auf JD.com, Inc. Ausbungskurs 106,08 Lauft am 28. Dez. 2023 ab	J.P. Morgan	HKD	(218)	(478)	(260)
(3.571)	Put auf Li Ning Co., Ltd. Ausbungskurs 38,06 Lauft am 28. Dez. 2023 ab	Goldman Sachs	HKD	(968)	(2.757)	(1.789)
296.000	Put auf MUFG Bank Ltd. Ausbungskurs 1.253,83 Lauft am 13. Okt. 2023 ab	J.P. Morgan	JPY	48.324	41.682	(6.642)
(9)	Put auf NASDAQ-100 Reduced Value Index Ausbungskurs 2.620,00 Lauft am 20. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	(14.235)	(2.880)	11.355
75	Put auf NASDAQ-100 Reduced Value Index Ausbungskurs 2.805,00 Lauft am 20. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	158.803	105.000	(53.803)
8	Put auf NASDAQ-100 Reduced Value Index Ausbungskurs 2.870,00 Lauft am 20. Okt. 2023 ab	Morgan Stanley	USD	26.003	21.840	(4.163)
(4.700)	Put auf Ping An Insurance Group Co. of China, Ltd. Ausbungskurs 39,92 Lauft am 28. Dez. 2023 ab	Morgan Stanley	HKD	(470)	(649)	(179)
(2.700)	Put auf Shanghai International Airport Co., Ltd. Ausbungskurs 39,33 Lauft am 30. Nov. 2023 ab	Morgan Stanley	CNY	(129)	(1.313)	(1.184)
				USD	1.476.603	275.180

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

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 2023 waren die folgenden Teilfonds in offenen Swaptions auf Finanzindizes und international notierte Aktien engagiert:

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa								
Kauf	IRS "Zahlt Festzinssatz 7,69 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2026", Put 7,69 %, 13. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	384.124	157.510.000	412.995	28.872	
Kauf	IRS "Zahlt Festzinssatz 8,50 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028", Put 8,50 %, 06. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	65.824	(30.101)	
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 6,80 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Feb 2025", Call 6,80 %, 04. Feb. 2030	J.P. Morgan	MXN	541.676	228.495.000	13.958	(527.718)	
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 7,06 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Jun 2024", Call 7,06 %, 26. Jun. 2024	J.P. Morgan	MXN	195.967	188.310.000	3.268	(192.699)	
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 7,29 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2026", Call 7,29 %, 05. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	396.524	157.510.000	46.095	(350.429)	
Kauf	SWP "Erhält Festzinssatz 7,95 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2024", Call 7,95 %, 13. Mrz. 2024	J.P. Morgan	MXN	210.150	332.045.000	3.648	(206.502)	
Kauf	SWP "Erhält Festzinssatz 8,05 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Jul 2028", Call 8,05 %, 06. Apr. 2028"	J.P. Morgan	MXN	73.126	17.150.000	20.247	(52.879)	
Verkauf	SWP "Erhält Festzinssatz 7,20 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2024", Call 7,20 %, 13. Mrz. 2024	J.P. Morgan	MXN	(61.294)	332.045.000	(675)	60.619	
						USD	565.360	(1.270.837)

Total Return Swapkontrakte

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

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

Zum 30. September 2023 waren folgende Teilfonds in Total Return Swapkontrakten engagiert:

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity						
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	GBP	3.580.246	21. Aug. 2024	847.342
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	18.163.655	28. Feb. 2025	3.286.569
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	EUR	16.970.926	21. Mrz. 2024	1.038.568
Kauf Long	Bekleidung	Morgan Stanley	EUR	4.520.431	28. Feb. 2025	49.485

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)						
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	GBP	16.464.919	28. Feb. 2025	895.114
Kauf Long	Baustoffe	J.P. Morgan	GBP	5.055.136	11. Okt. 2024	225.287
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	GBP	3.329.284	15. Mai 2025	5.556
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	GBP	11.029.469	07. Aug. 2024	(2.295.308)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	CHF	8.432.807	18. Jun. 2024	(1.133.622)
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	USD	1.480.293	18. Okt. 2024	85.008
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	714.179	30. Apr. 2024	(68.975)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	373.475	28. Feb. 2025	(91.400)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	894.229	28. Apr. 2026	139.898
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1.385.657	03. Jun. 2024	387.490
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	831.111	28. Feb. 2025	(73)
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	SEK	1.063.280	12. Aug. 2026	215.746
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.100.753	24. Jul. 2024	505.768
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	925.421	26. Aug. 2025	(93.913)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	1.952.489	05. Jun. 2024	(69.596)
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Merrill Lynch	USD	1.816.316	30. Aug. 2024	11.118
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.056.598	27. Mrz. 2024	97.013
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley	USD	1.587.109	28. Feb. 2025	274.895
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	1.628.982	28. Feb. 2025	179.691
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	726.459	04. Sep. 2024	252.354
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Merrill Lynch	USD	524.470	28. Jun. 2024	43.613
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	3.110.384	16. Jan. 2024	372.634
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	623.834	31. Okt. 2024	41.856
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Morgan Stanley	HKD	1.210.958	26. Feb. 2025	82.461
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Morgan Stanley	USD	1.596.880	28. Feb. 2025	126.126
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	1.153.630	28. Apr. 2026	123.213
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	1.106.755	18. Sep. 2025	242.049
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	1.012.113	28. Okt. 2024	18.775
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	1.041.105	31. Okt. 2024	41.547
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	796.119	26. Aug. 2024	(22.563)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	415.995	28. Feb. 2025	13.708
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	J.P. Morgan	USD	781.890	22. Jul. 2024	(112.065)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	1.999.302	28. Feb. 2025	(21.358)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Merrill Lynch	USD	784.617	28. Jun. 2024	(77.555)
Verkauf Short	Haushaltswaren	Morgan Stanley	USD	2.298.715	28. Feb. 2025	282.408
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	USD	653.625	27. Feb. 2025	(22.974)
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	787.446	20. Mai 2024	(105.063)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	793.983	31. Okt. 2024	20.253
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	1.610.299	28. Feb. 2025	(123.187)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	1.447.675	28. Feb. 2025	403
Verkauf Short	Freizeit	Merrill Lynch	USD	824.720	31. Okt. 2024	(35.607)
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	Merrill Lynch	USD	607.420	31. Jul. 2024	117.945
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	SEK	1.114.591	09. Jul. 2025	149.912
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	USD	980.241	06. Mai 2024	85.741
Verkauf Short	Medien	J.P. Morgan	USD	845.169	07. Okt. 2024	63.890
Verkauf Short	Medien	Merrill Lynch	USD	2.416.312	30. Aug. 2024	144.629
Verkauf Short	Büro- und Geschäftsausstattung	Morgan Stanley	JPY	1.671.255	28. Feb. 2025	136.339
Verkauf Short	Verpackung und Behälter	J.P. Morgan	USD	1.930.976	28. Okt. 2024	412.063
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	941.150	23. Feb. 2024	(212.679)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1.641.677	28. Feb. 2025	158.867

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wahrung	Nennbetrag	Falligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)							
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	1.455.499	28. Feb. 2025	756.475	
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	CAD	1.806.593	21. Nov. 2023	146.153	
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	1.646.978	29. Dez. 2023	419.986	
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	1.968.970	30. Sep. 2024	182.368	
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	622.166	31. Okt. 2024	13.889	
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	1.467.716	21. Okt. 2024	39.422	
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	832.532	31. Okt. 2024	49.118	
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	767.168	31. Okt. 2023	(162.339)	
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	2.486.409	31. Okt. 2024	(189.995)	
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	SEK	406.152	09. Sep. 2025	96.466	
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	USD	1.013.480	07. Nov. 2023	95.536	
Verkauf Short	Diverse*	Morgan Stanley	EUR	1.674.841	28. Feb. 2025	201.198	
Verkauf Short	Diverse*	Morgan Stanley	USD	33.559.382	28. Feb. 2025	662.671	
						EUR	9.000.344
Schroder GAIA Helix							
Kauf Long	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	1.705.056	09. Sep. 2024	(56.626)	
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	EUR	27.839.157	09. Sep. 2024	(91.545)	
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	USD	49.994.326	09. Sep. 2024	250.823	
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	JPY	10.682.042	09. Sep. 2024	67.577	
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	125.564.520	09. Sep. 2024	3.540.794	
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	JPY	32.536.371	09. Sep. 2024	1.146.489	
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	137.107.622	09. Sep. 2024	3.296.118	
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	JPY	60.623.502	09. Sep. 2024	843.383	
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	6.334.962	09. Sep. 2024	90.723	
						USD	9.087.736
Schroder GAIA Sirios US Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	2.737.449	13. Dez. 2023	(174.472)	
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	3.041.688	25. Mrz. 2024	(124.474)	
Kauf Long	Getranke	Merrill Lynch	USD	2.869.042	21. Nov. 2023	(562.786)	
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	12.818.418	25. Mrz. 2024	(359.696)	
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	2.700.458	24. Mai 2024	(111.417)	
Kauf Long	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	2.769.888	24. Jul. 2024	(165.308)	
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	USD	819.288	28. Jun. 2024	(39.556)	
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	880.141	07. Okt. 2024	35.639	
Verkauf Short	Fluggesellschaften	Merrill Lynch	USD	1.017.651	15. Okt. 2024	83.836	
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	109.308	12. Jun. 2024	83.920	
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	808.045	25. Mrz. 2024	99.560	
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	929.527	15. Apr. 2024	62.015	
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	19.732	03. Jun. 2024	10.261	
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	11.873	28. Jun. 2024	6.174	
Verkauf Short	Baustoffe	Merrill Lynch	USD	96.571	24. Nov. 2023	(4.528)	
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	580.244	12. Jun. 2024	333.682	
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	4.040.674	25. Mrz. 2024	181.504	
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	276.827	01. Jul. 2024	71.307	
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1.723.514	28. Okt. 2024	(10.059)	
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	357.137	14. Nov. 2023	(403)	
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	167.872	12. Sep. 2024	4.444	
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	384.641	22. Apr. 2024	17.274	
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	476.543	29. Apr. 2024	21.128	

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wahrung	Nennbetrag	Falligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)						
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	832.247	28 Mai 2024	(23.406)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	883.362	11. Okt. 2024	24.775
Verkauf Short	Vertrieb/Grohandel	Merrill Lynch	USD	265.319	24. Sep. 2024	(24.014)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	328.807	14. Nov. 2023	32.766
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	788.218	12. Jun. 2024	61.469
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1.771.922	24. Jun. 2024	53.652
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	401.445	15. Jul. 2024	6.427
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	1.381.443	12. Sep. 2024	(149.088)
Verkauf Short	Umweltschutz	Goldman Sachs	USD	796.650	13. Dez. 2023	380.910
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	1.818.178	14. Nov. 2023	195.388
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	3.042.375	13. Dez. 2023	163.374
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	17.333.575	12. Jun. 2024	898.071
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	5.157.084	12. Dez. 2024	(56.585)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	3.809.642	26. Mrz. 2024	276.970
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	8.200	24. Nov. 2023	2.629
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	337.331	24. Sep. 2024	12.625
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	72.064	30. Okt. 2023	4.699
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	495.855	14 Mai 2024	13.282
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	559.598	11. Dez. 2023	15.300
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	662.370	10. Apr. 2024	12.167
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	252.918	24. Jun. 2024	5.090
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	369.678	24. Jul. 2024	80.783
Verkauf Short	Internet	Barclays Bank	USD	1.718.925	03. Nov. 2023	33.568
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	840.360	10. Nov. 2023	(3.421)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	755.728	24. Nov. 2023	136.125
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	242.629	13 Mai 2024	24.555
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	399.236	26. Jul. 2024	(20.012)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	1.118.553	24. Sep. 2024	148.434
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	26.360	29. Okt. 2024	(158)
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Barclays Bank	USD	1.887.690	03. Nov. 2023	20.881
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	USD	878.797	12. Dez. 2024	107.513
Verkauf Short	Medien	Merrill Lynch	USD	881.366	14 Mai 2024	17.534
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	313.846	24. Nov. 2023	23.869
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	176.057	24. Sep. 2024	9.309
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	805.948	24. Okt. 2023	91.806
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	557.829	26. Dez. 2023	23.432
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	364.274	18. Sep. 2024	59.120
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	565.758	12. Jun. 2024	35.721
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	272.840	12. Sep. 2024	10.738
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	1.120.610	25. Mrz. 2024	5.042
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	663.079	01. Jul. 2024	(888)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	257.285	18. Sep. 2024	(24.354)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	295.373	05. Feb. 2024	12.501
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	86.070	01. Jul. 2024	7.563
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	327.285	24. Sep. 2024	13.972
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	703.260	18. Okt. 2024	2.148
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	USD	753.976	16 Mai 2024	22.993
USD						2.203.320

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wahrung	Nennbetrag	Falligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified						
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	324.114.122	23. Okt. 2023	4.846.767
						USD
						4.846.767
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
Kauf Long	Werbung	Goldman Sachs	EUR	37.312	24. Mai 2033	(134)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	8.532	24. Mai 2033	(469)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	158.237	18. Mai 2033	(9.986)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	GBP	46.080	24. Mai 2033	(518)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	GBP	1.575.196	18. Mai 2033	(71.818)
Kauf Long	Automobilhersteller	Goldman Sachs	HKD	140.458	24. Mai 2033	(1.378)
Kauf Long	Automobilhersteller	Goldman Sachs	JPY	338.610	24. Mai 2033	(13.418)
Kauf Long	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	104.773	24. Mai 2033	(4.936)
Kauf Long	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	280.268	18. Mai 2033	952
Kauf Long	Autoteile und -zubehor	Goldman Sachs	USD	410.469	25. Mai 2033	(14.057)
Kauf Long	Autoteile und -zubehor	J.P. Morgan	USD	17.495	22. Sep. 2025	(2.483)
Kauf Long	Autoteile und -zubehor	Morgan Stanley	USD	66.755	19. Mai 2033	(1.703)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	75.518	24. Mai 2033	(3.325)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	JPY	2.423.121	24. Mai 2033	(97.662)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	5.332.747	24. Mai 2033	(137.537)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	CAD	1.015.003	05. Mai 2028	(27.785)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	682.252	05. Mai 2028	(2.800)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	GBP	905.563	05. Mai 2028	51.852
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	17.319	20. Dez. 2024	717
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	111.031	20. Aug. 2025	10.868
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	390.966	08. Mai 2028	8.584
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	CAD	1.738.894	18. Mai 2033	(75.427)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	EUR	1.589.597	18. Mai 2033	(17.953)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	HUF	372.515	18. Mai 2033	(34.599)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	JPY	504.306	18. Mai 2033	(19.801)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	8.399.923	18. Mai 2033	(347.903)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	298.228	24. Mai 2033	(12.638)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	134.976	24. Mai 2033	4.137
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	1.962.706	24. Mai 2033	(49.684)
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	262.835	05. Mai 2028	(24.977)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	245.673	18. Mai 2033	(14.584)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	4.871.262	18. Mai 2033	(85.644)
Kauf Long	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	279.445	24. Mai 2033	(5.691)
Kauf Long	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	226.397	18. Mai 2033	(1.410)
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	EUR	402.928	24. Mai 2033	(6.947)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	110.642	24. Mai 2033	(2.481)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	223.589	18. Mai 2033	(56.872)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	977.511	18. Mai 2033	(132.252)
Kauf Long	Commodity Fund	Morgan Stanley	USD	875.583	18. Mai 2033	(14.505)
Kauf Long	Computer	Goldman Sachs	JPY	81.841	24. Mai 2033	(717)
Kauf Long	Vertrieb/Grohandel	Goldman Sachs	JPY	126.298	24. Mai 2033	(8.340)
Kauf Long	Vertrieb/Grohandel	Goldman Sachs	USD	242.248	24. Mai 2033	(5.951)
Kauf Long	Vertrieb/Grohandel	Morgan Stanley	USD	389.880	18. Mai 2033	(1.962)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	525.692	24. Mai 2033	(7.623)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	383.561	05. Mai 2028	(4.142)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	ILS	278.788	05. Mai 2028	29.099
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.769.250	18. Mai 2033	(55.415)
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	EUR	65.413	24. Mai 2033	592
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	HKD	253.520	08. Apr. 2024	13.286
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	USD	2.404.476	24. Mai 2033	(167.546)
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	EUR	36.096	05. Mai 2028	(122)
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	GBP	75.022	22. Mai 2024	(1.494)
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	HKD	204.230	05. Mai 2028	7.738
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	USD	613.503	05. Mai 2028	(6.125)
Kauf Long	Elektrik	Morgan Stanley	USD	279.488	18. Mai 2033	(18.878)
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	165.669	05. Feb. 2025	(639)
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley	USD	426.149	18. Mai 2033	(10.648)
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	183.776	24. Mai 2033	(1.062)
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	USD	499.632	22. Jul. 2025	(14.474)
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	USD	442.982	05. Mai 2028	(25.781)
Kauf Long	Elektronik	Morgan Stanley	USD	246.436	18. Mai 2033	(5.935)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	JPY	60.497	24. Mai 2033	(1.048)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	530.956	18. Mai 2033	4.717
Kauf Long	Umweltschutz	Morgan Stanley	USD	264.107	18. Mai 2033	(13.638)
Kauf Long	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	679.552	24. Mai 2033	561
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	1.861.665	18. Mai 2033	(3.464)
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	2.009.096	18. Mai 2033	(15.211)
Kauf Long	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	198.084	18. Mai 2033	9.710
Kauf Long	Gas	Goldman Sachs	HKD	663.753	24. Mai 2033	8.240
Kauf Long	Gas	Goldman Sachs	USD	570.367	24. Mai 2033	(58.845)
Kauf Long	Gas	J.P. Morgan	HKD	382.174	05. Mai 2028	32.390
Kauf Long	Gas	Morgan Stanley	USD	251.722	18. Mai 2033	(14.018)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	CHF	62.150	24. Mai 2033	(1.319)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	HKD	2.663	24. Mai 2033	11
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	1.684.745	24. Mai 2033	(27.270)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	91.337	25. Mai 2033	2.439
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	13.008	24. Jun. 2024	(860)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	2.655.151	05. Mai 2028	(99.981)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	CHF	123.927	18. Mai 2033	(5.191)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	HKD	92.313	18. Mai 2033	(383)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	309.035	18. Mai 2033	(10.333)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.585.059	24. Mai 2033	(3.445)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	324.606	26. Aug. 2024	(15.562)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.071.432	05. Mai 2028	(4.963)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	877.763	18. Mai 2033	6.617
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	864.229	24. Mai 2033	(30.654)
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	526.292	18. Mai 2033	(22.720)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	JPY	521.602	24. Mai 2033	(26.694)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	J.P. Morgan	JPY	177.410	08. Mai 2028	(6.802)
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	22.879	18. Mai 2033	(1.269)
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	EUR	2.323.849	05. Mai 2028	20.542
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	GBP	1.112.532	05. Mai 2028	(1.518)
Kauf Long	Versicherung	J.P. Morgan	USD	70.734	05. Mai 2028	(3.296)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Kauf Long	Versicherung	Morgan Stanley	EUR	415.858	18. Mai 2033	(10.816)
Kauf Long	Versicherung	Morgan Stanley	JPY	396.433	18. Mai 2033	(8.886)
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	USD	499.263	24. Mai 2033	(23.488)
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	USD	389.709	05. Mai 2028	(16.955)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	EUR	536.641	18. Mai 2033	17.057
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	HKD	462.777	18. Mai 2033	(3.483)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	941.315	24. Jun. 2025	(88.974)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	2.460.473	18. Mai 2033	(69.971)
Kauf Long	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	USD	324.103	18. Mai 2033	16.937
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	GBP	408.736	05. Jun. 2024	21.821
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	253.468	24. Mai 2033	(15.719)
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	USD	189.994	05. Mai 2028	(3.117)
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	GBP	510.516	18. Mai 2033	4.875
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	JPY	160.786	18. Mai 2033	(8.801)
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	186.072	18. Mai 2033	(3.157)
Kauf Long	Medien	Morgan Stanley	USD	52.599	18. Mai 2033	(3.631)
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	GBP	95.098	24. Mai 2033	1.221
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	SEK	228.514	24. Mai 2033	672
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	GBP	188.669	05. Mai 2028	14.383
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	CAD	52.285	18. Mai 2033	(3.156)
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	386.979	08. Mai 2028	(71.136)
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	287.979	18. Mai 2033	(2.760)
Kauf Long	Öl und Gas	Goldman Sachs	GBP	724.474	01. Mai 2024	3.189
Kauf Long	Öl und Gas	Goldman Sachs	HKD	295.589	24. Mai 2033	(437)
Kauf Long	Öl und Gas	Goldman Sachs	JPY	155.537	24. Mai 2033	(711)
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	EUR	195.250	05. Mai 2028	(20.847)
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	GBP	667.700	21. Feb. 2024	36.192
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	12.604.156	05. Mai 2028	(484.055)
Kauf Long	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	4.590.709	18. Mai 2033	(103.155)
Kauf Long	Öl- und Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	133.861	05. Mai 2028	(5.718)
Kauf Long	Öl- und Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	NOK	516.728	19. Mai 2033	(34.709)
Kauf Long	Öl- und Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	191.702	18. Mai 2033	(7.882)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	384.873	24. Mai 2033	4.005
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	520.796	05. Apr. 2024	(38.932)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	354.001	24. Mai 2033	(29.983)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	383.492	05. Apr. 2024	(10.523)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	268.413	24. Mai 2033	3.700
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	1.169.406	24. Mai 2033	(6.663)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	2.113.601	24. Mai 2033	(50.799)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	168.492	05. Mai 2028	11.385
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	163.995	20. Okt. 2023	5.461
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	14.353	08. Mai 2028	(442)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1.319.438	05. Mai 2028	(55.916)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	181.595	18. Mai 2033	(14.373)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	GBP	151.148	18. Mai 2033	2.206
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	18.773	18. Mai 2033	(519)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1.697.482	18. Mai 2033	(185.491)
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	962.349	05. Mai 2028	11.591

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wahrung	Nennbetrag	Falligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	485.914	18. Mai 2033	4.340
Kauf Long	Private Equity	Goldman Sachs	USD	467.459	24. Mai 2033	(14.913)
Kauf Long	Private Equity	J.P. Morgan	USD	303.075	05. Mai 2028	(12.138)
Kauf Long	Immobilien	Goldman Sachs	EUR	182.339	24. Mai 2033	(13.805)
Kauf Long	Immobilien	J.P. Morgan	EUR	158.149	05. Mai 2028	(2.029)
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	EUR	322.822	24. Mai 2033	(16.093)
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	USD	376.732	24. Mai 2033	(14.905)
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	USD	603.911	05. Mai 2028	(10.748)
Kauf Long	REITS	Morgan Stanley	EUR	185.281	18. Mai 2033	(2.493)
Kauf Long	REITS	Morgan Stanley	USD	867.882	18. Mai 2033	(28.712)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	157.393	24. Mai 2033	(12.259)
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	948.275	18. Mai 2033	(10.418)
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	308.184	24. Mai 2033	(6.679)
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	239.386	05. Mai 2028	(7.564)
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	207.155	18. Mai 2033	(1.469)
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	872.845	24. Mai 2033	(8.838)
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	396.822	05. Mai 2028	(10.282)
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	152.430	19. Mai 2025	(5.423)
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	1.056.869	18. Mai 2033	(35.675)
Kauf Long	Telekommunikation	Goldman Sachs	GBP	242.722	24. Mai 2033	(12.494)
Kauf Long	Telekommunikation	J.P. Morgan	GBP	523.778	05. Mai 2028	(8.642)
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	EUR	660.921	18. Mai 2033	(4.364)
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	USD	447.449	18. Mai 2033	(21.794)
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	26.954.867	25. Mai 2033	100.126
Kauf Long	Wasser	Morgan Stanley	USD	561.712	18. Mai 2033	(60.943)
Verkauf Short	Werbung	Goldman Sachs	USD	119.311	06. Mai 2025	590
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	180.872	24. Mai 2033	5.868
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	477.238	05. Mai 2028	20.261
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	USD	372.433	18. Mai 2033	(4.708)
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	GBP	52.914	05. Apr. 2024	3.411
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	USD	330.448	05. Mai 2028	(7.845)
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	GBP	291.507	18. Mai 2033	29.962
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	EUR	753.547	05. Apr. 2024	28.779
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	1.102.004	24. Mai 2033	16.008
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	EUR	1.830.979	05. Mai 2028	(51.410)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	262.801	18. Mai 2033	(4.419)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	JPY	243.654	18. Mai 2033	11.473
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	939.132	18. Mai 2033	21.725
Verkauf Short	Autoteile und -zubehor	Goldman Sachs	USD	285.448	24. Mai 2033	5.443
Verkauf Short	Autoteile und -zubehor	Morgan Stanley	USD	364.775	18. Mai 2033	2.725
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	1.752.337	24. Mai 2033	(2.670)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	GBP	466.722	11. Jan. 2024	10.943
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	GBP	895.331	24. Mai 2033	(14.212)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	JPY	1.496.345	24. Mai 2033	62.123
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	PLN	499.987	24. Mai 2033	12.662
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SEK	1.046.649	24. Mai 2033	9.400
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	4.995.039	24. Mai 2033	48.861
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	AUD	225.164	22. Jul. 2024	4.998

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	CZK	368.006	05. Mai 2028	14.981
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	DKK	314.946	05. Mai 2028	(16.222)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	1.174.878	05. Mai 2028	(47.363)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	GBP	463.424	05. Mai 2028	(17.610)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	JPY	9.996	08. Mai 2028	(346)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	PLN	5.121	05. Mai 2028	330
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	1.291.457	22. Mai 2024	(48.673)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	760.796	05. Mai 2028	(23.418)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	1.824.149	05. Mai 2028	96.216
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	AUD	627.699	18. Mai 2033	19.409
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CAD	4.237.123	18. Mai 2033	202.789
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CZK	80.116	18. Mai 2033	1.794
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	EUR	1.701.959	18. Mai 2033	(77.192)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	GBP	221.896	18. Mai 2033	(5.923)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	1.311.596	28. Feb. 2025	26.595
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	289.217	18. Mai 2033	5.661
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	SEK	1.931.385	18. Mai 2033	(10.167)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	SGD	4.259	18. Mai 2033	102
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	6.585.135	18. Mai 2033	157.283
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	HKD	505	24. Mai 2033	(6)
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	USD	136.309	24. Mai 2033	5.041
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	HKD	404	05. Mai 2028	31
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	HKD	7.742	18. Mai 2033	11
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	USD	63.843	18. Mai 2033	3.692
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	CHF	242.946	24. Mai 2033	71.439
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	NOK	10.144	24. Mai 2033	1.857
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	608.144	24. Mai 2033	(24.544)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	264.916	05. Mai 2028	35.587
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	HKD	294.466	18. Mai 2033	13.632
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	NOK	148.877	19. Mai 2033	18.969
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	2.388.777	18. Mai 2033	142.585
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	SEK	87.133	12. Aug. 2026	494
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	377.461	24. Mai 2033	5.857
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	1.842.334	18. Mai 2033	13.997
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	USD	7.049	24. Mai 2033	113
Verkauf Short	Chemie	Morgan Stanley	USD	1.831.953	18. Mai 2033	89.057
Verkauf Short	Kohle	J.P. Morgan	USD	211.446	05. Mai 2028	(28.465)
Verkauf Short	Kohle	Morgan Stanley	USD	47.468	18. Mai 2033	(3.914)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	126.681	12. Jun. 2024	(7.911)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	43.938	28. Mai 2025	1.674
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.226.652	24. Mai 2033	56.253
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.002.337	05. Mai 2028	63.117
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	3.168.863	18. Mai 2033	117.622
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	NOK	186.299	24. Mai 2033	2.569
Verkauf Short	Computer	J.P. Morgan	USD	137.841	05. Mai 2028	6.056
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	1.155.603	18. Mai 2033	16.109
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	EUR	128.933	24. Mai 2033	5.240
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	J.P. Morgan	EUR	70.921	05. Mai 2028	1.847

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	60.840	18. Mai 2033	2.469
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	JPY	3.086	18. Mai 2033	182
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Goldman Sachs	USD	660.330	24. Mai 2033	(6.603)
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	J.P. Morgan	USD	273.726	05. Mai 2028	9.911
Verkauf Short	Vertrieb/Großhandel	Morgan Stanley	USD	258.639	18. Mai 2033	(4.517)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	513.121	24. Mai 2033	7.068
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	439.161	04. Jan. 2024	10.386
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	151.585	11. Jan. 2024	914
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	4.534.471	24. Mai 2033	24.244
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	291.030	05. Mai 2028	(7.013)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	386.166	08. Mai 2028	18.210
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	SEK	437.442	05. Mai 2028	28.421
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	SGD	1.943	20. Jun. 2025	(22)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	369.137	05. Mai 2028	8.709
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	CHF	377.599	18. Mai 2033	8.245
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	655.445	18. Mai 2033	35.711
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	224.750	18. Mai 2033	10.818
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	SEK	38.835	18. Mai 2033	2.685
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	SGD	3.617	18. Mai 2033	65
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	7.714.075	18. Mai 2033	390.640
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	1.928.029	24. Mai 2033	117.244
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	EUR	872.657	22. Mai 2024	6.646
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	3.627.552	05. Mai 2028	75.613
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	30.068	20. Mai 2033	(559)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	CAD	428.612	18. Mai 2033	24.764
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	2.601.777	18. Mai 2033	151.141
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	EUR	52.667	24. Mai 2033	1.885
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	96.902	24. Mai 2033	2.336
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley	USD	488.612	18. Mai 2033	(824)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	EUR	227.896	24. Mai 2033	7.602
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	JPY	750.609	24. Mai 2033	27.992
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	208.125	24. Mai 2033	5.509
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	-	25. Mai 2033	-
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	CHF	171.098	05. Mai 2028	(1.146)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	JPY	440	08. Mai 2028	36
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	USD	263.781	05. Mai 2028	5.600
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	17.619	18. Mai 2033	466
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	230.145	18. Mai 2033	4.208
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	DKK	408.587	24. Mai 2033	17.196
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	EUR	64.355	24. Mai 2033	(667)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	NOK	54.560	24. Mai 2033	10.477
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	SEK	6.196	24. Mai 2033	897
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	502.773	24. Mai 2033	21.154
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	SEK	38.785	05. Mai 2028	9.382
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	508.743	05. Mai 2028	88.467
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	NOK	24.690	19. Mai 2033	5.284
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	SEK	20.058	18. Mai 2033	3.720
Verkauf Short	Energie – Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	USD	28.653	18. Mai 2033	3.094

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	447.310	24. Mai 2033	18.624
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	EUR	16.371	05. Mai 2028	723
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	122.174	18. Mai 2033	7.167
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	186.690	18. Mai 2033	6.196
Verkauf Short	Umweltschutz	Goldman Sachs	USD	377.148	24. Mai 2033	7.814
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	4.973.967	24. Mai 2033	81.426
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	7.272.683	05. Mai 2028	11.713
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	5.710.088	18. Mai 2033	101.644
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	27.363.222	18. Mai 2033	576.228
Verkauf Short	ETC-Fonds	Morgan Stanley	USD	232.108	18. Mai 2033	2.848
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	CHF	274.335	24. Mai 2033	7.556
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	EUR	7.100	05. Apr. 2024	345
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	GBP	466.047	21. Aug. 2024	119.075
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	JPY	5.103	24. Mai 2033	159
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	338.991	24. Mai 2033	14.140
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	42.805	05. Mai 2028	2.416
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	233.809	18. Mai 2033	10.551
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	HKD	4.900	18. Mai 2033	(19)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	JPY	3.240	18. Mai 2033	154
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	767.621	18. Mai 2033	21.431
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	J.P. Morgan	USD	120.399	05. Mai 2028	5.560
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	CHF	572.223	24. Mai 2033	777
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	DKK	802.498	24. Mai 2033	34.005
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	HKD	124.268	24. Mai 2033	(2.782)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	527.185	28. Apr. 2026	7.724
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	1.900.739	24. Mai 2033	58.590
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	DKK	109.932	05. Mai 2028	11.200
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	EUR	529.476	05. Mai 2028	34.474
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	HKD	8.062	05. Mai 2028	(253)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	JPY	361.263	08. Mai 2028	14.293
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	SEK	93.619	05. Mai 2028	3.506
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	3.636	05. Mai 2028	3.622
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	HKD	155.590	18. Mai 2033	(4.586)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	SEK	203.470	18. Mai 2033	2.327
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	1.040.220	18. Mai 2033	6.954
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	719.138	24. Mai 2033	37.749
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.539.197	24. Mai 2033	92.243
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	251.450	05. Mai 2028	8.878
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	63.209	05. Mai 2028	1.386
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	944.582	18. Mai 2033	814
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	725.724	24. Mai 2033	22.942
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	808.595	18. Mai 2033	18.640
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	USD	191.165	18. Mai 2033	(244)
Verkauf Short	Versicherung	Goldman Sachs	EUR	114.976	24. Mai 2033	2.153
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	CHF	1.990.275	05. Mai 2028	(61.343)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	EUR	3.009.864	05. Mai 2028	(53.979)
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	GBP	356.559	05. Mai 2028	737
Verkauf Short	Versicherung	J.P. Morgan	USD	349.548	05. Mai 2028	4.925

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	EUR	729.024	18. Mai 2033	17.167
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	JPY	362.121	18. Mai 2033	9.160
Verkauf Short	Versicherung	Morgan Stanley	USD	795.782	18. Mai 2033	663
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	EUR	86.830	05. Mai 2028	16.043
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	1.133.348	19. Mai 2025	26.887
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	249.217	18. Mai 2033	(8.981)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Goldman Sachs	JPY	5.729	24. Mai 2033	352
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Goldman Sachs	USD	220.979	24. Mai 2033	(9.330)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	J.P. Morgan	USD	264.900	05. Mai 2028	(4.115)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	AUD	4.694	18. Mai 2033	66
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	USD	280.548	18. Mai 2033	740
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	USD	223.773	05. Mai 2028	(6.354)
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	659.871	18. Mai 2033	(4.067)
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	Goldman Sachs	SEK	288.913	24. Mai 2033	10.886
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	J.P. Morgan	SEK	700	05. Mai 2028	31
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	J.P. Morgan	USD	459.173	05. Mai 2028	22.199
Verkauf Short	Maschinen – Bau und Bergbau	Morgan Stanley	USD	124.854	18. Mai 2033	6.276
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	GBP	480.023	04. Jan. 2024	12.569
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	SEK	368.879	05. Apr. 2024	128
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	USD	133.317	11. Sep. 2024	9.152
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	USD	1.139.079	05. Mai 2028	74.785
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	650.458	18. Mai 2033	22.245
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	GBP	266.751	22. Mai 2024	(71)
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	285.868	18. Mai 2033	6.098
Verkauf Short	Metallprodukte/Eisenwaren	Morgan Stanley	USD	483.165	18. Mai 2033	16.121
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	1.511.818	24. Mai 2033	27.462
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	EUR	510.523	05. Mai 2028	42.188
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	431.178	18. Mai 2033	1.986
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	AUD	299.304	24. Mai 2033	(7.786)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	EUR	459.422	24. Mai 2033	(1.521)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	GBP	183.522	24. Mai 2033	4.950
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	NOK	445.855	24. Mai 2033	14.430
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	USD	1.048.589	24. Mai 2033	2.793
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	AUD	16.765	05. Mai 2028	(43)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	CAD	998.488	05. Mai 2028	26.324
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	JPY	144.011	08. Mai 2028	(8.654)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	4.557.046	05. Mai 2028	(122.256)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	AUD	62.056	18. Mai 2033	78
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	2.335.012	18. Mai 2033	81.146
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	GBP	19.661	18. Mai 2033	1.578
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	NOK	294.707	19. Mai 2033	11.601
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	1.563.042	18. Mai 2033	11.407
Verkauf Short	Öl- und Gasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.033.241	24. Mai 2033	18.878
Verkauf Short	Öl- und Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	283.917	05. Mai 2028	(19.909)
Verkauf Short	Öl- und Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	363.055	18. Mai 2033	9.098
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	270.102	24. Mai 2033	16.005
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	673.264	24. Mai 2033	21.945
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	HKD	281.403	24. Mai 2033	(3.734)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	224.460	24. Mai 2033	17.878

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Wahrung	Nennbetrag	Falligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	348.882	24. Mai 2033	2.002
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	235.328	08. Mai 2028	4.035
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	329.382	23. Feb. 2024	45.843
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	1.125.867	18. Mai 2033	47.562
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	HKD	421.340	18. Mai 2033	(17.340)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2.896.475	18. Mai 2033	32.034
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	510.928	24. Mai 2033	10.243
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	1.976.968	05. Mai 2028	(347)
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	CAD	296.395	18. Mai 2033	14.441
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	USD	1.008.329	18. Mai 2033	29.556
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	USD	1.646.448	24. Mai 2033	51.907
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	SEK	550.944	05. Mai 2028	18.166
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	USD	478.565	05. Mai 2028	39.043
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	SEK	360.302	18. Mai 2033	(9.966)
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	USD	2.009.060	18. Mai 2033	143.214
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	EUR	263.631	24. Mai 2033	14.303
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	USD	135.820	24. Mai 2033	7.095
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	EUR	745.907	05. Mai 2028	(5.640)
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	SEK	17.456	05. Mai 2028	572
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	USD	136.269	05. Mai 2028	18.573
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	SEK	81.102	18. Mai 2033	3.021
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	USD	105.848	18. Mai 2033	8.319
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	EUR	130.285	24. Mai 2033	7.766
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	73.448	24. Mai 2033	5.365
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	EUR	385.591	05. Mai 2028	26.394
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	380.276	18. Mai 2033	33.122
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	GBP	328.047	05. Apr. 2024	2.811
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	SEK	319.688	05. Apr. 2024	9.171
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1.700.488	24. Mai 2033	(22.699)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	542.792	05. Mai 2028	11.701
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	578.606	19. Mai 2025	29.600
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	1.943.439	18. Mai 2033	62.037
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	155.317	24. Mai 2033	(2)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	JPY	3.574	08. Mai 2028	(83)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	232.221	19. Mai 2025	(1.621)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	849.515	18. Mai 2033	8.004
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	GBP	432.345	24. Mai 2033	16.968
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	74.275	24. Mai 2033	5.619
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	314.108	24. Mai 2033	687
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	AUD	184.579	05. Mai 2028	13.410
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	317.514	19. Mai 2025	21.220
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	808.241	18. Mai 2033	59.265
Verkauf Short	Spielwaren/Spiele/Hobbys	J.P. Morgan	JPY	195.627	20. Aug. 2025	149
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	JPY	189.569	24. Mai 2033	18.424
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	JPY	83.148	08. Mai 2028	3.483
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	USD	415.086	05. Mai 2028	(9.010)
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	JPY	76.403	18. Mai 2033	4.654
						USD
						1.357.944

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Differenzkontrakte

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

Zum 30. September 2023 wiesen die folgenden Teilfonds Differenzkontrakte auf Finanzindizes und Futures-Kontrakte auf:

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*				
CFD auf australische Aktien	UBS	161.018	15.898	15.898
CFD auf chinesische Aktien	UBS	244.156	(7.166)	(7.166)
CFD auf Aktien aus Hongkong	UBS	86.115	(36.191)	(36.191)
CFD auf italienische Aktien	UBS	23.200	(7.407)	(7.407)
CFD auf Aktien aus Macau	UBS	30.000	(9.355)	(9.355)
CFD auf neuseeländische Aktien	UBS	50.794	(5.023)	(5.023)
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	63.600	(18.256)	(18.256)
CFD auf südkoreanische Aktien	UBS	(8.967)	31.051	31.051
CFD auf taiwanische Aktien	UBS	(163.000)	7.607	7.607
CFD auf US-Aktien	UBS	65.219	(34.279)	(34.279)
CFD auf den MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	UBS	(7.304)	238.680	238.680
			USD	175.559
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD auf den Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Bank of America	(321)	(204.461)	(3.055)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Bank of America	8.152	1.392.093	30.210
CFD auf den Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Bank of America	(1.137)	(669.746)	(31.891)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Bank of America	251	310.878	(11.179)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Bank of America	(717)	(439.350)	(4.231)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Bank of America	2.678	1.766.967	(12.203)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Bank of America	(3.645)	(2.741.736)	129.094
CFD auf den Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Bank of America	1.651	1.851.787	(26.246)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Index	Bank of America	(980)	(712.042)	16.884
CFD auf den Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Bank of America	4.713	1.629.880	1.579
CFD auf den Stoxx Europe 600 Media Price Index	Bank of America	4.549	1.774.728	47.795
CFD auf den Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Bank of America	1.666	638.236	32.570
CFD auf den Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Bank of America	229	238.713	2.367
CFD auf den Stoxx Europe 600 Retail Price Index	Bank of America	2.878	1.122.476	(38.929)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Bank of America	(323)	(222.280)	3.029
CFD auf den Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Bank of America	(3.847)	(786.848)	16.815
CFD auf den Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Bank of America	(2.026)	(470.895)	28.903
CFD auf den Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Bank of America	(443)	(166.826)	3.085
CFD auf den S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	1.281	1.619.179	(109.817)
CFD auf den S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	(1.791)	(1.302.696)	54.495
CFD auf den S&P 500 Energy Sector Index	Goldman Sachs	1.649	1.144.721	27.540
CFD auf den S&P 500 Financials Sector Index	Goldman Sachs	4.894	2.702.273	(125.123)
CFD auf den S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	604	906.737	(29.046)
CFD auf den S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	(449)	(385.050)	2.973
CFD auf den S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	306	889.103	(67.247)
CFD auf den S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	176	87.040	(5.726)
CFD auf den S&P 500 Utilities Sector Index	Goldman Sachs	(11.733)	(3.510.509)	217.535
			USD	6.462.372
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
CFD auf australische Aktien	Morgan Stanley	(19.748)	(163.524)	(163.524)
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	(188.619)	77.628	77.628

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)				
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	(31.788)	161.092	161.092
CFD auf französische Aktien	Morgan Stanley	(20.150)	34.512	34.512
CFD auf deutsche Aktien	Morgan Stanley	44.017	(46.072)	(46.072)
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	(17.711)	114.413	114.413
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	(146.630)	70.927	70.927
CFD auf neuseeländische Aktien	Morgan Stanley	(12.000)	83.789	83.789
CFD auf norwegische Aktien	Morgan Stanley	285.130	(309.210)	(309.210)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(637.132)	816.696	816.696
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(1.442.609)	1.350.893	1.350.893
CFD auf den MSCOLYTS Index	Morgan Stanley	(32.500)	118.102	118.102
CFD auf den MSLYT23L Index	Morgan Stanley	32.500	(106.652)	(106.652)
			USD 2.202.594	2.202.594
Schroder GAIA Helix				
CFD auf argentinische Aktien	Goldman Sachs	6.771	(3.250)	(3.250)
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	920.080	132.333	132.333
CFD auf australische Aktien	J.P. Morgan	11.290.918	34.561	34.561
CFD auf österreichische Aktien	Goldman Sachs	33.440	11.952	11.952
CFD auf österreichische Aktien	J.P. Morgan	14.841	3.457	3.457
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	96.500	35.861	35.861
CFD auf brasilianische Aktien	Goldman Sachs	7.121	(38.255)	(38.255)
CFD auf brasilianische Aktien	J.P. Morgan	458	(53.059)	(53.059)
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	13.079.708	(503.679)	(502.935)
CFD auf britische Aktien	J.P. Morgan	454.601	(31.542)	(31.542)
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	53.173	(45.207)	(45.207)
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	6.627.351	(1.293.305)	(1.293.305)
CFD auf chinesische Aktien	J.P. Morgan	3.390.198	40.491	40.491
CFD auf tschechische Aktien	Goldman Sachs	(45.189)	49.170	49.170
CFD auf tschechische Aktien	J.P. Morgan	(14.095)	(8.863)	(8.863)
CFD auf dänische Aktien	Goldman Sachs	136.140	(12.014)	(12.014)
CFD auf dänische Aktien	J.P. Morgan	51.128	(35.782)	(35.782)
CFD auf niederländische Aktien	Goldman Sachs	525.974	(141.860)	(141.860)
CFD auf niederländische Aktien	J.P. Morgan	69.507	13.297	13.297
CFD auf finnische Aktien	Goldman Sachs	(32.741)	49.657	49.657
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	400.367	(4.461)	(4.461)
CFD auf französische Aktien	J.P. Morgan	46.282	(39.873)	(39.873)
CFD auf georgische Aktien	Goldman Sachs	(29.349)	(82.390)	(82.390)
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	721.299	(579.952)	(579.952)
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	143.316	(88.056)	(88.217)
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	2.856.494	(637.488)	(637.488)
CFD auf Aktien aus Hongkong	J.P. Morgan	867.876	(155.710)	(155.710)
CFD auf isländische Aktien	Goldman Sachs	17.786	(10.545)	(10.545)
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	7.324	(24.242)	(24.242)
CFD auf indische Aktien	J.P. Morgan	54.189	(237.890)	(237.890)
CFD auf indonesische Aktien	Goldman Sachs	755.100	7.350	7.350
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	10.935	(98.292)	(98.292)
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	74.000	(55.913)	(55.913)
CFD auf italienische Aktien	J.P. Morgan	193.192	(19.646)	(19.646)
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	1.509.300	(134.398)	(134.398)
CFD auf japanische Aktien	J.P. Morgan	9.877.900	(3.869.595)	(3.869.595)
CFD auf Aktien aus Jersey	Goldman Sachs	20.866	127	127

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf luxemburgische Aktien	Goldman Sachs	105.523	(21.244)	(21.244)
CFD auf Aktien aus Macau	Goldman Sachs	138.000	(75.695)	(75.695)
CFD auf Aktien aus Macau	J.P. Morgan	177.000	(85.979)	(85.979)
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	34.312	(3.252)	(3.252)
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P. Morgan	299.464	(8.062)	(8.062)
CFD auf norwegische Aktien	Goldman Sachs	207.245	67.528	67.528
CFD auf norwegische Aktien	J.P. Morgan	145.853	11.866	11.866
CFD auf polnische Aktien	Goldman Sachs	(44.736)	73.071	73.071
CFD auf polnische Aktien	J.P. Morgan	(12.325)	(641)	(641)
CFD auf portugiesische Aktien	Goldman Sachs	4.072	(7.588)	(7.588)
CFD auf portugiesische Aktien	J.P. Morgan	64.971	344	344
CFD auf russische Aktien	Goldman Sachs	6.978	-	-
CFD auf saudi-arabische Aktien	J.P. Morgan	67.971	84.284	84.284
CFD auf Aktien aus Singapur	Goldman Sachs	757.040	4.210	4.210
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	394.400	(100.370)	(100.370)
CFD auf südafrikanische Aktien	Goldman Sachs	179.224	282.514	282.514
CFD auf südafrikanische Aktien	J.P. Morgan	32.379	(988)	(988)
CFD auf südkoreanische Aktien	Goldman Sachs	(53.910)	217.671	217.671
CFD auf südkoreanische Aktien	J.P. Morgan	(3.121)	101.707	101.707
CFD auf spanische Aktien	Goldman Sachs	307.538	82.941	82.941
CFD auf spanische Aktien	J.P. Morgan	119.626	(16.276)	(16.276)
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	265.870	186.162	185.697
CFD auf schwedische Aktien	J.P. Morgan	87.980	20.911	20.911
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	70.363	(83.514)	(83.514)
CFD auf Schweizer Aktien	J.P. Morgan	2.094	(6.933)	(6.933)
CFD auf taiwanische Aktien	Goldman Sachs	(940.162)	87.993	87.993
CFD auf taiwanische Aktien	J.P. Morgan	(23.000)	(2.612)	(2.612)
CFD auf türkische Aktien	Goldman Sachs	523.651	(819)	(819)
CFD auf ukrainische Aktien	Goldman Sachs	264.895	(10.294)	(10.294)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	871.093	(1.764.595)	(1.760.684)
CFD auf US-Aktien	J.P. Morgan	502.220	(566.603)	(566.603)
CFD auf den FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(466)	246.252	246.252
CFD auf den GSCBTUK2 Index	Goldman Sachs	(25.074)	78.652	78.652
CFD auf den HXE EU Banks Index	Goldman Sachs	111.903	98.543	98.543
CFD auf den HXE EU Value Long Index	Goldman Sachs	60.192	(4.490)	(4.490)
CFD auf den HXE EU Value Short Index	Goldman Sachs	(60.268)	256.486	256.486
CFD auf den HXE JP Value Long Index	Goldman Sachs	7.983.859	10.038	10.038
CFD auf den HXE JP Value Short Index	Goldman Sachs	(8.928.652)	354.850	354.850
CFD auf den HXE Pharma Index	Goldman Sachs	50.683	(139.977)	(139.977)
CFD auf den HXE Staples Index	Goldman Sachs	132.614	(477.023)	(477.023)
CFD auf den HXE US Value Long Index	Goldman Sachs	44.205	(76.475)	(76.475)
CFD auf den HXE US Value Short Index	Goldman Sachs	(42.867)	282.922	282.922
CFD auf den HXE World Size Index	Goldman Sachs	83.737	17.946	17.946
CFD auf den MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(42.437)	1.509.640	1.509.640
CFD auf den MSCI EM Europe 10/40 Index	Goldman Sachs	(592)	25.930	30.432
CFD auf den MSCI EM Latin America 10-40 Gross Total Return Index	Goldman Sachs	(11.875)	114.485	132.766
CFD auf den MSCI PROV Saudi Arabia Gross Total Return Index	J.P. Morgan	(449)	(381)	(381)
CFD auf den MXJPLC Index	Goldman Sachs	685.162	(131.513)	(131.513)
			USD (7.195.389)	(7.168.577)
Schroder GAIA SEG US Equity*				
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	28.043	183.850	176.059
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	188.035	(1.678.815)	(1.686.146)
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	(37.518)	1.088	5.634

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA SEG US Equity* (Forts.)				
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	9.144	(105.733)	(104.230)
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	15.202	(136.192)	(135.913)
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	(121.937)	(124.972)	(125.419)
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	132.907	(1.555.878)	(1.555.164)
CFD auf mexikanische Aktien	Goldman Sachs	48.090	(29.571)	(33.410)
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	147.029	(272.881)	(278.001)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(753.771)	3.842.304	4.194.115
CFD auf GS Commercial Real Estate Basket	Goldman Sachs	(24.836)	(191.810)	(196.458)
CFD auf GS CSDN Basket	Goldman Sachs	(12.786)	193.121	191.566
CFD auf GS Energy Basket	Goldman Sachs	(32.303)	(310.505)	(310.935)
CFD auf GS Flagship Basket	Goldman Sachs	(39.139)	372.153	411.106
CFD auf GS Healthcare Basket	Goldman Sachs	(21.472)	148.100	181.268
CFD auf GS Holt Defense Basket	Goldman Sachs	(24.153)	124.761	126.123
CFD auf GS Info Tech Basket	Goldman Sachs	(12.869)	16.558	47.632
CFD auf GS MAMA Basket	Goldman Sachs	(9.754)	(11.392)	(11.392)
CFD auf GS OZVT Index	Goldman Sachs	(51.473)	264.225	474.633
CFD auf GS PEVC Basket	Goldman Sachs	(52.453)	(16.303)	(16.891)
CFD auf GS Regiaufal Banks Basket	Goldman Sachs	(3.927)	(268)	(3.146)
CFD auf den GS SHIF Index	Goldman Sachs	(43.532)	(127.232)	(45.389)
CFD auf GS SPAC Basket	Goldman Sachs	(31.706)	77.041	206.060
CFD auf GS STHK Basket	Goldman Sachs	(21.955)	47.734	47.699
CFD auf GS Utilities Basket	Goldman Sachs	(17.787)	211.993	208.120
			USD	921.376
				1.767.521

Credit Default Index-Swapkontrakte

Ein Credit Default Index Swap ermöglicht die Übertragung von Ausfallrisiken. Dadurch kann der Fonds einen effektiven Versicherungsschutz in Bezug auf eine von ihm gehaltene Referenzindexanleihe (Absicherung der 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 Fonds die zugrunde liegende Referenzanleihe nicht hält, kann zusätzlich ein Marktrisiko bestehen, da der Fonds möglicherweise Zeit benötigt, um die Referenzindexanleihe zu erhalten und an die Gegenpartei zu liefern. Darüber hinaus besteht die Möglichkeit, dass der Fonds den ihm von der Gegenpartei geschuldeten Betrag nicht wiedererlangt, wenn die Gegenpartei insolvent wird. Der Markt für Credit Default Indizes kann mitunter weniger liquide sein als die Rentenmärkte. Die Gesellschaft verringert dieses Risiko, indem sie den Abschluss derartiger Geschäfte in angemessener Weise überwacht.

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

Am 30. September 2023 waren die folgenden Teilfonds in Credit Default Index-Swapkontrakten auf Finanzindizes engagiert:

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten %	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 40 20/12/2028	J.P. Morgan	EUR	39.000.000	5,00	20. Dez. 2028	1.295.893
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 40 20/12/2028	J.P. Morgan	EUR	153.000.000	1,00	20. Dez. 2028	1.621.849
Verkauf	CDX North America High Yield Series 41 20/12/2028	J.P. Morgan	USD	45.000.000	5,00	20. Dez. 2028	428.482
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 41 20/12/2028	J.P. Morgan	USD	197.000.000	1,00	20. Dez. 2028	2.414.461
						USD	5.760.685

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Kauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 40 20/12/2028	Citi Bank	EUR	10.000.000	1,00	20. Dez. 2028	25.334
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 40 20/12/2028	Citi Bank	EUR	56.000.000	1,00	20. Dez. 2028	(141.618)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Credit Default Index-Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/ erhalten %	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Verkauf	CDX North America High Yield Series 41 20/12/2028	Citi Bank	USD	20.000.000	5,00	20. Dez. 2028	(41.341)
Kauf	CDX North America Investment Grade Series 41 20/12/2028	Citi Bank	USD	20.000.000	1,00	20. Dez. 2028	49.997
USD							(107.628)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	6.980.000	1,00	20. Dez. 2027	76.186
Kauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 39 20/06/2028	Morgan Stanley	EUR	18.193.000	1,00	20. Jun. 2028	(118.441)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 39 20/06/2028	Morgan Stanley	EUR	12.375.000	1,00	20. Jun. 2028	(18.729)
Kauf	CDX iTraxx Europe Subordinated Financial Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	3.970.000	1,00	20. Dez. 2027	(193.652)
Kauf	CDX North America High Yield Series 41 20/12/2028	Morgan Stanley	USD	7.555.000	5,00	20. Dez. 2028	15.851
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 41 20/12/2028	Morgan Stanley	USD	16.500.000	1,00	20. Dez. 2028	(14.099)
USD							(252.884)

Credit Default Swapkontrakte

Ein Credit Default Swap ermöglicht die Übertragung des Ausfallrisikos. Dadurch kann der Fonds 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 Swappeschäft 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 Schlussstermin 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 2023 war der folgende Teilfonds in Credit Default Swap-Kontrakten engagiert:

Schutz- position	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf	Belgien	Chemie	Morgan Stanley	EUR	1.990.000	20. Jun. 2028	(9.813)
Kauf	China	Banken	Goldman Sachs	USD	2.070.000	20. Jun. 2028	5.072
Kauf	China	Banken	Morgan Stanley	USD	5.470.000	20. Jun. 2028	15.982
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	7.460.000	20. Jun. 2028	(23.804)
Kauf	Finnland	Verpackung und Behälter	Morgan Stanley	EUR	2.100.000	20. Jun. 2028	32.579
Kauf	Frankreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1.380.000	20. Jun. 2028	(5.747)
Kauf	Frankreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	3.780.000	20. Jun. 2028	(55.469)
Kauf	Frankreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	3.150.000	20. Jun. 2028	(35.573)
Kauf	Frankreich	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	EUR	1.640.000	20. Jun. 2028	(26.941)
Kauf	Frankreich	REITS	Morgan Stanley	EUR	3.760.000	20. Jun. 2028	(57.629)
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Barclays Bank	EUR	1.440.000	20. Jun. 2027	35.397
Kauf	Deutschland	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1.440.000	20. Jun. 2027	(12.329)
Kauf	Deutschland	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	4.920.000	20. Jun. 2028	(468)
Kauf	Deutschland	Chemie	Morgan Stanley	EUR	2.710.000	20. Jun. 2028	67.740
Kauf	Italien	Banken	BNP Paribas	EUR	1.530.000	20. Jun. 2028	(4.638)
Verkauf	Luxemburg	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	EUR	950.000	20. Jun. 2028	(12.752)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Credit Default-Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf	Malaysia	Banken	Morgan Stanley	EUR	6.375.000	20. Jun. 2028	(257.852)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1.220.000	20. Jun. 2028	(6.133)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Luft- und Raumfahrt/ Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	2.220.000	20. Jun. 2028	(97.110)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	410.000	20. Dez. 2025	(34.527)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	805.000	20. Jun. 2027	(101.475)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	475.000	20. Dez. 2027	(55.958)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	660.000	20. Jun. 2028	(71.532)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Banken	Goldman Sachs	EUR	1.710.000	20. Jun. 2028	(21.246)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	2.380.000	20. Jun. 2028	(41.235)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	1.650.000	20. Jun. 2028	481
Kauf	Vereinigtes Königreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	1.800.000	20. Jun. 2028	(8.856)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	620.000	20. Jun. 2028	(17.921)
Verkauf	USA	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	2.150.000	20. Jun. 2028	23.551
Verkauf	USA	Automobilindustrie	Morgan Stanley	USD	1.340.000	20. Jun. 2028	(18.307)
Verkauf	USA	Banken	J.P. Morgan	EUR	2.050.000	20. Jun. 2028	42.775
Verkauf	USA	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	1.500.000	20. Jun. 2028	2.045
Verkauf	USA	Chemie	Morgan Stanley	USD	1.745.000	20. Jun. 2028	7.394
Verkauf	USA	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	1.025.000	20. Jun. 2028	(2.923)
Verkauf	USA	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	885.000	20. Jun. 2028	2.059
Verkauf	USA	Internet	Morgan Stanley	USD	1.700.000	20. Jun. 2028	11.629
Verkauf	USA	Medien	Morgan Stanley	USD	3.810.000	20. Jun. 2028	(5.045)
Verkauf	USA	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	795.000	20. Jun. 2028	4.630
Verkauf	USA	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	800.000	20. Jun. 2028	168
Kauf	USA	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	630.000	20. Dez. 2027	(38.400)
Verkauf	USA	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	960.000	20. Dez. 2027	(58.514)
Verkauf	USA	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	1.100.000	20. Jun. 2028	1.416
Kauf	USA	Öffentliche Hand	Barclays Bank	EUR	1.280.000	20. Jun. 2024	(20.778)
Verkauf	USA	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	1.135.000	20. Jun. 2028	(4.262)
USD							(854.319)

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 2023 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								
Morgan Stanley	USD	21.907.219	AUD	30.014.000	20. Mrz. 2029	USD SOFR 1 Tag	AUD BBR 3 Monate	(8.887)
Morgan Stanley	USD	23.258.410	NOK	205.816.000	20. Mrz. 2029	USD SOFR 1 Tag	NOK NIBOR 3 Monate	3.919
Morgan Stanley	USD	22.173.842	NZD	32.647.000	20. Mrz. 2029	USD SOFR 1 Tag	NZD BBR 3 Monate	6.397
Morgan Stanley	USD	22.240.726	SEK	215.288.000	20. Mrz. 2029	USD SOFR 1 Tag	SEK STIBOR 3 Monate	18.015
USD								19.444

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (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 2023 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Inflationsraten engagiert:

Nennbetrag	Währung	Kontrahent	Wertpapierbeschreibung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
5.675.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,43 %, erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Jahre	15. Mrz. 2033	64.064
5.112.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,45 %, erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Jahre	15. Feb. 2033	46.240
5.675.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,46 %, erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Jahre	15. Mrz. 2033	47.452
5.675.000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,49 %, erhält variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Mrz. 2028	13.215
9.519.000	USD	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,63 %, erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Jahre	15. Sep. 2033	(74.921)
5.112.000	EUR	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,48 %, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Feb. 2028	(15.276)
5.675.000	EUR	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,53 %, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Mrz. 2028	(1.973)
2.710.000	USD	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,60 %, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Sep. 2028	(7.055)
6.809.000	USD	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,61 %, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Sep. 2028	20.952
6.155.000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,32 %, erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Jahre	15. Feb. 2033	129.493
6.463.000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,40 %, erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Jahre	15. Feb. 2033	91.828
3.730.000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,61 %, erhält variablen Zinssatz HICPX 10 Jahre	15. Sep. 2033	(23.467)
6.155.000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,31 %, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Feb. 2028	(70.678)
6.463.000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,40 %, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Feb. 2028	(43.867)
3.730.000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,62 %, zahlt variablen Zinssatz HICPX 5 Jahre	15. Sep. 2028	14.752
				USD	190.759

Zins-Swapkontrakte

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

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

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

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

Zum 30. September 2023 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Zinssätze engagiert:

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Erhält Festzinssatz 1,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	3.000.000	CHF	20. Dez. 2028	(1.340)
Erhält Festzinssatz 9,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	172.042.513	BRL	02. Jan. 2025	(245.506)
Erhält Festzinssatz 9,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	111.423.583	BRL	02. Jan. 2026	(372.897)
Zahlt Festzinssatz 13,48 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	31.423.583	BRL	02. Jan. 2026	(359.490)
Zahlt Festzinssatz 13,60 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	82.042.513	BRL	02. Jan. 2025	(463.397)
Zahlt Festzinssatz 10,62 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	40.000.000	BRL	02. Jan. 2026	(5.347)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 9,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	94.883.101	ZAR	20. Dez. 2033	(238.901)
Zahlt Festzinssatz 10,72 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	94.883.101	ZAR	20. Dez. 2033	(236.677)
Zahlt Festzinssatz 3,02 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	36.000.000	SEK	20. Dez. 2028	75.500
Zahlt Festzinssatz 3,02 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	216.000.000	SEK	20. Dez. 2028	453.002
Zahlt Festzinssatz 1,84 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	15.000.000	CHF	20. Dez. 2028	(127.527)
Zahlt Festzinssatz 2,00 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	4.626.600	CHF	20. Dez. 2033	(92.977)
Erhält Festzinssatz 1,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	1.426.600	CHF	20. Dez. 2033	(35.447)
Zahlt Festzinssatz 3,00 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	80.000.000	SEK	20. Dez. 2033	264.943
Zahlt Festzinssatz 3,00 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	40.000.000	SEK	20. Dez. 2033	132.471
Zahlt Festzinssatz 10,00 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	40.000.000	ZAR	20. Dez. 2033	(3.691)
Erhält Festzinssatz 1,44 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	120.000.000	JPY	20. Dez. 2043	(465)
Zahlt Festzinssatz 8,83 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	110.397.756	MXN	07. Dez. 2033	229.124
Erhält Festzinssatz 7,85 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	10.397.756	MXN	07. Dez. 2033	(58.151)
Zahlt Festzinssatz 9,73 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	8.071.545	MXN	17. Dez. 2025	5.163
Zahlt Festzinssatz 8,22 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	241.005.128	MXN	13. Dez. 2028	661.083
Erhält Festzinssatz 7,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	81.005.128	MXN	13. Dez. 2028	(303.545)
Zahlt Festzinssatz 8,50 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	331.928.455	MXN	17. Dez. 2025	624.862
Zahlt Festzinssatz 3,93 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	96.000.000	USD	20. Dez. 2025	1.587.555
Zahlt Festzinssatz 3,39 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	56.000.000	EUR	20. Dez. 2025	335.944
Erhält Festzinssatz 7,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	304.824.014	ZAR	20. Dez. 2025	(195.442)
Zahlt Festzinssatz 3,57 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	40.000.000	USD	20. Dez. 2027	1.164.170
Zahlt Festzinssatz 3,57 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	12.000.000	USD	20. Dez. 2027	349.251
Zahlt Festzinssatz 9,29 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	454.824.014	ZAR	20. Dez. 2025	(344.908)
Zahlt Festzinssatz 3,31 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	344.000.000	SEK	20. Dez. 2025	361.999

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 3,31 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	344.000.000	SEK	20. Dez. 2025	361.998
Zahlt Festzinssatz 3,13 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	5.400.000	USD	20. Dez. 2048	796.632
Zahlt Festzinssatz 1,30 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	2.280.000.000	JPY	20. Dez. 2043	410.304
Zahlt Festzinssatz 1,30 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	2.160.000.000	JPY	20. Dez. 2043	388.706
Zahlt Festzinssatz 3,13 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	7.200.000	USD	20. Dez. 2048	1.062.177
Zahlt Festzinssatz 3,30 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	16.000.000	USD	20. Dez. 2043	1.919.087
Zahlt Festzinssatz 9,86 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	172.299.493	ZAR	20. Dez. 2028	(320.162)
Erhält Festzinssatz 8,23 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	172.299.493	ZAR	20. Dez. 2028	(265.295)
Zahlt Festzinssatz 3,41 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	4.000.000	USD	20. Dez. 2030	199.826
Zahlt Festzinssatz 3,41 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	30.000.000	USD	20. Dez. 2030	1.498.698
Zahlt Festzinssatz 3,74 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	8.000.000	EUR	20. Dez. 2025	(8.926)
Erhält Festzinssatz 4,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	3.000.000	USD	20. Dez. 2043	17.061
Erhält Festzinssatz 4,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	2.000.000	USD	20. Dez. 2030	6.941
Zahlt Festzinssatz 9,05 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	70.000.000	ZAR	20. Dez. 2028	(11.296)
Erhält Festzinssatz 4,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	900.000	USD	20. Dez. 2048	5.355
				USD	9.220.465
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Zahlt Festzinssatz 2,50 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	75.366.000	CNY	20. Mrz. 2029	20.067
Erhält Festzinssatz 2,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	13.073.000	USD	18. Jun. 2028	(397.907)
Erhält Festzinssatz 4,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.318.049.000	CLP	21. Jun. 2033	(75.342)
Zahlt Festzinssatz 10,45 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	12.555.000	ZAR	21. Jun. 2033	16.257
Zahlt Festzinssatz 10,51 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	37.771.000	ZAR	21. Jun. 2033	46.047
Erhält Festzinssatz 8,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20.091.000	MXN	25. Jan. 2033	(85.836)
Erhält Festzinssatz 3,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	8.342.000	SGD	17. Sep. 2028	(22.058)
Zahlt Festzinssatz 3,97 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	6.467.000	MYR	17. Sep. 2028	(51)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 3,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	1.451.000	GBP	20. Sep. 2033	(13.037)
Erhält Festzinssatz 12,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	29.269.294	BRL	02. Jan. 2025	60.642
Erhält Festzinssatz 12,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	2.700.448	BRL	02. Jan. 2026	17.086
Erhält Festzinssatz 12,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	10.023.811	BRL	02. Jan. 2025	15.903
Erhält Festzinssatz 12,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	1.275.963	BRL	02. Jan. 2026	7.454
Erhält Festzinssatz 11,85 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	750.995	BRL	02. Jan. 2029	3.248
Erhält Festzinssatz 11,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	19.733.691	BRL	02. Jan. 2026	15.977
Zahlt Festzinssatz 3,38 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 3 Months	Morgan Stanley	33.181.000	NOK	18. Sep. 2025	25.258
Erhält Festzinssatz 2,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 6 Months	Morgan Stanley	2.720.000	CAD	17. Sep. 2028	(48.678)
Erhält Festzinssatz 3,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 6 Months	Morgan Stanley	6.573.000	CAD	18. Sep. 2025	(41.779)
Erhält Festzinssatz 4,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	3.213.000	GBP	20. Dez. 2028	13.146
Erhält Festzinssatz 2,91 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.692.000	EUR	20. Dez. 2033	(81.203)
Erhält Festzinssatz 4,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	273.933.000	CLP	17. Sep. 2028	(8.054)
Erhält Festzinssatz 4,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	2.041.000	GBP	18. Dez. 2025	(1.967)
Zahlt Festzinssatz 3,41 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	28.934.000	MYR	20. Dez. 2025	38.291
Zahlt Festzinssatz 6,02 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	484.770.000	INR	20. Dez. 2025	79.651
Erhält Festzinssatz 5,99 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	573.370.000	INR	20. Dez. 2028	(220.595)
Zahlt Festzinssatz 9,23 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	299.581.000	MXN	14. Dez. 2033	243.050
Erhält Festzinssatz 4,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	63.237.000	CZK	20. Dez. 2033	(43.415)
Zahlt Festzinssatz 4,79 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	983.347.000	CLP	20. Dez. 2033	67.245
Erhält Festzinssatz 5,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	57.732.000	PLN	20. Dez. 2024	163.214
Erhält Festzinssatz 4,95 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	65.988.000	PLN	20. Dez. 2028	306.206
Erhält Festzinssatz 5,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.713.000	PLN	20. Dez. 2033	(24.421)
Erhält Festzinssatz 8,89 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	426.266.000	MXN	17. Dez. 2025	(645.423)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 8,28 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	24.730.206.000	COP	20. Dez. 2025	94.307
Erhält Festzinssatz 10,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	5.718.932	BRL	01. Jul. 2026	(19.384)
Erhält Festzinssatz 11,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	10.489.203	BRL	02. Jan. 2025	(7.733)
Erhält Festzinssatz 11,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	10.489.691	BRL	02. Jan. 2025	(7.656)
Erhält Festzinssatz 6,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	28.262.000	INR	20. Dez. 2028	(8.229)
Zahlt Festzinssatz 8,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	67.600.000	MXN	19. Jul. 2028	174.412
Erhält Festzinssatz 3,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	14.667.000	USD	20. Dez. 2033	(210.960)
Zahlt Festzinssatz 8,88 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	64.700.000	MXN	09. Aug. 2028	105.116
Zahlt Festzinssatz 8,35 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	67.760.000	ZAR	20. Dez. 2025	8.532
Zahlt Festzinssatz 2,30 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	2.694.000	CNY	20. Dez. 2028	3.618
Zahlt Festzinssatz 8,26 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	23.145.000	ZAR	20. Dez. 2025	5.013
Erhält Festzinssatz 11,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	290.430.000	MXN	01 Mai 2024	(13.808)
Erhält Festzinssatz 3,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2.676.906.000	KRW	20. Dez. 2028	(11.852)
Zahlt Festzinssatz 3,66 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	904.231.000	KRW	20. Dez. 2033	8.851
Erhält Festzinssatz 7,99 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	404.285.000	HUF	20. Dez. 2025	(6.578)
Erhält Festzinssatz 7,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.553.735.000	COP	20. Dez. 2028	(27.612)
Zahlt Festzinssatz 7,87 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.812.650.000	COP	20. Dez. 2033	62.976
Erhält Festzinssatz 7,61 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6.402.800.000	COP	20. Dez. 2028	(67.973)
Zahlt Festzinssatz 7,84 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.520.715.000	COP	20. Dez. 2033	25.928
Erhält Festzinssatz 7,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	445.200.000	COP	20. Dez. 2028	(4.617)
Erhält Festzinssatz 7,62 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.730.575.000	COP	20. Dez. 2028	(38.982)
Zahlt Festzinssatz 7,87 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.221.375.000	COP	20. Dez. 2033	36.656
Zahlt Festzinssatz 7,90 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.221.290.000	COP	20. Dez. 2033	35.723
Zahlt Festzinssatz 8,10 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	55.360.000	ZAR	20. Dez. 2026	35.128

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 4,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.113.000	PLN	20. Dez. 2025	10.033
Zahlt Festzinssatz 3,84 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	12.760.000	ILS	20. Dez. 2033	129.654
Erhält Festzinssatz 3,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	23.500.000	ILS	20. Dez. 2028	(148.682)
Erhält Festzinssatz 3,36 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	1.500.000	SGD	20. Dez. 2025	(3.349)
Zahlt Festzinssatz 8,54 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	98.005.000	ZAR	20. Dez. 2028	87.109
Zahlt Festzinssatz 8,00 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6.581.830.000	COP	20. Dez. 2030	62.921
Erhält Festzinssatz 4,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14.391.000	PLN	20. Dez. 2025	(17.825)
Erhält Festzinssatz 6,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.133.394.000	HUF	20. Dez. 2033	(66.605)
Erhält Festzinssatz 8,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	9.219.320.000	COP	20. Dez. 2028	(47.626)
Erhält Festzinssatz 8,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	8.921.435.000	COP	20. Dez. 2028	(42.580)
Zahlt Festzinssatz 8,37 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	5.619.345.000	COP	20. Dez. 2033	47.746
Zahlt Festzinssatz 3,88 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	19.570.000	CAD	20. Mrz. 2029	224.753
Zahlt Festzinssatz 5,31 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	5.657.760.000	CLP	20. Dez. 2028	75.888
Zahlt Festzinssatz 8,54 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.754.890.000	COP	20. Dez. 2025	7.384
Erhält Festzinssatz 8,24 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1.585.259.000	COP	20. Dez. 2033	(16.797)
Zahlt Festzinssatz 8,56 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6.845.838.000	COP	20. Dez. 2025	17.741
Zahlt Festzinssatz 8,55 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.755.270.000	COP	20. Dez. 2025	7.201
Erhält Festzinssatz 8,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	633.979.000	COP	20. Dez. 2033	(6.564)
Zahlt Festzinssatz 4,69 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	41.063.000	ILS	20. Dez. 2024	11.199
Erhält Festzinssatz 6,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	106.340.000	INR	20. Mrz. 2029	(2.087)
Zahlt Festzinssatz 6,69 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	906.981.000	INR	20. Mrz. 2026	5.378
Erhält Festzinssatz 8,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	12.758.545.000	COP	20. Dez. 2028	(67.163)
Zahlt Festzinssatz 8,74 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	4.114.233.000	COP	20. Dez. 2025	7.369
Zahlt Festzinssatz 8,76 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	10.323.695.000	COP	20. Dez. 2025	17.343

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 8,72 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	17.963.552.000	COP	20. Dez. 2025	33.173
Zahlt Festzinssatz 8,36 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	7.776.430.000	COP	20. Dez. 2033	67.330
Erhält Festzinssatz 8,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	604.022.000	COP	20. Dez. 2033	(5.474)
Zahlt Festzinssatz 8,87 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6.229.814.000	COP	20. Dez. 2025	7.418
Zahlt Festzinssatz 8,83 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.657.297.000	COP	20. Dez. 2025	3.637
Zahlt Festzinssatz 5,44 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	7.362.838.000	CLP	20. Dez. 2025	85.928
Zahlt Festzinssatz 8,53 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	7.306.960.000	COP	20. Dez. 2033	42.611
Erhält Festzinssatz 10,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	4.387.025	BRL	02. Jan. 2029	(28.058)
Erhält Festzinssatz 10,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	4.389.121	BRL	02. Jan. 2029	(28.504)
Erhält Festzinssatz 8,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	11.952.445.000	COP	20. Dez. 2028	(40.598)
Erhält Festzinssatz 4,96 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.738.120.000	CLP	20. Mrz. 2029	(110.334)
Erhält Festzinssatz 8,41 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	906.029.000	COP	20. Dez. 2033	(7.040)
Zahlt Festzinssatz 8,98 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.985.945.000	COP	20. Dez. 2025	2.795
Erhält Festzinssatz 8,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	8.366.715.000	COP	20. Dez. 2028	(38.288)
Zahlt Festzinssatz 8,41 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2.746.765.000	COP	20. Dez. 2033	21.342
Zahlt Festzinssatz 3,82 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	25.996.000	PLN	19. Mrz. 2026	12.058
Zahlt Festzinssatz 4,76 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	22.466.000	CZK	20. Dez. 2025	4.691
Erhält Festzinssatz 4,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	1.285.000	USD	20. Dez. 2030	(3.999)
Zahlt Festzinssatz 8,80 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	54.146.000	ZAR	20. Dez. 2028	19.244
Erhält Festzinssatz 10,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	8.814.810	BRL	02. Jan. 2026	(14.966)
Erhält Festzinssatz 10,86 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	5.230.223	BRL	02. Jan. 2029	(23.410)
Erhält Festzinssatz 10,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	6.035.388	BRL	02. Jan. 2026	(11.362)
Erhält Festzinssatz 4,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	29.505.000	USD	18. Dez. 2026	15.927
Erhält Festzinssatz 4,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	2.555.000	USD	20. Dez. 2030	9.305

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 8,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	528.630.000	HUF	20. Dez. 2025	187
Erhält Festzinssatz 4,51 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	59.587.000	CZK	20. Dez. 2028	(286)
Zahlt Festzinssatz 9,17 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	96.402.000	MXN	17. Sep. 2027	109.082
Zahlt Festzinssatz 3,68 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.465.000	ILS	19. Mrz. 2028	10.350
Erhält Festzinssatz 4,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	560.542.000	CLP	19. Mrz. 2028	(15.066)
Erhält Festzinssatz 4,43 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.163.627.000	CLP	19. Mrz. 2028	(26.456)
Zahlt Festzinssatz 8,80 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3.305.356.000	COP	18. Jun. 2028	(9.260)
Zahlt Festzinssatz 8,50 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	162.505.000	MXN	30. Nov. 2027	391.487
Erhält Festzinssatz 4,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.322.717.000	CLP	21. Jun. 2033	(78.106)
Erhält Festzinssatz 4,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	376.657.000	CLP	21. Jun. 2033	(12.736)
Erhält Festzinssatz 3,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	17.563.000	CNY	18. Jun. 2028	23.980
Zahlt Festzinssatz 10,54 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	21.600.000	ZAR	21. Jun. 2033	25.471
Zahlt Festzinssatz 2,94 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	216.506.000	KRW	21. Jun. 2033	5.393
Zahlt Festzinssatz 6,49 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	46.765.000	INR	18. Jun. 2028	5.684
Zahlt Festzinssatz 9,10 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.103.405.000	HUF	19. Jun. 2025	(38.108)
Zahlt Festzinssatz 8,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	31.091.000	MXN	15. Jun. 2033	35.453
Zahlt Festzinssatz 8,47 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	24.215.000	MXN	15. Jun. 2033	26.885
Zahlt Festzinssatz 3,26 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	442.479.000	KRW	21. Jun. 2033	7.096
Zahlt Festzinssatz 3,23 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	884.281.000	KRW	21. Jun. 2033	14.926
Zahlt Festzinssatz 9,33 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	65.960.000	MXN	24. Feb. 2028	47.760
Erhält Festzinssatz 9,01 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19.725.000	MXN	17. Feb. 2033	(32.334)
Zahlt Festzinssatz 7,83 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	84.094.000	ZAR	20. Jun. 2025	23.410
Erhält Festzinssatz 8,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	10.706.700.000	COP	20. Sep. 2033	(21.274)
Erhält Festzinssatz 4,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.495.436.000	CLP	20. Sep. 2033	(50.467)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 3,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	20.479.000	CNY	17. Sep. 2028	35.163
Erhält Festzinssatz 3,23 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	9.229.000	CNY	17. Sep. 2028	19.133
Zahlt Festzinssatz 6,68 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	766.308.000	INR	17. Sep. 2028	29.676
Zahlt Festzinssatz 3,16 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	62.981.100	NOK	20. Sep. 2033	40.364
Zahlt Festzinssatz 3,69 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.993.000	AUD	18. Sep. 2025	25.052
Zahlt Festzinssatz 3,88 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	18.530.000	AUD	17. Sep. 2028	128.799
Zahlt Festzinssatz 4,59 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	19.785.000	AUD	20. Sep. 2033	256.900
Zahlt Festzinssatz 10,61 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	65.897.000	ZAR	21. Jun. 2033	70.965
Zahlt Festzinssatz 10,82 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32.368.000	ZAR	21. Jun. 2033	25.846
Zahlt Festzinssatz 10,77 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	54.142.000	ZAR	21. Jun. 2033	46.938
Zahlt Festzinssatz 2,72 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	42.693.000	SEK	20. Sep. 2033	12.553
Erhält Festzinssatz 3,82 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4.885.000	NZD	18. Jun. 2028	(79.758)
Erhält Festzinssatz 3,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4.885.000	NZD	18. Jun. 2028	(80.679)
Erhält Festzinssatz 8,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19.365.000	MXN	30. Mrz. 2033	(79.618)
Zahlt Festzinssatz 8,76 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	92.490.000	MXN	11. Apr. 2028	174.650
Erhält Festzinssatz 11,19 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	90.745.000	MXN	07 Mai 2024	(9.682)
Erhält Festzinssatz 9,07 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	17.140.000	MXN	05. Mai 2026	(26.918)
Zahlt Festzinssatz 2,63 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.488.000	EUR	18. Sep. 2025	45.108
Erhält Festzinssatz 11,17 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	290.982.000	MXN	20 Mai 2024	(34.688)
Erhält Festzinssatz 9,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	100.492.000	MXN	18. Mai 2026	(151.274)
Erhält Festzinssatz 11,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	291.030.000	MXN	24 Mai 2024	(36.050)
Erhält Festzinssatz 9,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	100.530.000	MXN	22. Mai 2026	(137.097)
Zahlt Festzinssatz 3,31 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	2.880.000	CAD	20. Sep. 2033	9.929
Zahlt Festzinssatz 4,94 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	3.771.000	GBP	20. Dez. 2025	(27.498)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 2,91 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.225.000	EUR	20. Dez. 2028	1.614
Erhält Festzinssatz 5,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	10.628.000	NZD	20. Dez. 2024	(33.636)
Zahlt Festzinssatz 3,73 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	23.987.000	CZK	17. Dez. 2028	11.516
Zahlt Festzinssatz 3,54 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	48.481.000	ILS	18. Dez. 2025	74.085
Zahlt Festzinssatz 3,28 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	13.694.000	ILS	17. Dez. 2028	76.538
Erhält Festzinssatz 3,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	14.069.000	ILS	20. Dez. 2028	(110.675)
Erhält Festzinssatz 3,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	16.303.000	ILS	20. Dez. 2033	(94.394)
Zahlt Festzinssatz 3,67 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	12.443.000	ILS	20. Dez. 2033	170.335
Zahlt Festzinssatz 7,10 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	58.256.000	HUF	20. Dez. 2033	(574)
Zahlt Festzinssatz 8,61 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	107.586.000	ZAR	18. Dez. 2025	(9.572)
Erhält Festzinssatz 3,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	12.633.000	MYR	20. Dez. 2028	(52.215)
Zahlt Festzinssatz 5,16 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	56.160.000	PLN	20. Dez. 2033	(179.408)
Erhält Festzinssatz 5,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	62.280.000	PLN	20. Dez. 2025	266.130
Zahlt Festzinssatz 8,78 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	65.728.000	ZAR	20. Dez. 2025	(18.544)
Zahlt Festzinssatz 9,21 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	357.904.000	ZAR	20. Dez. 2028	(174.607)
Erhält Festzinssatz 10,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	342.140.000	ZAR	20. Dez. 2033	169.216
Zahlt Festzinssatz 7,90 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	180.999.000	MXN	17. Dez. 2025	147.301
Zahlt Festzinssatz 9,81 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	178.877.000	MXN	18. Dez. 2024	127.381
Erhält Festzinssatz 2,29 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	27.607.000	CNY	20. Dez. 2025	7.938
Zahlt Festzinssatz 5,40 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.349.310.000	CLP	20. Dez. 2025	16.867
Zahlt Festzinssatz 5,41 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.269.317.000	CLP	20. Dez. 2025	15.506
Erhält Festzinssatz 4,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3.034.187.000	CLP	20. Dez. 2028	(113.855)
Erhält Festzinssatz 3,00 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	219.055.000	SEK	20. Dez. 2028	(297.438)
Zahlt Festzinssatz 2,72 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	167.540.000	SEK	17. Dez. 2028	171.835

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,08 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.984.000	CZK	20. Dez. 2033	8.524
Erhält Festzinssatz 3,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3.810.129.000	CLP	20. Dez. 2033	(302.924)
Zahlt Festzinssatz 11,50 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20.090.000	ZAR	20. Dez. 2033	2.750
Erhält Festzinssatz 8,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	180.607.000	MXN	07. Dez. 2033	(843.216)
Zahlt Festzinssatz 8,45 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	36.765.000	MXN	14. Jun. 2028	94.000
Erhält Festzinssatz 4,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.133.960	CZK	20. Dez. 2028	(5.636)
Erhält Festzinssatz 3,58 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.131.100.000	KRW	20. Dez. 2025	(4.760)
Erhält Festzinssatz 3,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.845.000	ILS	20. Dez. 2028	(39.982)
Erhält Festzinssatz 3,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	1.062.000	MYR	20. Dez. 2028	(2.457)
Erhält Festzinssatz 8,23 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20.005.000	MXN	13. Jul. 2033	(90.454)
Zahlt Festzinssatz 3,45 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.071.774.000	KRW	20. Dez. 2033	11.665
Erhält Festzinssatz 4,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.680.571.000	CLP	23. Sep. 2025	(16.916)
Erhält Festzinssatz 4,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3.160.047.000	CLP	23. Sep. 2025	(31.490)
Erhält Festzinssatz 4,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.341.308.000	CLP	23. Sep. 2025	(22.978)
Zahlt Festzinssatz 10,97 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	9.374.000	ZAR	20. Dez. 2033	7.760
Erhält Festzinssatz 9,58 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	943.887.000	HUF	20. Dez. 2024	5.644
Erhält Festzinssatz 9,58 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	943.717.000	HUF	20. Dez. 2024	5.643
Zahlt Festzinssatz 11,12 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	5.847.000	ZAR	20. Dez. 2033	3.692
Erhält Festzinssatz 3,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	2.031.000	SGD	20. Dez. 2025	(6.912)
Zahlt Festzinssatz 3,64 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	860.926.000	KRW	20. Dez. 2033	4.708
Erhält Festzinssatz 8,55 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	532.058.000	HUF	20. Dez. 2025	5.494
Erhält Festzinssatz 8,29 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	521.039.000	HUF	20. Dez. 2025	(1.053)
Erhält Festzinssatz 4,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.670.694.000	CLP	18. Sep. 2025	(10.247)
Erhält Festzinssatz 4,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.670.693.000	CLP	23. Sep. 2025	(10.062)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 4,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	90.412.000	USD	20. Sep. 2025	(114.269)
Erhält Festzinssatz 6,86 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	240.879.000	HUF	20. Dez. 2033	(1.264)
Erhält Festzinssatz 11,30 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	404.630.000	MXN	26. Apr. 2024	(21.729)
Erhält Festzinssatz 6,86 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	141.911.000	HUF	20. Dez. 2033	(745)
Erhält Festzinssatz 6,82 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	267.763.232	HUF	20. Dez. 2033	(2.277)
Erhält Festzinssatz 6,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	321.315.878	HUF	20. Dez. 2033	(3.256)
Zahlt Festzinssatz 8,34 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	67.634.000	ZAR	20. Dez. 2025	9.155
Erhält Festzinssatz 6,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	267.763.231	HUF	20. Dez. 2033	(2.713)
Erhält Festzinssatz 4,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	33.635.000	PLN	20. Dez. 2025	81.229
Zahlt Festzinssatz 5,32 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	32.635.000	PLN	20. Dez. 2024	(62.145)
Zahlt Festzinssatz 4,72 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.515.000	PLN	20. Dez. 2026	(30.585)
Erhält Festzinssatz 8,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	794.043.544	HUF	20. Dez. 2025	5.088
Erhält Festzinssatz 8,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	433.114.656	HUF	20. Dez. 2025	2.416
Erhält Festzinssatz 9,54 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.980.143.220	HUF	20. Dez. 2024	9.906
Zahlt Festzinssatz 3,67 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	514.354.000	KRW	20. Dez. 2033	4.800
Zahlt Festzinssatz 3,69 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	3.159.599.000	KRW	20. Dez. 2033	26.122
Erhält Festzinssatz 3,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	4.049.080.000	KRW	20. Dez. 2028	(19.950)
Erhält Festzinssatz 5,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	264.959.000	CLP	20. Dez. 2028	(7.075)
Zahlt Festzinssatz 3,53 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	4.368.000	SGD	20. Dez. 2024	3.250
Zahlt Festzinssatz 3,25 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	506.000	SGD	20. Dez. 2033	5.394
Zahlt Festzinssatz 5,33 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	551.725.000	CLP	20. Dez. 2033	12.928
Zahlt Festzinssatz 4,21 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	38.390.000	CZK	20. Dez. 2033	36.930
Erhält Festzinssatz 8,09 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.402.030.000	HUF	20. Dez. 2025	(131.356)
Zahlt Festzinssatz 6,73 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.638.730.000	HUF	20. Dez. 2028	72.761

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 6,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	263.290.000	HUF	20. Dez. 2030	(10.624)
Erhält Festzinssatz 6,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	958.286.000	HUF	20. Dez. 2033	(72.752)
Erhält Festzinssatz 3,92 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	124.475.000	PLN	20. Dez. 2025	(197.315)
Zahlt Festzinssatz 3,99 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.685.000	PLN	20. Dez. 2028	26.212
Erhält Festzinssatz 4,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.560.000	PLN	20. Dez. 2033	(47.270)
Zahlt Festzinssatz 8,22 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	598.620.000	ZAR	20. Dez. 2024	98.557
Erhält Festzinssatz 8,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	353.300.000	ZAR	20. Dez. 2025	(141.927)
Zahlt Festzinssatz 8,09 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	107.850.000	ZAR	20. Dez. 2026	69.020
Erhält Festzinssatz 9,01 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13.315.000	ZAR	20. Dez. 2030	(15.551)
Erhält Festzinssatz 9,55 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	114.735.000	ZAR	20. Dez. 2033	(160.255)
Erhält Festzinssatz 5,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.726.330.000	CLP	20. Dez. 2030	(78.079)
Erhält Festzinssatz 5,01 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	206.095.000	CZK	20. Dez. 2025	(519)
Erhält Festzinssatz 4,30 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	124.040.000	CZK	20. Dez. 2028	(51.693)
Erhält Festzinssatz 3,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.265.000	EUR	20. Dez. 2025	(5.805)
Zahlt Festzinssatz 3,09 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.560.000	EUR	20. Dez. 2030	48.420
Erhält Festzinssatz 3,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.530.000	EUR	20. Dez. 2033	(17.003)
Zahlt Festzinssatz 4,01 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	116.680.000	PLN	20. Dez. 2028	516.504
Erhält Festzinssatz 4,46 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	35.350.000	PLN	20. Dez. 2033	(305.962)
Erhält Festzinssatz 11,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	31.170.000	ZAR	20. Dez. 2033	(11.951)
Erhält Festzinssatz 4,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	22.270.000	USD	20. Dez. 2025	(88.236)
Zahlt Festzinssatz 3,94 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	18.970.000	USD	20. Dez. 2028	244.833
Erhält Festzinssatz 3,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3.180.000	USD	20. Dez. 2033	(86.573)
Zahlt Festzinssatz 6,84 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.867.775.000	HUF	20. Dez. 2028	192.649
Zahlt Festzinssatz 4,61 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.954.000	PLN	20. Dez. 2033	18.214

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,95 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	37.322.000	CZK	20. Dez. 2025	2.076
Zahlt Festzinssatz 3,87 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.520.000	ILS	20. Dez. 2033	33.660
Erhält Festzinssatz 8,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	160.105.000	ZAR	20. Dez. 2025	(68.476)
Zahlt Festzinssatz 8,20 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	153.340.000	ZAR	20. Dez. 2024	26.375
Zahlt Festzinssatz 5,30 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.187.925.000	CLP	20. Dez. 2028	16.503
Zahlt Festzinssatz 3,24 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	495.000	SGD	20. Dez. 2028	3.221
Erhält Festzinssatz 4,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7.451.000	PLN	20. Dez. 2025	(2.695)
Erhält Festzinssatz 4,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	22.249.000	PLN	20. Dez. 2025	(13.158)
Zahlt Festzinssatz 4,31 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	5.398.000	GBP	20. Mrz. 2034	(6.682)
Erhält Festzinssatz 3,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	8.691.000	MYR	20. Mrz. 2029	(11.117)
Erhält Festzinssatz 3,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	12.927.000	CAD	20. Mrz. 2034	(284.318)
Erhält Festzinssatz 4,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	8.159.000	CAD	20. Mrz. 2025	(12.015)
Zahlt Festzinssatz 4,56 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD CORRA 1 Day	Morgan Stanley	24.029.000	CAD	20. Mrz. 2026	87.568
Zahlt Festzinssatz 7,99 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	178.074.000	ZAR	20. Mrz. 2026	80.505
Zahlt Festzinssatz 8,54 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	155.722.000	ZAR	20. Mrz. 2029	164.440
Zahlt Festzinssatz 6,54 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	113.431.000	HUF	20. Mrz. 2034	7.362
Zahlt Festzinssatz 6,47 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	165.967.000	HUF	20. Mrz. 2034	12.797
Zahlt Festzinssatz 6,50 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	284.108.000	HUF	20. Mrz. 2034	20.573
Erhält Festzinssatz 7,30 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	768.940.000	HUF	20. Mrz. 2026	(10.465)
Erhält Festzinssatz 6,44 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.389.309.000	HUF	20. Mrz. 2029	(57.462)
Erhält Festzinssatz 4,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	20.625.000	NOK	20. Mrz. 2034	(5.999)
Zahlt Festzinssatz 4,69 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	412.419.000	NOK	20. Mrz. 2026	(108.677)
Zahlt Festzinssatz 3,94 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	313.588.000	NOK	18. Mrz. 2029	25.650
Erhält Festzinssatz 4,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	198.160.000	NOK	20. Mrz. 2029	29.508

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 4,25 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	21.912.000	AUD	20. Mrz. 2029	124.410
Erhält Festzinssatz 3,98 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.100.000	PLN	20. Dez. 2025	(6.849)
Erhält Festzinssatz 3,90 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.794.000	PLN	20. Dez. 2025	(7.940)
Erhält Festzinssatz 3,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10.506.000	PLN	20. Dez. 2025	(18.496)
Zahlt Festzinssatz 3,86 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	9.667.000	MYR	18. Mrz. 2029	10.033
Erhält Festzinssatz 2,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	27.009.000	CNY	20. Mrz. 2026	(2.063)
Erhält Festzinssatz 2,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	42.071.000	CNY	18. Mrz. 2029	(9.064)
Erhält Festzinssatz 9,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	41.245.000	MXN	26. Aug. 2033	(68.979)
Zahlt Festzinssatz 11,28 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	337.554.000	ZAR	21. Mrz. 2034	179.918
Erhält Festzinssatz 9,61 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	148.530.000	ZAR	20. Mrz. 2034	(218.249)
Erhält Festzinssatz 9,61 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	87.231.000	ZAR	20. Mrz. 2034	(127.324)
Zahlt Festzinssatz 4,91 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4.226.000	USD	20. Mrz. 2025	8.471
Zahlt Festzinssatz 4,38 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	44.220.000	USD	20. Mrz. 2026	190.403
Zahlt Festzinssatz 3,97 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	19.110.000	USD	20. Mrz. 2029	223.414
Erhält Festzinssatz 3,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	11.624.000	USD	20. Mrz. 2034	(312.187)
Erhält Festzinssatz 4,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.811.000	CZK	20. Mrz. 2029	(6.047)
Zahlt Festzinssatz 4,16 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	27.389.000	CZK	20. Mrz. 2034	23.655
Zahlt Festzinssatz 3,81 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3.901.000	USD	19. Mrz. 2026	8.933
Zahlt Festzinssatz 3,78 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	120.978.000	SEK	20. Mrz. 2026	(9.124)
Zahlt Festzinssatz 3,25 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	115.091.000	SEK	20. Mrz. 2034	97.101
Erhält Festzinssatz 0,91 %					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	42.772.000	JPY	20. Mrz. 2034	(2.479)
Zahlt Festzinssatz 1,31 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	53.475.000	JPY	21. Mrz. 2034	1.321
Erhält Festzinssatz 3,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	708.534.000	KRW	18. Mrz. 2029	(1.825)
Erhält Festzinssatz 3,29 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	9.955.000	SGD	20. Mrz. 2026	(24.825)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 3,21 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	4.491.000	SGD	20. Mrz. 2029	31.145
Zahlt Festzinssatz 3,22 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	125.000	SGD	20. Mrz. 2034	1.491
Erhält Festzinssatz 4,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	38.487.000	AUD	20. Mrz. 2034	(458.787)
Zahlt Festzinssatz 4,06 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	42.390.000	AUD	20. Mrz. 2026	89.829
Zahlt Festzinssatz 3,78 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.256.000	EUR	20. Mrz. 2025	3.820
Zahlt Festzinssatz 3,41 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	48.851.000	EUR	20. Mrz. 2026	49.233
Erhält Festzinssatz 3,09 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.684.000	EUR	21. Mrz. 2034	(22.839)
Erhält Festzinssatz 10,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	22.564.891.000	COP	20. Dez. 2024	(19.233)
Erhält Festzinssatz 4,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	12.265.000	ILS	21. Mrz. 2034	(42.054)
Zahlt Festzinssatz 3,93 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.802.000	ILS	20. Mrz. 2034	30.556
Zahlt Festzinssatz 5,12 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.674.490.000	CLP	20. Mrz. 2034	160.869
Erhält Festzinssatz 6,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	7.564.357.000	CLP	20. Dez. 2024	(34.678)
Erhält Festzinssatz 4,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.286.871.000	CLP	20. Mrz. 2029	(97.295)
Erhält Festzinssatz 3,99 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.342.000	PLN	20. Dez. 2028	(29.057)
Zahlt Festzinssatz 8,74 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	406.081.000	MXN	14. Mrz. 2029	500.255
Zahlt Festzinssatz 8,86 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18.873.000	MXN	15. Mrz. 2034	12.546
Erhält Festzinssatz 8,83 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	135.334.000	MXN	08. Mrz. 2034	(242.419)
Zahlt Festzinssatz 10,76 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	128.834.000	MXN	18. Dez. 2024	25.683
Zahlt Festzinssatz 9,18 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	204.773.000	MXN	17. Dez. 2025	37.245
Erhält Festzinssatz 9,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	93.339.000	MXN	17. Dez. 2025	(47.693)
Zahlt Festzinssatz 4,49 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.235.000	PLN	20. Dez. 2033	35.139
Erhält Festzinssatz 4,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.695.000	CZK	20. Dez. 2028	(9.720)
Erhält Festzinssatz 3,92 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	88.086.000	PLN	20. Mrz. 2026	(61.254)
Erhält Festzinssatz 5,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	25.223.000	PLN	21. Mrz. 2034	(67.698)

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 9,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20.915.000	MXN	31. Aug. 2033	(15.894)
Zahlt Festzinssatz 9,38 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	69.200.000	MXN	06. Sep. 2028	34.822
Zahlt Festzinssatz 3,29 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	1.248.000	SGD	20. Dez. 2028	6.083
Erhält Festzinssatz 9,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20.725.000	MXN	01. Sep. 2033	(35.101)
Erhält Festzinssatz 4,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10.964.000	PLN	20. Dez. 2028	(26.655)
Zahlt Festzinssatz 5,19 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.805.195.000	CLP	20. Dez. 2033	62.547
Erhält Festzinssatz 5,25 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	8.834.240.000	CLP	20. Dez. 2026	(135.837)
Zahlt Festzinssatz 4,84 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	10.798.000	NZD	20. Dez. 2028	80.087
Zahlt Festzinssatz 4,63 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.717.000	NZD	20. Dez. 2033	71.764
Erhält Festzinssatz 5,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5.945.000	NZD	18. Dez. 2025	(9.150)
Erhält Festzinssatz 4,75 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.224.000	NZD	20. Dez. 2033	(20.661)
Zahlt Festzinssatz 3,41 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	1.477.000	SGD	20. Dez. 2028	1.118
Zahlt Festzinssatz 6,56 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	240.751.000	HUF	20. Dez. 2033	22.407
Zahlt Festzinssatz 6,56 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	140.549.000	HUF	20. Dez. 2033	12.981
Erhält Festzinssatz 6,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	431.661.000	HUF	20. Dez. 2028	(28.777)
Erhält Festzinssatz 6,53 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	247.199.000	HUF	20. Dez. 2028	(16.480)
Erhält Festzinssatz 6,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	156.708.000	HUF	20. Dez. 2033	(1.588)
Erhält Festzinssatz 4,88 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4.105.000	USD	20. Dez. 2025	7.738
Zahlt Festzinssatz 4,28 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3.470.000	USD	20. Dez. 2028	(639)
Zahlt Festzinssatz 8,73 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	BNP Paribas	18.097.210.000	HUF	25. Jun. 2024	60.801
Erhält Festzinssatz 6,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	839.697.000	HUF	20. Dez. 2033	(11.245)
Erhält Festzinssatz 4,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	39.765.000	CZK	20. Dez. 2028	(14.259)
Zahlt Festzinssatz 4,41 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7.650.000	PLN	20. Dez. 2028	4.518
Zahlt Festzinssatz 3,79 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.487.625.000	KRW	20. Dez. 2033	2.794

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 3,85 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	5.970.000.000	KRW	20. Dez. 2025	(1.482)
Erhält Festzinssatz 9,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	35.702.000	ZAR	20. Dez. 2033	(15.598)
Erhält Festzinssatz 9,83 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	21.198.000	ZAR	20. Dez. 2033	(9.969)
Zahlt Festzinssatz 8,80 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32.816.000	ZAR	20. Dez. 2028	12.004
Zahlt Festzinssatz 8,91 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32.224.000	ZAR	20. Dez. 2028	3.947
Erhält Festzinssatz 9,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20.919.000	ZAR	20. Dez. 2033	(2.574)
Erhält Festzinssatz 9,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20.962.000	ZAR	20. Dez. 2033	(2.720)
Zahlt Festzinssatz 8,91 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32.379.000	ZAR	20. Dez. 2028	4.101
Zahlt Festzinssatz 3,97 %					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6.881.000	USD	18. Dez. 2034	56.630
Erhält Festzinssatz 5,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5.115.000	NZD	20. Dez. 2025	(2.939)
Erhält Festzinssatz 8,17 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.474.758.000	HUF	20. Dez. 2025	(11.387)
Erhält Festzinssatz 4,27 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.862.000	ILS	20. Dez. 2028	(914)
Zahlt Festzinssatz 5,10 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	54.219.000	CZK	20. Dez. 2025	(3.850)
Zahlt Festzinssatz 3,44 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	3.195.000	EUR	20. Dez. 2028	(22.721)
Erhält Festzinssatz 9,73 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	44.926.000	MXN	07. Dez. 2033	50.993
Erhält Festzinssatz 9,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	44.927.000	MXN	07. Dez. 2033	46.159
Erhält Festzinssatz 9,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	22.463.000	MXN	07. Dez. 2033	15.626
Erhält Festzinssatz 6,98 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	870.347.000	HUF	20. Dez. 2033	4.082
Erhält Festzinssatz 7,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	419.282.000	HUF	20. Dez. 2033	4.288
Erhält Festzinssatz 9,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	22.463.000	MXN	07. Dez. 2033	7.568
Erhält Festzinssatz 9,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	22.463.000	MXN	07. Dez. 2033	7.568
Zahlt Festzinssatz 11,25 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	89.860.000	MXN	18. Dez. 2024	(6.432)
Erhält Festzinssatz 10,52 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	45.521.000	MXN	17. Dez. 2025	7.153

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 9,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	42.185.000	MXN	16. Sep. 2033	18.040
Erhält Festzinssatz 9,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	22.463.000	MXN	07. Dez. 2033	6.762
Erhält Festzinssatz 5,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	18.947.000	GBP	20. Dez. 2025	11.626
Erhält Festzinssatz 5,61 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.534.000	PLN	20. Dez. 2033	(2.481)
				USD	(614.430)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

Zum 30. September 2023 bestand das folgende Risiko bei in Bezug auf Derivatkontrakte einzufordernden Sicherheiten je Kontrahent:

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*				
	UBS	Barmittel	AUD	10.000
			USD	6.430
Schroder GAIA BlueTrend				
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	2.694.217
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	93.478.379
	J.P. Morgan	Barmittel	MXN	20.430.039
	J.P. Morgan	Barmittel	SEK	19.044.543
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	44.321.061
			USD	50.710.454
Schroder GAIA Egerton Equity				
	HSBC	Barmittel	EUR	3.290.000
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	3
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	3.520.941
			EUR	6.810.943
Schroder GAIA Helix				
	Barclays Bank	Barmittel	USD	710.000
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	3.093.346
	Goldman Sachs	Barmittel	GBP	4.705.250
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	2.655.432
	J.P. Morgan	Barmittel	AUD	267.417
	J.P. Morgan	Barmittel	CAD	13.484
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	7.393.563
	J.P. Morgan	Barmittel	GBP	162.624
	J.P. Morgan	Barmittel	HKD	2.685.884
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	594.153.183
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	24.444.596
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	90.000
			USD	49.427.316
Schroder GAIA Sirios US Equity				
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	2.200.000
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	560.000
			USD	2.760.000

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	Barmittel	EUR	2.669.366
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	214.000
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	1.442.810
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	14.331.697
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	40.625.461
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	310.597
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	4.257.819
	Société Générale	Barmittel	CAD	54
	Société Générale	Barmittel	CHF	15
	Société Générale	Barmittel	CZK	1
	Société Générale	Barmittel	EUR	47
	Société Générale	Barmittel	GBP	3.463.705
	Société Générale	Barmittel	JPY	761.831.712
	Société Générale	Barmittel	MXN	1
	Société Générale	Barmittel	USD	899.680
	Société Générale	Barmittel	ZAR	398.713
				USD
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Barclays Bank	Barmittel	USD	3.760.000
	BNP Paribas	Barmittel	USD	690.000
	Deutsche Bank	Barmittel	USD	350.000
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	1.305.064
	HSBC	Barmittel	USD	490.000
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	764.000
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	294.913
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	44.309
	Morgan Stanley	Barmittel	CZK	130
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	117.695
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	33.279
	Morgan Stanley	Barmittel	HUF	177.010
	Morgan Stanley	Barmittel	ILS	268
	Morgan Stanley	Barmittel	MXN	226.519
	Morgan Stanley	Barmittel	NOK	1.169
	Morgan Stanley	Barmittel	PLN	41.958
	Morgan Stanley	Barmittel	THB	95.588
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	1.560.496
	Morgan Stanley	Barmittel	ZAR	5.170
	UBS	Barmittel	USD	920.000
			USD	10.252.999

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	Provisionen
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	USD	21.666
Schroder GAIA BlueTrend	USD	198.227
Schroder GAIA Cat Bond	USD	21.080
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	516.929

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Ausweis von Transaktionskosten (Forts.)

Teilfonds	Währung	Provisionen
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	247.064
Schroder GAIA Helix	USD	1.122.683
Schroder GAIA Oaktree Credit	USD	-
Schroder GAIA SEG US Equity*	USD	22.057
Schroder GAIA Sirios US Equity	USD	338.262
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return*	GBP	31.963
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	168.375
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	1.210.769

Dividenden

Während des Berichtsjahres haben die folgenden Teilfonds Dividendenausschüttungen vorgenommen:

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
14. Okt. 2022	21. Okt. 2022	28. Okt. 2022	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	474,49	USD	2,934929
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	995,43	SGD	3,892037
11. Nov. 2022	18. Nov. 2022	25. Nov. 2022	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.009,86	USD	6,246428
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2.069,24	SGD	8,089599
09. Dez. 2022	16. Dez. 2022	23. Dez. 2022	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	985,14	USD	6,093138
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2.056,68	SGD	8,038289
29. Dez. 2022	30. Dez. 2022	09. Jan. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF, Aussch.	206.175,84	USD	19,220378
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch.	17,86	USD	1,172043
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in CHF abgesichert	104,27	CHF	1,026639
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in EUR abgesichert	109,72	EUR	1,087351
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in GBP abgesichert	106,85	GBP	1,051469
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch.	19,71	USD	1,290452
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in CHF abgesichert	115,77	CHF	1,137699
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in EUR abgesichert	121,93	EUR	1,206733
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in GBP abgesichert	118,69	GBP	1,165501
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch.	20,63	USD	1,348226
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in CHF abgesichert	119,12	CHF	1,169785
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in EUR abgesichert	125,45	EUR	1,241205
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in GBP abgesichert	122,20	GBP	1,199191
13. Jan. 2023	20. Jan. 2023	27. Jan. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.312,42	USD	8,116879
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2.711,64	SGD	10,595244
10. Feb. 2023	17. Feb. 2023	24. Feb. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.211,32	USD	7,491177
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2.578,76	SGD	10,072484
10. Mrz. 2023	17. Mrz. 2023	24. Mrz. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.145,61	USD	7,084338
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2.436,26	SGD	9,512930
30. Mrz. 2023	31. Mrz. 2023	11. Apr. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF, Aussch.	344.750,77	USD	28,503106
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch.	20,16	USD	1,307328
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in CHF abgesichert	120,07	CHF	1,169563
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in EUR abgesichert	126,00	EUR	1,235247

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Ausschüttungen (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in GBP abgesichert	121,03	GBP	1,178142
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch.	21,99	USD	1,421332
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in CHF abgesichert	132,51	CHF	1,286792
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in EUR abgesichert	139,16	EUR	1,360962
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in GBP abgesichert	133,68	GBP	1,296884
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch.	22,47	USD	1,448996
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in CHF abgesichert	136,30	CHF	1,322120
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in EUR abgesichert	143,13	EUR	1,399021
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in GBP abgesichert	23.340,52	GBP	1,320451
14. Apr. 2023	21. Apr. 2023	28. Apr. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.415,94	USD	8,755496
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2.971,26	SGD	11,597893
12. Mai 2023	19. Mai 2023	26. Mai 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.292,48	USD	7,991583
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2.735,90	SGD	10,675431
09. Jun. 2023	16. Jun. 2023	23. Jun. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.277,48	USD	7,898350
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	2.682,26	SGD	10,462469
29. Jun. 2023	30. Jun. 2023	10. Jul. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF, Aussch.	385.042,63	USD	30,890249
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch.	21,44	USD	1,371519
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in CHF abgesichert	131,26	CHF	1,262809
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in EUR abgesichert	139,77	EUR	1,353716
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in GBP abgesichert	133,88	GBP	1,287427
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch.	23,31	USD	1,484906
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in CHF abgesichert	143,99	CHF	1,379355
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in EUR abgesichert	153,41	EUR	1,480392
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in GBP abgesichert	147,10	GBP	1,408018
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch.	23,54	USD	1,495616
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in CHF abgesichert	148,04	CHF	1,416141
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in EUR abgesichert	157,48	EUR	1,518192
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in GBP abgesichert	28.087,82	GBP	1,441910
14. Jul. 2023	21. Jul. 2023	28. Jul. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.670,00	USD	9,641455
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	3.640,64	SGD	12,563895
11. Aug. 2023	18. Aug. 2023	25. Aug. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.490,40	USD	7,808478
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	3.040,30	SGD	10,488479
08. Sep. 2023	15. Sep. 2023	22. Sep. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1.596,94	USD	7,999915
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD abgesichert	3.093,12	SGD	10,667394
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF, Aussch.	372.898,01	USD	31,902791
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse PI, Aussch.	2.883.251,59	USD	80,858568
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse PI, Aussch., in GBP abgesichert	410.619,58	GBP	8,004205

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Ausschüttungen (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus- schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
28. Sep. 2023	29. Sep. 2023	06. Okt. 2023	Schroder GAIA BlueTrend, Klasse C, Aussch., in GBP abgesichert	31.258,65	GBP	0,977911
			Schroder GAIA BlueTrend, Klasse E, Aussch., in GBP abgesichert	122.254,42	GBP	1,018715
			Schroder GAIA Helix, Klasse S, Aussch.	1.013,72	USD	8,064603
			Schroder GAIA Helix, Klasse S, Aussch., in EUR abgesichert	722,58	EUR	7,506553
			Schroder GAIA Helix, Klasse S, Aussch., in GBP abgesichert	17.668,30	GBP	7,843513
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch.	24,18	USD	1,525340
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in CHF abgesichert	155,57	CHF	1,476841
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in EUR abgesichert	165,64	EUR	1,582994
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in GBP abgesichert	162,22	GBP	1,539421
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch.	26,21	USD	1,644311
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in CHF abgesichert	169,56	CHF	1,600691
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in EUR abgesichert	180,51	EUR	1,716643
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in GBP abgesichert	176,89	GBP	1,668780
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch.	26,34	USD	1,648202
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in CHF abgesichert	173,79	CHF	1,637674
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in EUR abgesichert	184,98	EUR	1,756720
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in GBP abgesichert	31.324,89	GBP	1,702888

Gegenseitige Anlagen der Teilfonds

Zum 30. September 2023 belaufen sich die gegenseitigen Anlagen der Teilfonds auf insgesamt 10.041.145 EUR, daher würde der kombinierte Gesamt-NIW am Jahresende ohne gegenseitige Anlagen 4.920.504.270 EUR betragen. Die Einzelheiten zu den gegenseitigen Anlagen der Teilfonds sind in der folgenden Tabelle angegeben:

Anlage	Währung des Teilfonds	Marktwert	% Nettovermögen
Schroder GAIA Helix			
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*		10.616.000	3,58
	USD	10.616.000	3,58

Wechselkurs

Der folgende Wechselkurs wurde für die Berechnung des im Abschluss zum 30. September 2023 in EUR ausgewiesenen Gesamtbetrags verwendet:

1 Euro = 0,94585 US-Dollar

1 Euro = 1,15403 Pfund Sterling

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Zum Zeitpunkt der Genehmigung des Abschlusses waren keine wesentlichen Ereignisse nach dem Bilanzstichtag eingetreten.

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse

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.	13	0,84 %
Klasse C Thes.	15	0,96 %
Klasse I Thes.	n. z.#	n. z.#
Klasse IZ Thes.	15	0,99 %

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA BlueTrend		
Klasse A Thes.	20	0,00 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes.	99	0,00 %
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	114	0,00 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	23	0,00 %
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes.	0	0,00 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00 %
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	209	0,00 %

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
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 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.#
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	128.370	0,50 %
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	265.721	0,70 %
Klasse PI Aussch.	457.402	0,97 %
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	76.419	0,90 %
Klasse Y Thes.	n. z.#	n. z.#

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)		
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.#

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Contour Tech Equity		
Klasse A Thes.	0	0,00 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	0	0,00 %
Klasse A1 Thes.	0	0,00 %
Klasse C Thes.	0	0,00 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes.	0	0,00 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	0	0,00 %

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Egerton Equity		
Klasse A Thes.	0	0,00 %
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in USD abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Aussch. GBP	0	0,00 %
Klasse A1 Thes.	0	0,00 %
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes.	0	0,00 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in USD abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Aussch.	0	0,00 %
Klasse C Aussch. GBP	0	0,00 %
Klasse E Thes.	0	0,00 %
Klasse X Thes.	0	0,00 %

Teilfonds und Anteilsklassen	Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse in Fondswährung	Prozentualer Anteil der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Helix		
Klasse A Thes.	0	0,00 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes.	0	0,00 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %

Für die Anteilsklasse wird keine Performancegebühr erhoben.

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 30. September 2023 (Forts.)

Berechnete Performancegebühren je Anteilsklasse (Forts.)

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 Helix (Forts.)			Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)		
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes.	418.849	0,81 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	11.570	0,42 %
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	128.487	0,55 %
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	34.776	0,55 %
Klasse C1 Thes.	0	0,00 %	Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	65	0,21 %
Klasse E Thes.	0	0,00 %	Klasse E Thes.	713	0,65 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	4.054	0,30 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse X Thes.	15	0,89 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse X Thes., in EUR abgesichert	48	0,43 %
Klasse I Thes.	n. z. [#]	n. z. [#]	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund*		
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	n. z. [#]	n. z. [#]	Klasse C Thes.	0	0,00 %
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse S Aussch.	0	0,00 %	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in USD abgesichert	0	0,00 %
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse I Thes.	n. z. [#]	n. z. [#]
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Schroder GAIA SEG US Equity*			Klasse K Thes., in USD abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes.	0	0,00 %	Klasse R Thes.	0	0,00 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse R Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse R Thes., in USD abgesichert	0	0,00 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
Klasse IZ Thes.	32	0,00 %	Klasse C Thes.	2.229.443	0,93 %
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	632.889	0,63 %
Klasse K Thes.	0	0,00 %	Klasse K Thes.	375.787	0,66 %
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse K Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Schroder GAIA Wellington Pagosa		
Klasse R1 Thes.	0	0,00 %	Klasse A Thes.	0	0,00 %
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse R2 Thes.	0	0,00 %	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	464	0,00 %
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse A Thes., in SGD abgesichert	22	0,00 %
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes.	14.550	0,01 %
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in BRL abgesichert	567	0,00 %
Klasse R3 Thes.	0	0,00 %	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	367	0,00 %
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	2.331	0,00 %
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	285	0,00 %
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	1	0,00 %
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	0	0,00 %	Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00 %	Klasse E Thes.	50	0,00 %
Schroder GAIA Sirios US Equity			Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %
Klasse A Thes.	477.988	0,53 %	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	917	0,01 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00 %	Klasse E Thes., in GBP abgesichert	219	0,00 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	12.705	0,10 %			

Für den Schroder GAIA Oaktree Credit wird keine Performancegebühr erhoben.

Für die Anteilsklasse wird keine Performancegebühr erhoben.

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

Gesamtkostenquote („TER“)

für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	
Klasse A Thes.	2,30 %
Klasse C Thes.	1,56 %
Klasse I Thes.	0,14 %
Klasse IZ Thes.	1,27 %
Schroder GAIA BlueTrend	
Klasse A Thes.	2,00 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,03 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,03 %
Klasse C Thes.	1,40 %
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,43 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,43 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,43 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,43 %
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,43 %
Klasse E Thes.	1,40 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,43 %
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	1,43 %
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	1,43 %
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	1,42 %
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	1,45 %
Schroder GAIA Cat Bond	
Klasse A Thes.	1,77 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	1,82 %
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	1,81 %
Klasse C Thes.	1,37 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,40 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,41 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,41 %
Klasse F Thes.	1,72 %
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	1,73 %
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	1,73 %
Klasse F Aussch.	1,72 %
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	1,73 %
Klasse I Thes.	0,14 %
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	0,15 %
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	0,13 %
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,16 %
Klasse IF Thes.	1,32 %
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	1,33 %
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	1,33 %
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	1,33 %
Klasse IF Aussch.	1,32 %
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	0,61 %
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	0,61 %
Klasse PI Aussch.	0,60 %
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	0,61 %

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)	
Klasse Y Thes.	1,07 %
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	1,10 %
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	1,10 %
Klasse Y1 Thes.	1,48 %
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	1,52 %
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	1,52 %
Klasse Y2 Thes.	0,42 %
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	0,45 %
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	0,45 %
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	0,44 %
Schroder GAIA Contour Tech Equity	
Klasse A Thes.	2,42 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,45 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,45 %
Klasse A1 Thes.	2,92 %
Klasse C Thes.	1,67 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,70 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,70 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,70 %
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	1,70 %
Klasse E Thes.	1,42 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,46 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,45 %
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	1,44 %
Schroder GAIA Egerton Equity	
Klasse A Thes.	2,42 %
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	2,45 %
Klasse A Thes., in USD abgesichert	2,45 %
Klasse A Aussch. GBP	2,43 %
Klasse A1 Thes.	2,92 %
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	2,96 %
Klasse C Thes.	1,67 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,69 %
Klasse C Thes., in USD abgesichert	1,70 %
Klasse C Aussch.	1,68 %
Klasse C Aussch. GBP	1,67 %
Klasse E Thes.	1,68 %
Klasse X Thes.	1,57 %
Schroder GAIA Helix	
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 SEK abgesichert	2,43 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,46 %
Klasse C Thes.	1,38 %

* Für nähere Angaben zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. Beachten Sie bitte, dass die Transaktionskosten – wie in den Anmerkungen zum Abschluss angegeben – sowie Transaktionskosten in Verbindung mit dem zugrunde liegenden Portfolio strukturierter Produkte nicht in der oben aufgeführten TER berücksichtigt werden.

Gesamtkostenquote („TER“)

für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Helix (Forts.)	
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,41 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,40 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,41 %
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	1,06 %
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	1,40 %
Klasse C1 Thes.	1,29 %
Klasse E Thes.	1,00 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0,97 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0,98 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0,99 %
Klasse I Thes.	0,15 %
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,15 %
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	1,15 %
Klasse S Aussch.	0,55 %
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0,58 %
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0,58 %
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0,78 %

Schroder GAIA Oaktree Credit	
Klasse A2 Thes.	1,36 %
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	1,58 %
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	1,58 %
Klasse A2 Aussch.	1,38 %
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	1,58 %
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	1,59 %
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	1,57 %
Klasse C Thes.	1,05 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,08 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,08 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,07 %
Klasse C Aussch.	0,90 %
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	1,08 %
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	1,08 %
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,06 %
Klasse E Thes.	0,90 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0,93 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0,93 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0,92 %
Klasse E Aussch.	0,80 %
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	0,93 %
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	0,93 %
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	0,93 %
Klasse I Thes.	0,14 %

Schroder GAIA SEG US Equity*	
Klasse C Thes.	1,52 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,79 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,84 %

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA SEG US Equity* (Forts.)	
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,82 %
Klasse IZ Thes.	1,41 %
Klasse IZ Thes., in CHF abgesichert	1,46 %
Klasse IZ Thes., in EUR abgesichert	1,43 %
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	1,42 %
Klasse K Thes.	1,99 %
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	2,24 %
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	2,23 %
Klasse K Thes., in GBP abgesichert	2,21 %
Klasse R1 Thes.	2,04 %
Klasse R1 Thes., in EUR abgesichert	2,06 %
Klasse R2 Thes.	1,43 %
Klasse R2 Thes., in CHF abgesichert	1,46 %
Klasse R2 Thes., in EUR abgesichert	1,47 %
Klasse R2 Thes., in GBP abgesichert	1,47 %
Klasse R3 Thes.	1,68 %
Klasse R3 Thes., in CHF abgesichert	1,72 %
Klasse R3 Thes., in EUR abgesichert	1,71 %
Klasse R3 Thes., in GBP abgesichert	1,72 %
Klasse R4 Thes., in GBP abgesichert	2,62 %
Klasse R5 Thes., in EUR abgesichert	1,46 %

Schroder GAIA Sirios US Equity	
Klasse A Thes.	2,42 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,45 %
Klasse C Thes.	1,68 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,70 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,70 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,70 %
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,71 %
Klasse E Thes.	1,36 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,40 %
Klasse X Thes.	1,53 %
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	1,60 %

Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund*	
Klasse C Thes.	1,12 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,15 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,14 %
Klasse C Thes., in USD abgesichert	1,14 %
Klasse I Thes.	0,05 %
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	1,67 %
Klasse K Thes., in USD abgesichert	1,67 %
Klasse R Thes.	1,12 %
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	1,15 %
Klasse R Thes., in USD abgesichert	1,15 %

* Für nähere Angaben zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtsjahres vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. Beachten Sie bitte, dass die Transaktionskosten – wie in den Anmerkungen zum Abschluss angegeben – sowie Transaktionskosten in Verbindung mit dem zugrunde liegenden Portfolio strukturierter Produkte nicht in der oben aufgeführten TER berücksichtigt werden.

Gesamtkostenquote („TER“) für das Geschäftsjahr zum 30. September 2023 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	
Klasse C Thes.	1,81 %
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,85 %
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,84 %
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,83 %
Klasse K Thes.	2,32 %
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	2,35 %
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	2,35 %
Schroder GAIA Wellington Pagosa	
Klasse A Thes.	2,43 %
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,46 %
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,46 %
Klasse C Thes.	1,67 %
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	1,71 %
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	1,70 %
Klasse E Thes.	1,18 %
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,21 %
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,21 %
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	1,21 %

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

Anhang I – OGAW-Angaben (ungeprüft)

1. Commitment-Ansatz

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

Teilfonds

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

2. Absoluter VaR-Ansatz

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

Teilfonds

Schroder GAIA 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 Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund*
Schroder GAIA Wellington Pagosa

Ausschöpfung des regulatorischen VaR-Limits

Teilfonds	Niedrigstes	Höchstes	Durchschnitt	Durchschnittliche Hebelung
Schroder GAIA Asian Equity Long Short*	11,70 %	19,00 %	15,63 %	225,42 %
Schroder GAIA BlueTrend	13,04 %	62,62 %	34,21 %	1280,95 %
Schroder GAIA Contour Tech Equity	23,36 %	45,74 %	34,45 %	118,70 %
Schroder GAIA Egerton Equity	30,65 %	50,69 %	41,96 %	142,77 %
Schroder GAIA Helix	9,00 %	15,97 %	12,48 %	705,63 %
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	16,93 %	28,95 %	23,23 %	538,49 %
Schroder GAIA SEG US Equity*	34,52 %	51,37 %	45,14 %	125,34 %
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund*	7,87 %	17,78 %	13,52 %	111,52 %
Schroder GAIA Wellington Pagosa	6,13 %	14,20 %	9,01 %	857,44 %

Angaben zum VaR-Modell

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

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

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

OGAW-Vergütungsangaben für die Schroder Investment Management Europe S.A. („SIM Europe“) für das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022

Diese Angaben sind Bestandteil des ungeprüften Teils dieses Jahresberichts und Abschlusses und sollten in Verbindung mit dem Vergütungsbericht der Schroders plc auf den Seiten 76 bis 107 des Jahresberichts und Abschlusses für 2022 (verfügbar auf der Website der Gruppe – <https://www.schroders.com/en/investor-relations/results-and-reports/annual-report-and-accounts-2022/>) 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 Vergütungsrichtlinie, die Prüfung ihrer allgemeinen Grundsätze mindestens einmal jährlich, und für die Beaufsichtigung ihrer Umsetzung und für die Sicherstellung der Einhaltung der maßgeblichen lokalen Rechtsvorschriften verantwortlich. Die Vergütungspolitik wurde im Jahr 2022 überprüft, um sicherzustellen, dass sie mit den OGAW/AIFMD-Vergütungsanforderungen konform ist, und es wurden keine erheblichen Änderungen vorgenommen.

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

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

Die nachstehenden Vergütungsdaten spiegeln die im Jahr 2022 gezahlten leistungsabhängigen Vergütungen wider.

- Der Gesamtbetrag der von der SIM Europe an ihre 326 Mitarbeiter gezahlten Vergütung belief sich auf 60,53 Mio. EUR, wovon 37,29 Mio. EUR auf Festvergütungen (z. B. Gehälter, Sachleistungen) und 23,24 Mio. EUR auf variable Vergütungen (z. B. Jahresbonuszahlungen oder aufgeschobene Bonuszahlungen) entfielen. Mitarbeiter anderer Unternehmen der Schroders-Gruppe, die im Verwaltungsrat der SIM Europe sitzen, erhalten für ihre Rolle als Verwaltungsratsmitglieder der SIM Europe keine zusätzliche Vergütung.
- Die nachstehenden Angaben beziehen sich auf OGAW-MRTs der SIM Europe. Die meisten dieser OGAW-MRTs waren bei anderen Unternehmen der Schroders-Gruppe beschäftigt. Dazu gehören auch Anlageverwaltungsdienste oder andere Aufgaben, die von der SIM Europe an andere Unternehmen der Schroders-Gruppe oder Dritte übertragen wurden. Viele dieser OGAW-MRTs erbringen Leistungen für andere Unternehmen der Schroders-Gruppe und andere Kunden. Im Interesse der Transparenz spiegeln die nachstehenden Gesamtvergütungszahlen die vollständige Vergütung für jeden OGAW-MRT der SIM Europe wider. Die an die 224 OGAW-MRTs der SIM Europe in Bezug auf das Geschäftsjahr zum 31. Dezember 2022 gezahlte und der SIM Europe oder den von ihr verwalteten OGAW-Fonds zugerechnete Gesamtvergütung beträgt 185,04 Mio. EUR, wovon 43,86 Mio. EUR an Mitglieder der oberen Führungsebene, 132,29 Mio. EUR an MRTs, die Risiken für die SIM Europe oder die von ihr verwalteten OGAW-Fonds übernehmen, und 8,89 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 2023 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
7.498.620	1,82 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
8.365.595	2,04 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt EUR	% des verwalteten Vermögens
15.864.215	3,86 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2023 wurden keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen EUR
Goldman Sachs	5.367.989
Morgan Stanley	5.218.125
J.P. Morgan	3.592.181
Merrill Lynch	1.685.920
	15.864.215

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert EUR
Barmittel	3.520.941
	3.520.941

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert EUR
Weniger als 1 Tag	3.520.941
1 bis 7 Tage	–
1 bis 4 Wochen	–
1 bis 3 Monate	–
3 bis 12 Monate	–
Mehr als 1 Jahr	–
Unbegrenzte Laufzeit	–
	3.520.941

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert EUR
EUR	3.520.941
	3.520.941

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	-	161.620	161.620
1 bis 3 Monate	-	627.098	627.098
3 bis 12 Monate	5.109.799	2.503.538	7.613.337
Mehr als 1 Jahr	2.388.821	5.073.339	7.462.160
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	7.498.620	8.365.595	15.864.215

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert EUR
Morgan Stanley	3.520.941
	3.520.941

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	25.102.046
Gepoolt	-
Sonstige	-
	25.102.046

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

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

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Rendite und Kosten

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“, „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 Teilfondswährung
An den Teilfonds	48.865.498

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
56.626	0,02 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
9.485.612	3,20 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
9.542.238	3,22 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
J.P. Morgan	4.538.119
Goldman Sachs	3.716.881
Morgan Stanley	934.106
Barclays Bank	353.132
	9.542.238

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	9.360.000
	9.360.000

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	9.360.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	9.360.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	9.360.000
	9.360.000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	56.626	9.485.612	9.542.238
Mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	56.626	9.485.612	9.542.238

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
J.P. Morgan	8.980.000
Goldman Sachs	380.000
	9.360.000

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Gestellte Sicherheiten

Zum 30. September 2023 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“, „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 Teilfondswährung
An den Teilfonds	108.990.284

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
1.537.709	0,90 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
4.411.914	2,57 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
5.949.623	3,47 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Merrill Lynch	2.847.093
Goldman Sachs	2.688.544
Morgan Stanley	345.693
Barclays Bank	68.293
	5.949.623

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	560.000
	560.000

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	560.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	560.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	560.000
	560.000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	96.505	96.505
1 bis 3 Monate	737.258	1.050.438	1.787.696
3 bis 12 Monate	800.451	2.944.258	3.744.709
Mehr als 1 Jahr	-	320.713	320.713
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	1.537.709	4.411.914	5.949.623

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

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	560.000
	560.000

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

Gestellte Sicherheiten

Zum 30. September 2023 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“, „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 Teilfondswährung
An den Teilfonds	9.803.568

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
4.846.767	1,28 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
-	-
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
4.846.767	1,28 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	4.846.767
	4.846.767

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	1.700.000
	1.700.000

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	1.700.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	1.700.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	1.700.000
	1.700.000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
Weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	4.846.767	-	4.846.767
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	-	-	-
Mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	4.846.767	-	4.846.767

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Morgan Stanley	USA

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	1.700.000
	1.700.000

Gestellte Sicherheiten

Zum 30. September 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

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

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

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“, „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 Teilfondswährung
An den Teilfonds	77.710.587

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
4.718.349	0,97 %
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
7.086.001	1,47 %
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
11.804.350	2,44 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 30. September 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	5.743.491
Goldman Sachs	3.072.330
J.P. Morgan	2.988.529
	11.804.350

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	961.363
	961.363

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Fälligkeit	Marktwert USD
Weniger als 1 Tag	961.363
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
Mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	961.363

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	961.363
	961.363

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	5.461	-	5.461
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	141.859	322.034	463.893
Mehr als 1 Jahr	4.571.029	6.763.967	11.334.996
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	4.718.349	7.086.001	11.804.350

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
J.P. Morgan	487.000
Goldman Sachs	474.363
	961.363

Anhang II – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (ungeprüft) (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (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	521.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	521.000

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“, „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 Teilfondswährung
An den Teilfonds	13.085.021

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

Produkt: 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.

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.

Wurden mit diesem Finanzprodukt nachhaltige Investitionen angestrebt?

Ja

Nein

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: __%

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es einen Anteil von __% an nachhaltigen Investitionen

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

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

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

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

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: __%

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

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



Inwieweit wurden die von diesem 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. Dies bedeutet, dass der gewichtete Durchschnittswert des Fonds auf Basis der zum Monatsende verfügbaren Daten über einen gleitenden Sechsmontatszeitraum bis zum Ende des Referenzzeitraums höher als Null war.

Der Nachhaltigkeitswert wird mit einem von Schroders entwickelten Tool gemessen, das eine Schätzung der Nettoauswirkungen liefert, die ein Transaktionssponsor in Form von sozialen und ökologischen „Kosten“ oder „Nutzen“ verursachen kann. Dazu werden bestimmte Indikatoren in Bezug auf diesen Sponsor verwendet und diese positiv und negativ quantifiziert, um eine fiktive Gesamtkennzahl der Auswirkung zu ermitteln, die der jeweilige zugrunde liegende Sponsor möglicherweise auf die Gesellschaft und die Umwelt hat. Dabei werden sowohl Daten Dritter als auch eigene Schätzungen und Annahmen von Schroders verwendet, und das Ergebnis kann von anderen Nachhaltigkeits-Tools und -Maßstäben abweichen. Beispiele für solche Indikatoren sind Treibhausgasemissionen, Wasserverbrauch und Löhne im Vergleich zum existenzsichernden Lohn.

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

Der Referenzzeitraum für diesen Fonds ist der Zeitraum zwischen 1. Oktober 2022 und 30. September 2023.

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 0,9 %.

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

Der Nachhaltigkeitswert wird wie vorstehend beschrieben als fiktiver Prozentsatz berechnet.

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

- **Finanzielle Inklusion:** geschätzter gesellschaftlicher Nutzen aus der Erbringung von Finanzdienstleistungen für die lokale Bevölkerung. Zuweisung im Verhältnis zum Marktanteil des Unternehmens am weltweiten Umsatz;
- **Hohe 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;
- **Infrastruktur:** geschätzter gesellschaftlicher Nutzen von Infrastrukturinvestitionen. Berechnung nach den Infrastrukturausgaben eines Landes anhand von Daten über Bruttoinvestitionen;- **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 Teilsektors; und
- **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 Teilsektors; und
- **Soziale und politische Stabilität:** geschätzter gesellschaftlicher Nutzen von politischer und sozialer Stabilität eines Landes, indem ein günstiges Umfeld für Unternehmen, ein attraktives Investitionsklima und damit die Voraussetzungen für langfristiges Wirtschaftswachstum geschaffen werden.

Der Anlageverwalter überwachte die Einhaltung des Merkmals, einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert aufrechtzuerhalten, anhand des gewichteten Durchschnitts des Nachhaltigkeitswerts des Fonds in dem proprietären Tool von Schroders über einen gleitenden Sechsmonatszeitraum zum Ende des Referenzzeitraums, basierend auf den Daten zum Monatsende. Der Gesamtnachhaltigkeitswert fasst die Auswirkung von Nachhaltigkeitsindikatoren zusammen, insbesondere Treibhausgasemissionen, Wassernutzung und Vergütungen verglichen mit dem Existenzminimum.

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

• ... und im Vergleich zu vorangegangenen Zeiträumen?

Nachhaltigkeitswert

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

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

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

- **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?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

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.

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 beigefügt.

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

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



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

Wie in 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

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

Finanzinstrumente handelt, die Katastrophenrisiken ausgesetzt sind, kann 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 sind die Hauptinvestitionen dieses Finanzprodukts?

Die 15 wichtigsten Investitionen im Bezugszeitraum waren:

Die Liste umfasst die folgenden Investitionen, auf die **der größte Anteil der im Referenzzeitraum** getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: **1. Okt. 2022 bis 30. Sep. 2023**

Größte Investitionen	Sektor	In % der Vermö-genswerte	Land
VOUSSOIRRE_JULY_2022_SIDE CAR	Finanzwesen	1,74	Bermuda
URSA RE II LIMITED FRN 144A 9.3859% 07 Dec 2023	Finanzwesen	1,71	Bermuda
NAKAMA RE LTD 1 FRN 144A 7.4829% 13 Oct 2026	Finanzwesen	1,58	Singapur
ALAMO RE LTD A FRN 144A 12.6154% 07 Jun 2024	Finanzwesen	1,48	Bermuda
FLOODSMART RE LTD 19.0129% 01 Mar 2024	Finanzwesen	1,28	Bermuda
MYSTIC RE IV LTD 15.1854% 10 Jan 2028	Finanzwesen	1,19	Bermuda
SUSSEX CAP UK PCC LTD 13.8154% 08 Jan 2025	Finanzwesen	1,18	Vereinigtes Königreich
EVERGLADES RE II LTD 11.3329% 15 May 2028	Finanzwesen	1,11	Bermuda
CAPE LOOKOUT RE LTD 9.1354% 22 Mar 2024	Finanzwesen	0,99	Bermuda
KILIMANJARO III RE LTD A FRN 144A 5.25% 25 Jun 2025	Finanzwesen	0,96	Bermuda
EVERGLADES RE II LTD 11.0929% 15 May 2028	Finanzwesen	0,95	Bermuda
MERNA REINSURANCE II LTD 10.9459% 08 Jul 2024	Finanzwesen	0,94	Bermuda
GALILEO RE LTD 15.3159% 08 Jan 2024	Finanzwesen	0,92	Bermuda
MONA LISA RE LTD 12.4354% 08 Jul 2025	Finanzwesen	0,91	Bermuda
FLOODSMART RE LTD 11.25% 25 Feb 2025	Finanzwesen	0,91	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.

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

Die obige Liste stellt den Durchschnitt der Fondsbeteiligungen 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?

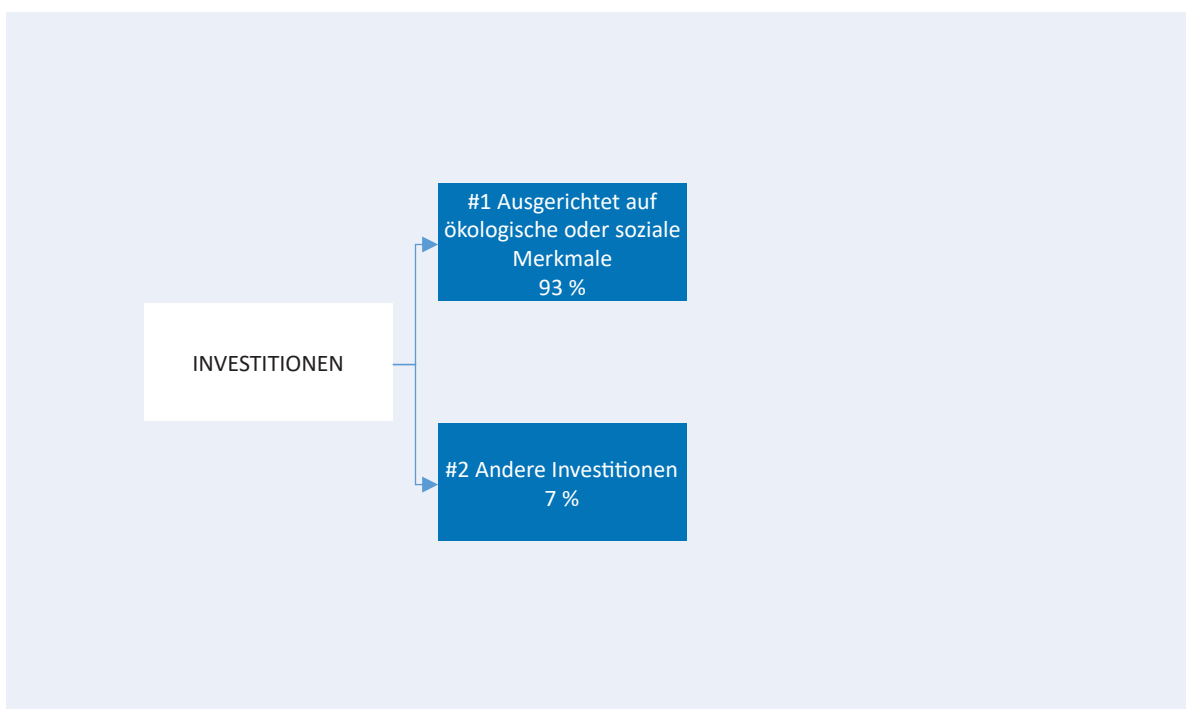
Die Vermögensallokation gibt den jeweiligen Anteil der Investitionen in bestimmte Vermögenswerte an.

• *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 93 %. 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.

#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.



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

• In welchen Wirtschaftssektoren wurden die Investitionen getätigt?

Im Referenzzeitraum wurden Investitionen in folgenden Wirtschaftssektoren getätigt:

Sektor	Teilsektor	In % der Vermögenswerte
Finanzwesen	Versicherung	91,31
Barmittel	Barmittel	6,79
Supranational	Supranational	1,97
Derivate	Devisenderivate	-0,05

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.



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 ermöglichende Tätigkeiten) mit Umweltziel. Die Taxonomie-Konformität der Investitionen dieses Fonds wurde daher nicht berechnet und infolgedessen mit 0 % des Fondsportfolios eingestuft.

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

• 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.

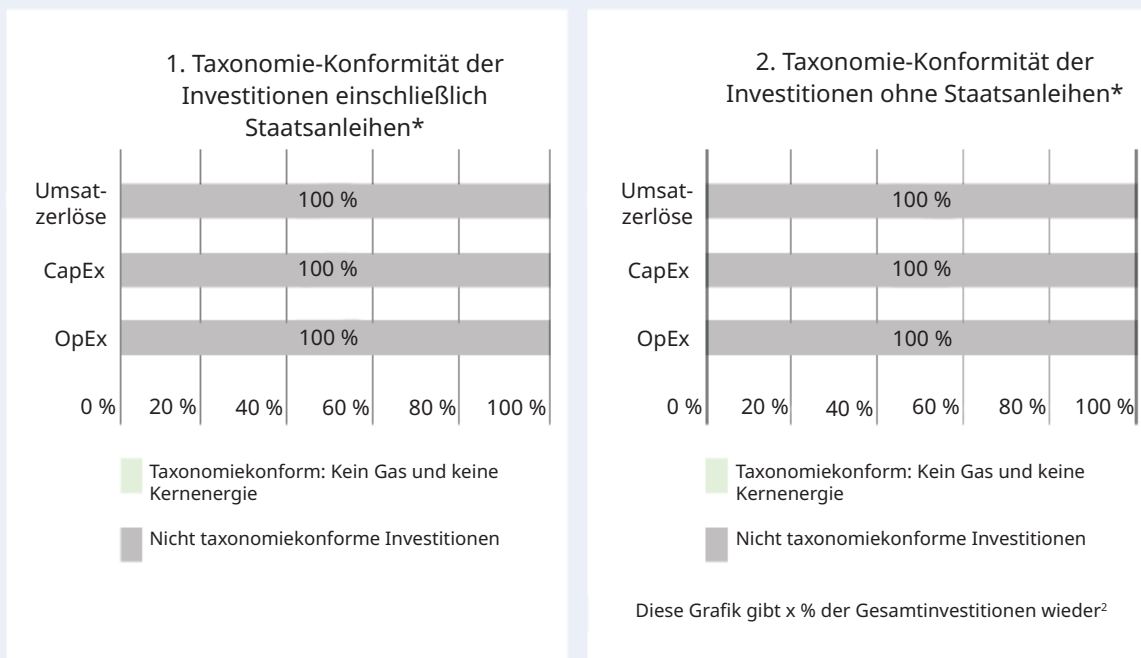
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

- **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.

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 die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



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

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

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.

Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend 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 die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

Wie oben beschrieben, wird der Anteil der Anlagen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden 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 Referenzzeiträumen entwickelt?*

Diese Frage ist nicht relevant.



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.

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



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 Governance-Indikatoren 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 Gegenparteien durch das Kreditrisikoteam von Schroders überprüft, und die Zulassung einer neuen Gegenpartei basierte auf einer ganzheitlichen Prüfung der verschiedenen verfügbaren Informationsquellen, insbesondere zur Qualität des Managements, zur Eigentümerstruktur, zum Standort, zum aufsichtsrechtlichen und gesellschaftlichen Umfeld einer jeden Gegenpartei und zum Entwicklungsgrad des örtlichen Bankensystems und dessen aufsichtsrechtlicher Rahmenbedingungen. Die laufende Überwachung erfolgte über ein proprietäres Tool von Schroders, das die Analyse des Managements ökologischer, sozialer und unternehmensführungsbezogener Trends und Herausforderungen durch die Gegenpartei unterstützt.

Das Kreditrisikoteam von Schroders überwachte die Gegenparteien, und soweit während des Referenzzeitraums 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.



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

Im Referenzzeitraum wurden folgende Maßnahmen ergriffen, um die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale zu 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?

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

Bei den Referenzwerten handelt es sich um Indizes, an denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

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

• **Wie unterschied 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 sich dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Benchmark entwickelt?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

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

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

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

Produkt: 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 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

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem Umweltziel getätigt: __%

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, und obwohl keine nachhaltigen Investitionen angestrebt wurden, enthielt es 61 % an nachhaltigen Investitionen

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

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

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

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

Es wurden damit nachhaltige Investitionen mit einem sozialen Ziel getätigt: __%

mit einem sozialen Ziel

Es wurden damit ökologische/soziale Merkmale beworben, aber keine nachhaltigen Investitionen getätigt

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 28 %. 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.

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



Inwieweit wurden die von diesem 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. Dies bedeutet, dass der gewichtete Durchschnittswert des Fonds auf Basis der zum Monatsende verfügbaren Daten über einen gleitenden Sechsmonatszeitraum bis zum Ende des Referenzzeitraums höher als Null war.

Der Nachhaltigkeitswert wird von einem von Schroders entwickelten Tool gemessen, das eine Schätzung der Netto-„Auswirkungen“ liefert, die ein Emittent in Bezug auf soziale und ökologische „Kosten“ oder „Vorteile“ verursachen könnte. Dazu werden bestimmte Indikatoren in Bezug auf den jeweiligen Emittenten verwendet und diese positiv und negativ quantifiziert, um eine fiktive Gesamtkennzahl der Auswirkung zu ermitteln, die der jeweilige zugrunde liegende Emittent möglicherweise auf die Gesellschaft und die Umwelt haben kann. Dabei werden sowohl Daten Dritter als auch eigene Schätzungen und Annahmen von Schroders verwendet, und das Ergebnis kann von anderen Nachhaltigkeits-Tools und -Maßstäben abweichen. Beispiele für solche Indikatoren sind Treibhausgasemissionen, Wasserverbrauch und Löhne im Vergleich zum existenzsichernden Lohn.

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 ein Emittent pro 100 US-Dollar Umsatz oder BIP einen relativen fiktiven positiven Einfluss (d. h. einen Nutzen für die Gesellschaft) von 2 US-Dollar erbringt. Der Nachhaltigkeitswert des Fonds wird von den Werten aller Emittenten (ggf. einschließlich auf Look-through-Basis bei Indizes und Wertpapierkörben) im Portfolio des Fonds abgeleitet, die mithilfe 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 Referenzzeitraum für diesen Fonds ist der Zeitraum zwischen 1. Oktober 2022 und 30. September 2023.

Der Fonds verwendete Derivate in großem Umfang, um seine Investitionsstrategie 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.

• **Wie haben die Nachhaltigkeitsindikatoren abgeschnitten?**

Der positive absolute Nachhaltigkeitswert für den Referenzzeitraum betrug 9,8 %.

Der Nachhaltigkeitswert wird wie vorstehend beschrieben als fiktiver Prozentsatz 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;

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

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

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

Der Anlageverwalter überwachte die Einhaltung des Merkmals, einen positiven absoluten Nachhaltigkeitswert aufrechtzuerhalten, anhand des gewichteten Durchschnitts des Nachhaltigkeitswerts des Fonds in dem proprietären Tool von Schroders über einen gleitenden Sechsmonatszeitraum zum Ende des Referenzzeitraums, basierend auf den Daten zum Monatsende. Der Gesamtnachhaltigkeitswert fasst die Auswirkung von Nachhaltigkeitsindikatoren zusammen, insbesondere Treibhausgasemissionen, Wassernutzung und Vergütungen verglichen mit dem Existenzminimum.

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 55 % des Long-Engagements auf nachhaltige Investitionen (bei denen es sich ausschließlich um Long-Positionen handelt, da Short-Positionen nicht als nachhaltige Investitionen eingestuft werden).

Der Anlageverwalter überwachte die Einhaltung der Vorgabe, mindestens 35 % seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen zu investieren, indem er den Nachhaltigkeitswert jedes Vermögenswerts im proprietären Tool von Schroders berücksichtigte.

Für zusätzlichen Kontext: Der Anlageverwalter investierte während des Referenzzeitraums auf der Grundlage von Daten zum jeweiligen Quartalsende 28 % 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. 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. 2022 - Sep. 2023	9,8
Okt. 2021 - Sep. 2022	8,8

Für 2022 wurde der Prozentsatz der nachhaltigen Investitionen zum Ende des Referenzzeitraums berechnet. Für 2023 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 in positiven Nachhaltigkeitsauswirkungen unter anderem durch:

- 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
- 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.

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

Die vorstehenden Beispiele für die Ziele der vom Fonds während des Referenzzeitraums getätigten nachhaltigen Investitionen beruhen auf den häufigsten 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 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?**

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

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

- Schroders hat am 6. Januar 2020 die Grundsätze des Globalen Pakts der Vereinten Nationen (UNGC) unterzeichnet. Der Fonds schloss Unternehmen, die gegen die UNGC-Prinzipien verstoßen, 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 Verstößen gegen den UNGC bezichtigt wird, 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 verstoßen, wird durch einen Drittanbieter bereitgestellt, und die Compliance mit der Liste wurden mittels unserer automatisierten Compliance-Kontrollen überwacht.

- 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.

Weitere Informationen zu allen Ausschlüssen des Fonds finden Sie unter „Angaben zur Nachhaltigkeit“ auf der Webseite des Fonds unter <https://www.schroders.com/en-lu/lu/professional/fund-centre>.

Wie wurden die Indikatoren für nachteilige Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren berücksichtigt?

Wo der Anlageverwalter Schwellenwerte bei nachteiligen Auswirkungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren festlegte, wurde die Einhaltung dieser Grenzwerte kontinuierlich anhand des Portfolio-Compliance-Rahmens überwacht. Beteiligungsunternehmen, die diese Werte nicht einhielten, wurden nicht als nachhaltige Investition eingestuft.

Der Fonds schloss beispielsweise Unternehmen, die gegen die UNGC-Grundsätze verstoßen (Nachhaltigkeitsindikator für nachteilige Auswirkungen/PAI 10), bei den nachhaltigen Investitionen des Portfolios aus. Die Liste der Unternehmen, die gegen den UNGC verstoßen, wird durch einen Drittanbieter bereitgestellt, und die Compliance mit der Liste wurden mittels unserer automatisierten Compliance-Kontrollen überwacht.

Darüber hinaus wurden gegebenenfalls auf Ebene der zugrunde liegenden Strategie, nicht jedoch auf Fondsebene, Unternehmen vom Long-Engagement ausgeschlossen, von denen angenommen wurde, dass sie wesentlich zum Klimawandel beitragen (im Zusammenhang mit den PAIs 1, 2 und 3, die Treibhausgasemissionen abdecken). Nicht zugelassen waren Emittenten mit mehr als 10 % Einnahmen aus dem Steinkohlebergbau und mehr als 30 % Einnahmen aus der Kohlestromerzeugung. Der Fonds hat möglicherweise strengere Schwellenwerte angewandt, die auf der Website des Fonds angegeben sind. Die Einhaltung der Ausschlüsse wurde über unsere automatisierten Compliance-Kontrollen überwacht.

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

In anderen Bereichen legte Schroders (auch indirekt über die Manager der zugrunde liegenden Strategien) Grundsätze für das Engagement in Unternehmen fest. Wir haben jeden PAI mit einem der sechs Kernthemen von Schroders verknüpft. Nachfolgend finden Sie eine Zusammenfassung der geltenden Schwellenwerte und der jeweiligen darauf bezogenen Engagement-Aktivitäten:

Klimawandel:

Die PAIs 1, 2, 3, 4, 5, 6 und Pai 4 in Tabelle 2 beziehen sich auf den Engagement Blueprint zum Klimawandel. Einzelheiten zu unserem Engagement Blueprint finden Sie hier: (Link

<https://mybrand.schroders.com/m/3222ea4ed44a1f2c/original/schroders-engagement-blueprint.pdf>). Unser Engagement soll aufzeigen, wie Unternehmen auf Herausforderungen reagieren, die sich aus den Auswirkungen des Klimawandels auf ihre langfristige Finanzsituation ergeben. Durch unsere Engagement-Aktivitäten gewinnen wir Erkenntnisse etwa zu Umsetzungstempo und Umfang von Emissionsreduktionszielen oder Schritten auf dem Weg zu Klimazielen.

Biodiversität und Naturkapital:

Die PAIs 7, 8 und 9 beziehen sich auf das Engagement Blueprint-Thema Biodiversität und Naturkapital. Uns ist bewusst, wie wichtig es ist, dass alle Unternehmen ihre Risiken in Bezug auf Naturkapital und biologische Vielfalt bewerten und darüber berichten. Wir konzentrieren unser Engagement auf die Verbesserung der Offenlegung in Bezug auf Themen wie beispielsweise Entwaldung, nachhaltige Lebensmittelproduktion und Wasser.

Menschenrechte:

Die PAIs 10 und 14 beziehen sich auf das Engagement Blueprint-Thema Menschenrechte. Die Rolle, die Unternehmen bei der Achtung der Menschenrechte spielen können und sollten, gewinnt immer mehr an Bedeutung. Wir sind uns bewusst, dass Menschenrechtskontroversen erhöhte operationelle, finanzielle und Reputationsrisiken verursachen. Unser Engagement konzentriert sich auf drei wichtigen Stakeholdergruppen Mitarbeiter, Gesellschaft und Kunden.

Humankapitalmanagement:

Die PAIs 11, 12 und 13 beziehen sich auf das Engagement Blueprint-Thema Humankapitalmanagement. Humankapitalmanagement ist ein vorrangiges Thema unseres Engagements. Die Mitarbeiter von Unternehmen stellen einen wichtigen Wettbewerbsfaktor dar und ein effektives Humankapitalmanagement ist unerlässlich für Innovation und langfristige Wertschöpfung. Wir sehen darüber hinaus klare Zusammenhänge zwischen hohen Standards im Humankapitalmanagement und der Erreichung der SDGs. Unsere Engagement-Aktivitäten befassen sich mit Themen wie Gesundheitsschutz und Sicherheit, Unternehmenskultur und Investitionen in Personal.

Diversität und Inklusion:

Die PAIs 12 und 13 beziehen sich auf das Engagement Blueprint-Thema Diversität und Inklusion. Verbesserte Offenlegung zu Diversität in den Leitungsorganen und geschlechtsspezifischem Lohngefälle sind zwei der vorrangigen Ziele, die in unserem Engagement Blueprint definiert sind. Wir erwarten von Unternehmen die Implementierung einer Richtlinie, nach der bei jeder Stellenbesetzung in Führungsgremien mehrere diverse Bewerber berücksichtigt werden müssen. Unser Engagement-Ansatz umfasst auch Vorgaben zur Diversität der Geschäftsführung, der Belegschaft und der Wertschöpfungskette.

Unternehmensführung (Corporate Governance):

Die PAIs 12, 13 und PAI 4 in Tabelle 3 beziehen sich auf das Engagement Blueprint-Thema Unternehmensführung. Wir stellen in Zusammenarbeit mit den Unternehmen sicher, dass diese im besten Interesse der Aktionäre und anderer wichtiger Stakeholder handeln. Wir sind weiterhin der Ansicht, dass in den meisten Fällen zunächst starke Governance-Strukturen geschaffen werden

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

müssen, um Fortschritte und Leistungen in anderen wesentlichen Belangen im Bereich Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) zu erzielen. Wir befassen uns daher mit verschiedenen Corporate Governance-Aspekten wie der Vergütung von Führungskräften, Vorständen und Management sowie der Strategie.

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

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

Wir nutzten eine von einem Drittanbieter bereitgestellte Liste von Unternehmen, die gegen den UNGC verstoßen. Emittenten auf dieser Liste wurden nicht als nachhaltige Investition eingestuft. Die Bereiche, die berücksichtigt wurden, um festzustellen, ob ein Emittent gegen den UNGC verstößt, umfassten jene, 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.

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 beigefügt.

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

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



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

Der 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
- UNGC-Verletzer: PAI 10 (Verstöße gegen die UNGC- Grundsätze und gegen die Leitsätze der OECD für multinationale Unternehmen) – auf nachhaltige Investitionen angewandt
- 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 der jeweiligen zugrunde liegenden Strategien angewandt

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

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

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 PAIs, die mit diesem Ansatz erfasst wurden, sind PAI 1 (THG-Emissionen), PAI 2 (CO₂-Fußabdruck),

PAI 3 (THG-Intensität der investierten Unternehmen) 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	47
Diversität und Inklusion	38
Menschenrechte	17
Humankapitalmanagement	16
Unternehmensführung und Aufsicht	8
Naturkapital und Biodiversität	7

Die ausgewiesenen Engagements können Engagements umfassen, die Short-Positionen, Barmitteln, Derivaten, Organismen für gemeinsame Anlagen, Schuldtiteln und Pensionsgeschäften des Fonds zugeordnet sind.

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



Welche sind 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 im Bezugszeitraum getätigten Investitionen des Finanzprodukts entfiel: 1. Okt. 2022 bis 30. Sep. 2023**

Größte Investitionen	Sektor	% des Vermögens Land (Netto)	
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	Informationstechnologie	1,87	Südkorea, Republik
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	Informationstechnologie	1,69	Taiwan (Republik China)
HDFC BANK LTD	Finanzen	1,59	Indien
RELX PLC	Industrie	1,54	Vereinigtes Königreich
AIA GROUP LTD	Finanzen	1,33	Hongkong
WHITBREAD PLC	Zyklische Konsumgüter	1,31	Vereinigtes Königreich
NOVA LJUBLJANSKA BANKA DD LJUBLJANA	Finanzen	1,23	Slowenien
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD	Finanzen	1,23	China
CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD	Industrie	1,15	China
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP HOLDINGS LTD	Zyklische Konsumgüter	1,15	China
WONIK IPS CO LTD	Informationstechnologie	0,96	Südkorea, Republik
MEDIATEK INC	Informationstechnologie	0,93	Taiwan (Republik China)
MIDEA GROUP CO LTD	Zyklische Konsumgüter	0,93	China
NATIONAL BANK OF GREECE SA	Finanzen	0,89	Griechenland
SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC	Finanzen	0,88	Japan

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, 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

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

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

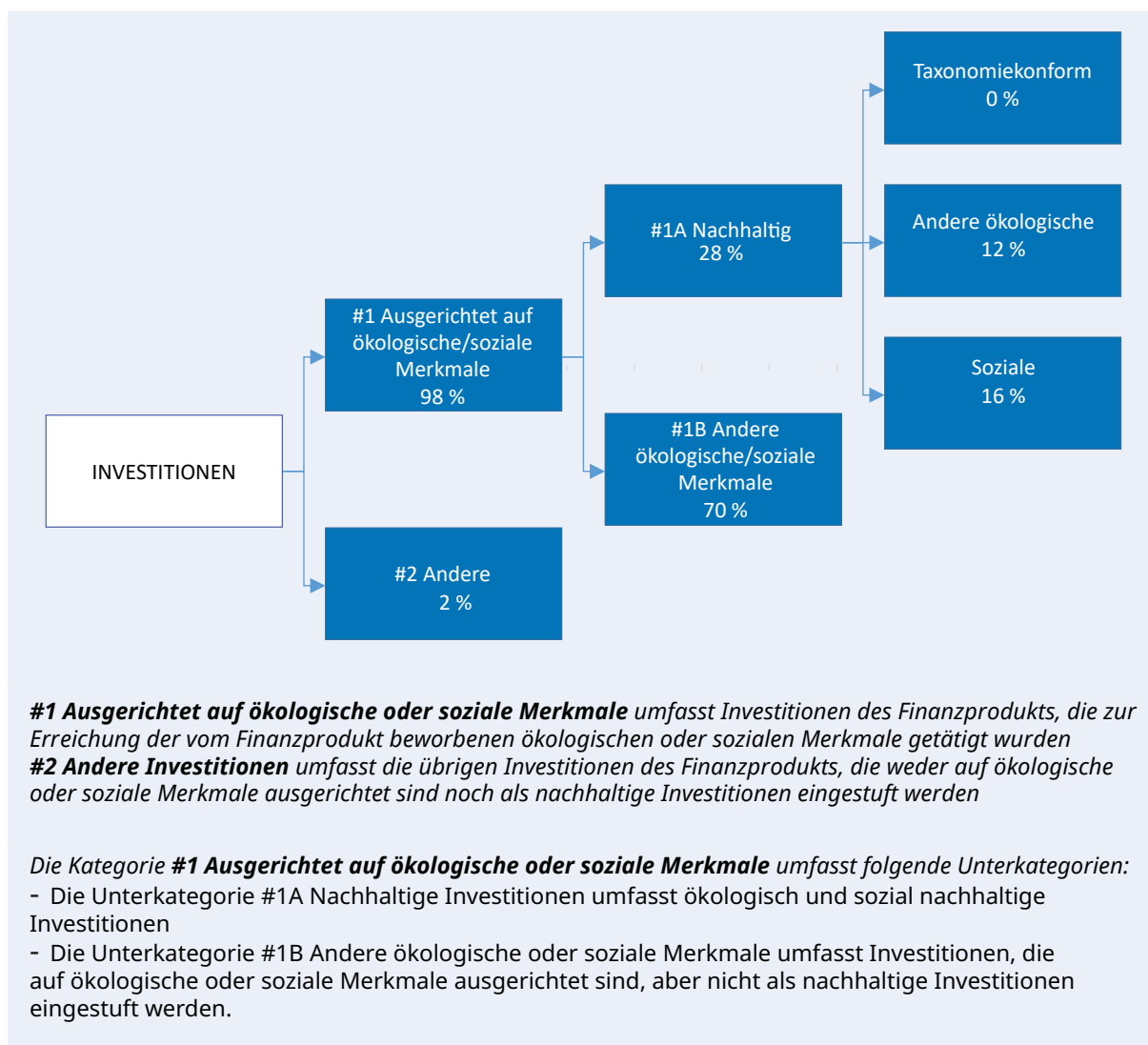
Gesamtbewertung bei, während Long-Positionen mit negativen Bewertungen und Short-Positionen mit positiven Bewertungen beide die Gesamtbewertung beeinträchtigten. Der unter #1 Ausgerichtet auf ökologische oder soziale Merkmale angegebene Prozentsatz bezieht sich auf den Durchschnitt des Bezugszeitraums 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 Nachhaltigkeitswert wird von einem von Schroders entwickelten Tool gemessen, das eine Schätzung der Netto-„Auswirkungen“ liefert, die ein Emittent in Bezug auf soziale und ökologische „Kosten“ oder „Vorteile“ verursachen könnte. Dazu werden bestimmte Indikatoren in Bezug auf den jeweiligen Emittenten verwendet und diese positiv und negativ quantifiziert, um eine fiktive Gesamtkennzahl der Auswirkung zu ermitteln, die der jeweilige zugrunde liegende Emittent möglicherweise auf die Gesellschaft und die Umwelt haben kann. Beispiele für solche Indikatoren sind Treibhausgasemissionen, Wasserverbrauch und Löhne im Vergleich zum existenzsichernden Lohn.

Der Fonds investierte während des Referenzzeitraums 28 % 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. 12 % davon wurden in nachhaltige Investitionen mit Umweltziel und 16 % 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 55 % seines Long-Engagements in nachhaltige Investitionen. 24 % davon wurden in nachhaltige Investitionen mit Umweltziel und 31 % 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 den 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 Barmittel, Barmitteläquivalente und Optionen, die in Bezug auf Nachhaltigkeit als neutral eingestuft 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.

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



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 55 % 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	Teilssektor	% des Vermögens (Netto)	% des Vermögens (Brutto)
Kommunikationsdienstleistungen	Medien und Unterhaltung	2,53	13,73
Kommunikationsdienstleistungen	Telekommunikationsdienstleistungen	-0,18	7,41
Zyklische Konsumgüter	Automobile und Autoteile	-1,26	9,60
Zyklische Konsumgüter	Zyklische Konsumgüter - Vertrieb und Einzelhandel	0,02	13,55
Zyklische Konsumgüter	Langlebige Konsumgüter und Bekleidung	3,40	15,33
Zyklische Konsumgüter	Verbraucherdienstleistungen	1,67	13,99
Basiskonsumgüter	Basiskonsumgüter - Vertrieb und Einzelhandel	-1,17	6,99
Basiskonsumgüter	Nahrungsmittel, Getränke und Tabakwaren	-0,83	13,02
Basiskonsumgüter	Haushalts- und Körperpflegeprodukte	0,24	3,36
Energie	Energie	-1,79	10,94
Finanzen	Banken	0,23	35,16
Finanzen	Finanzdienstleistungen	-3,47	17,52
Finanzen	Versicherung	2,12	12,98
Gesundheitswesen	Geräte und Dienstleistungen für das Gesundheitswesen	0,16	8,22
Gesundheitswesen	Pharmazeutika, Biotechnologie & Life Sciences	0,34	12,82
Inhaltsverzeichnis	Inhaltsverzeichnis	-1,79	0,12
Industrie	Investitionsgüter	3,85	43,43
Industrie	Gewerbliche und professionelle Dienstleistungen	1,19	9,77
Industrie	Transport	-3,83	9,60
Informationstechnologie	Halbleiter und Halbleiterrausrüstung	2,99	13,96
Informationstechnologie	Software und softwarebezogene Dienstleistungen	1,15	13,16
Informationstechnologie	Technologie-Hardware und Ausrüstung	2,44	19,21
Zinssätze / staatsnahe Titel / Staatsanleihen	Zinssätze / staatsnahe Titel / Staatsanleihen	1,33	1,67
Grundstoffe	Grundstoffe	-3,15	27,98
Immobilien	Aktien - Real Estate Investment Trusts (REITs)	-1,79	12,59
Immobilien	Immobilienbewirtschaftung und -entwicklung	-0,24	7,98
Versorger	Versorger	-3,76	7,39

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?

Es gab keine definierte Mindest-Taxonomieausrichtung der Anlagen des Fonds (einschließlich Übergangs- und ermöglichende Tätigkeiten) mit Umweltziel. Die Taxonomie-Konformität der Investitionen dieses Fonds wurde daher nicht berechnet und infolgedessen mit 0 % des Fondsportfolios eingestuft.

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

• **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.

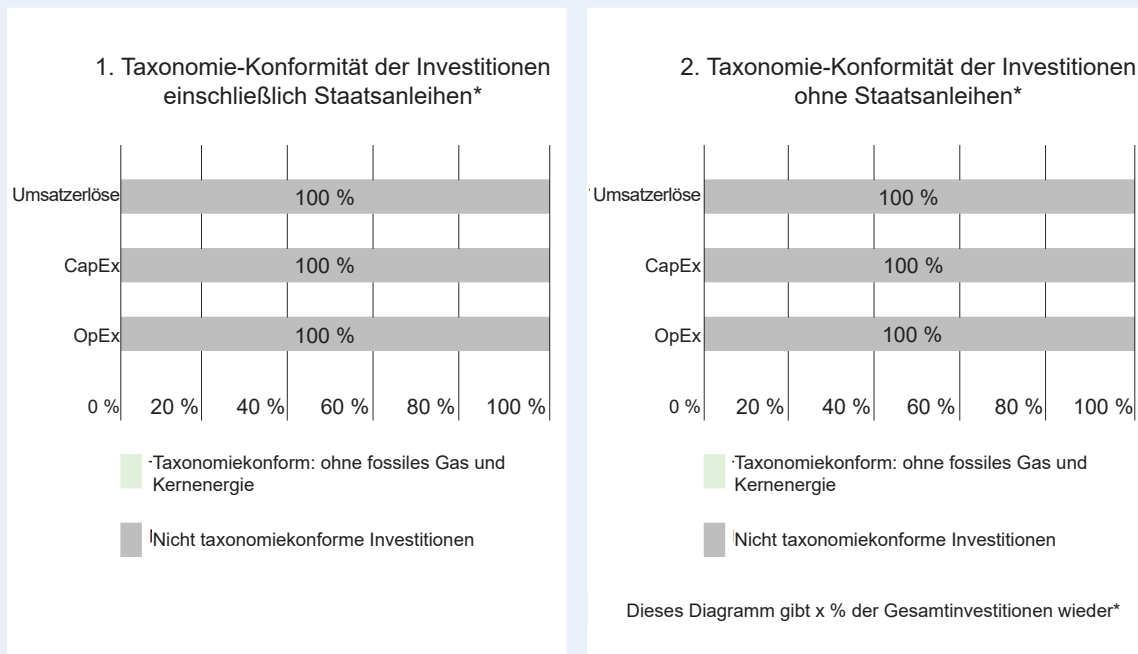
Taxonomiekonforme Tätigkeiten, ausgedrückt durch den Anteil der:

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

- **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 operativen 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 die Investitionen des Finanzprodukts zeigt, die keine Staatsanleihen umfassen.



* 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.

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

Ermöglichende Tätigkeiten

wirken unmittelbar ermöglichend 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 die Treibhausgasemissionswerte aufweisen, die den besten Leistungen entsprechen.

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

Wie oben beschrieben, wird der Anteil der Anlagen des Fonds in Übergangstätigkeiten und ermöglichenden 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 Referenzzeiträumen entwickelt?*

Diese Frage ist nicht relevant.



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 12 % 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 24 % 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 16 % 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 31 % 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 Barmittel, Barmitteläquivalente und Optionen, die in Bezug auf Nachhaltigkeit als neutral eingestuft 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.

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

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 Governance-Indikatoren 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 Gegenparteien durch das Kreditrisikoteam von Schroders überprüft, und die Zulassung einer neuen Gegenpartei basierte auf einer ganzheitlichen Prüfung der verschiedenen verfügbaren Informationsquellen, insbesondere zur Qualität des Managements, zur Eigentümerstruktur, zum Standort, zum aufsichtsrechtlichen und gesellschaftlichen Umfeld einer jeden Gegenpartei und zum Entwicklungsgrad des örtlichen Bankensystems und dessen aufsichtsrechtlicher Rahmenbedingungen. Die laufende Überwachung erfolgte über ein proprietäres Tool von Schroders, das die Analyse des Managements ökologischer, sozialer und unternehmensführungsbezogener Trends und Herausforderungen durch die Gegenpartei 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.



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

Im Bezugszeitraum wurden folgende 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;
- der Anlageverwalter überwachte die Anwendung von Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung durch die zugrunde liegenden Strategien des Fonds; 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.

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



Wie hat dieses Finanzprodukt im Vergleich zum bestimmten Referenzwert abgeschnitten?

Bei den Benchmarks

handelt es sich um Indizes, mit denen gemessen wird, ob das Finanzprodukt die beworbenen ökologischen oder sozialen Merkmale erreicht.

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

• **Wie unterschied 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 sich dieses Finanzprodukt im Vergleich zur Benchmark entwickelt?**

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

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

Diese Frage trifft für diesen Fonds nicht zu.

Diese Angaben wurden unter Verwendung von Informationen von MSCI ESG Research LLC oder seinen verbundenen Unternehmen oder Informationsanbietern erstellt. Obwohl die Informationsanbieter von Schroder Investment Management (Europe) S.A., insbesondere MSCI ESG Research LLC und seine verbundenen Unternehmen (die „ESG-Parteien“), Informationen (die „Informationen“) aus Quellen beziehen, die sie als zuverlässig erachten, garantiert keine der ESG-Parteien die Ursprünglichkeit, Genauigkeit und/oder Vollständigkeit der hierin enthaltenen Daten und sie schließen ausdrücklich alle ausdrücklichen oder stillschweigenden Garantien aus, einschließlich der Garantien der Marktgängigkeit und der Eignung für einen bestimmten Zweck. Die Informationen dürfen nur für Ihren internen Gebrauch verwendet, in keiner Form vervielfältigt oder weiterverbreitet werden und dürfen nicht als Grundlage oder Bestandteil von Finanzinstrumenten, Produkten oder Indizes verwendet werden. Darüber hinaus dürfen die Informationen selbst nicht dazu verwendet werden, zu bestimmen, welche Wertpapiere zu kaufen oder zu verkaufen sind oder wann sie gekauft oder verkauft werden sollten. Keine der ESG-Parteien haftet für Fehler oder Auslassungen in Verbindung mit den hierin enthaltenen Daten oder haftet für direkte, indirekte, spezielle, Strafschadenersatz, Folgeschäden oder sonstige Schäden (einschließlich entgangener Gewinn), selbst wenn sie über die Möglichkeit solcher Schäden informiert wurden.

Dieser Bericht enthält bestimmte Informationen (die „Informationen“), die von ©2022 MSCI ESG Research LLC und/oder ihren verbundenen Unternehmen oder Informationsanbietern (die „ESG-Parteien“) stammen und zur Berechnung von Bewertungen, Ratings oder anderen Indikatoren verwendet worden sein können. Die Informationen dürfen nur für Ihren internen Gebrauch verwendet, in keiner Form vervielfältigt oder weiterverbreitet werden und dürfen nicht als Grundlage oder Bestandteil von Finanzinstrumenten, Produkten oder Indizes verwendet werden. Obwohl sie Informationen aus Quellen beziehen, die sie als zuverlässig erachten, garantiert keine der ESG-Parteien die Ursprünglichkeit, Genauigkeit und/oder Vollständigkeit der hierin enthaltenen Daten und sie schließen ausdrücklich alle ausdrücklichen oder stillschweigenden Garantien aus, einschließlich der Garantien der Marktgängigkeit und der Eignung für einen bestimmten Zweck. Keine der Informationen stellt eine Anlageberatung oder Empfehlung bezüglich einer Anlageentscheidung (oder deren Unterlassung) dar und darf nicht als solche verstanden werden, noch sollte sie als Hinweis oder Garantie für eine zukünftige Wertentwicklung, Analyse, Prognose oder Vorhersage verstanden werden. Keine der ESG-Parteien haftet für Fehler oder Auslassungen in Verbindung mit den hierin enthaltenen Daten oder Informationen oder haftet für direkte, indirekte, spezielle, Strafschadenersatz, Folgeschäden oder sonstige Schäden (einschließlich entgangener Gewinn), selbst wenn sie über die Möglichkeit solcher Schäden informiert wurden.

Dieses Dokument dient der Erfüllung der aufsichtsrechtlichen Offenlegungspflichten von Schroder Investment Management (Europe) S.A. und sollte 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 gemachten Angaben werden für zuverlässig erachtet, Schroders übernimmt jedoch keine Gewähr für ihre Vollständigkeit oder Richtigkeit. Wir übernehmen keine Haftung für Fehler oder irreführende Meinungsäußerungen seitens MSCI oder Schroders. Individuelle Anlage- und/oder strategische Entscheidungen sollten nicht auf der Grundlage der in diesem Dokument enthaltenen Ansichten und Angaben getroffen werden. Schroders hat in diesem Dokument eigene Ansichten zum Ausdruck gebracht, die sich ändern können. Bitte beachten Sie, dass die Weiterverwendung der in diesem Dokument enthaltenen Daten den geltenden MSCI-Lizenzanforderungen unterliegt. Bitte beachten Sie, dass Sie, wenn Sie diese Daten für Ihre eigenen Zwecke weitergeben möchten, eine entsprechende Lizenz mit MSCI vereinbaren müssen.



EST. 1804

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

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

GAIA 30. September 2023 DEDE