



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Halfjaarverslag

31 maart 2021

Er kunnen geen inschrijvingen worden ontvangen op basis van periodieke verslagen. Inschrijvingen zijn enkel geldig als ze worden uitgevoerd op basis van het huidige prospectus, de huidige documenten met Essentiële Beleggersinformatie, vergezeld van het laatste beschikbare Jaarverslag of niet-gecontroleerde halfjaarverslag indien dit later wordt gepubliceerd. Dit verslag is gebaseerd op het huidige prospectus.

De gecontroleerde jaarverslagen en de niet-gecontroleerde halfjaarverslagen, het huidige prospectus en de statuten van de Vennootschap zijn kosteloos beschikbaar op de hoofdzetel van de Vennootschap te 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg, Groothertogdom Luxemburg.

In geval van onverenigbaarheid tussen de Engelse en de vertaalde versie van dit document, geldt de Engelse versie.

Inhoud

Schroder GAIA	5
Raad van Bestuur	6
Administratie	7
Verslag van de Bestuurders	8
Verslag van de Beleggingsbeheerder	9
Overzicht van het nettovermogen	11
Winst-en-verliesrekening	17
Mutatieoverzicht van het nettovermogen	19
Spreading van beleggingen per sector	21
Beleggingsportefeuille	25
Schroder GAIA BlueTrend	25
Schroder GAIA Cat Bond	25
Schroder GAIA Contour Tech Equity	29
Schroder GAIA Egerton Equity	30
Schroder GAIA Helix	31
Schroder GAIA M&A*	35
Schroder GAIA Sirius US Equity	36
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	38
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	39
Schroder GAIA Wellington Pagosa	40
Toelichting bij de financiële overzichten	52
Total Expense Ratio (de "TER")	131
Bijlage I – Effectenfinancieringstransacties	133

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

De Vennootschap

Schroder GAIA (de 'Vennootschap') is een beleggingsvennootschap met paraplustructuur en beperkte aansprakelijkheid van het open type, met meerdere fondsen, die georganiseerd is als een 'société anonyme' (naamloze vennootschap) en in aanmerking komt als een sicav volgens Deel I van de Wet van 17 december 2010, zoals gewijzigd. De Vennootschap is op 21 oktober 2009 opgericht en haar Statuten zijn op 12 november 2009 gepubliceerd in het Mémorial, zoals gewijzigd.

Dit verslag heeft betrekking op de periode van 1 oktober 2020 tot 31 maart 2021. De jaarrekening is opgesteld in overeenstemming met de Luxemburgse regelgeving die betrekking heeft op instellingen voor collectieve belegging. De laatste dag waarop prijzen zijn berekend, was op 31 maart 2021, de laatste werkdag van de verslagperiode. Per datum van dit verslag kan er belegd worden in tien subfondsen binnen de Vennootschap (de 'subfondsen').

Raadpleeg het huidige prospectus voor de beleggingsdoelstellingen van de compartimenten en voor gedetailleerde informatie over de beleggingsbeperkingen. Het verslag van de Beleggingsbeheerder voor elk subfonds kan worden geraadpleegd in de driemaandelijkse beleggingsrapporten, die beschikbaar zijn op het hoofdkantoor van de Vennootschap en op de website van Schroder Investment Management (Europe) S.A. (<http://www.schroders.lu>).

Schroders is een organisatie die voldoet aan de FATCA-regelgeving. De FATCA-classificatie van deze entiteit en haar GIIN is als volgt: Classificatie FATCA-entiteit: FFI; Sponsorende entiteit: Schroder Investment Management (Europe) S.A.; GIIN sponsorende entiteit: 4RIMT7.00000.SP.442.

Corporate Governance

De Vennootschap moet bepaalde regels voor corporate governance naleven, op basis van:

1. Haar verplichtingen zoals gedefinieerd door de UCITS-richtlijn 2009/65/EG van 13 juli 2009, zoals opgenomen in de wet van Luxemburg, die kan worden ingezien op het hoofdkantoor van de Vennootschap, te 5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg, Groothertogdom Luxemburg.
2. Haar Statuten, die kunnen worden geraadpleegd op het hoofdkantoor van de Vennootschap en bij het Luxemburgse handels- en vennootschapsregister, het Registre de Commerce et des Sociétés ('RCSL').
3. Haar verplichtingen ten aanzien van het beheer van de Vennootschap, waarvoor de Vennootschap Schroder Investment Management (Europe) S.A. (de 'Beheermaatschappij') heeft aangesteld, die onderworpen is aan de vereisten van de Richtlijn 2010/43/EU inzake beheermaatschappijen, zoals opgenomen in de wetgeving van Luxemburg.
4. De gedragscode voor Luxemburgse beleggingsfondsen van de Association of the Luxembourg Fund Industry ('ALFI'), die de Vennootschap vrijwillig heeft ingevoerd.

Interne controle- en risicobeheersystemen

De Raad van Bestuur is verantwoordelijk voor het vaststellen en onderhouden van toereikende systemen voor interne controle en risicobeheer van de Vennootschap met betrekking tot het proces voor financiële verslaggeving. Dergelijke systemen zijn ontworpen om het risico van fouten of fraude bij de verwezenlijking van de doelstellingen voor financiële verslaggeving van de Vennootschap veeleer te beheren dan te elimineren, en kunnen alleen een redelijke en geen absolute zekerheid bieden tegen wezenlijke onjuistheden of verlies.

De Raad van Bestuur is met de Beheermaatschappij overeengekomen om procedures in te stellen om te garanderen dat de volledige relevante boekhoudkundige administratie naar behoren wordt bijgehouden en steeds beschikbaar is, waaronder het opstellen van jaar- en halfjaarverslagen. De jaar- en halfjaarverslagen van de Vennootschap moeten worden goedgekeurd door de Raad van Bestuur van de Vennootschap en ingediend bij de Commission de Surveillance du Secteur Financier ('CSSF'); de jaarverslagen moeten worden ingediend bij het Registre de Commerce et des Sociétés ('RCSL'). De statutaire jaarrekening moet worden gecontroleerd door onafhankelijke accountants die hun bevindingen melden aan de Raad van Bestuur.

De Raad komt minstens vier keer per jaar bijeen en garandeert dat de Vennootschap hoge integriteits- en controlenormen hanteert bij haar werkzaamheden en dat zij naar behoren wordt bestuurd en gecontroleerd zoals dat door de wet- en regelgeving wordt vereist.

Raad van Bestuur

Voorzitter

- **Eric Bertrand**

Head of Schroders GAIA

Vaults 13-16
Valletta Waterfront
FRN 1914
Malta

Overige Bestuurders

- **Carla Bergareche**

Head of Iberian Business

Schroder Investment Management (Europe) S.A.
Sucursal en España
Pinar 7, 4de verdieping, 28006 Madrid
Spanje

- **Mike Champion**

Head of Product Development

Schroder Investment Management Limited
1 London Wall Place
London EC2Y 5AU
Verenigd Koninkrijk

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

Onafhankelijk Bestuurder

19, rue de Bitbourg, 1273 Luxembourg
Groothertogdom Luxemburg

- **Bernard Herman**

Onafhankelijk Bestuurder

Immeuble Dyapason
4, rue Robert Stumper, 2557 Luxembourg
Groothertogdom Luxemburg

- **Achim Kuessner**

Country Head Germany, Austria & CEE

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

- **Hugh Mullan**

Onafhankelijk Bestuurder

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg,
Groothertogdom Luxemburg

- **Neil Walton**

Head of Investment Solutions

Schroder Investment Management Limited
1 London Wall Place
London EC2Y 5AU
Verenigd Koninkrijk

Administratie

Hoofdkantoor

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg,
Groothertogdom Luxemburg

Beheermaatschappij, Registerhouder en Domicilieagent

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg,
Groothertogdom Luxemburg

Hoofdbetalingskantoor en Transferagent

HSBC Continental Europe, Luxembourg

16, boulevard d'Avranches, 1160 Luxemburg,
Groothertogdom Luxemburg

Bewaarder en Administratief Agent

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

80, route d'Esch, 1470 Luxemburg,
Groothertogdom Luxemburg

Hoofdadviseur Juridische Zaken

Arendt & Medernach S.A.

41A, Avenue J.F. Kennedy, 2082 Luxemburg,
Groothertogdom Luxemburg

Onafhankelijke accountant

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative

2, rue Gerhard Mercator, 2182 Luxemburg,
Groothertogdom Luxemburg

Beleggingsbeheerders

BennBridge Ltd.

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

Contour Asset Management, LLC

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

Egerton Capital (UK) LLP

Stratton House, 5 Stratton Street, Londen W1J 8LA
Verenigd Koninkrijk
Schroder GAIA Egerton Equity

Egerton Capital (UK) LLP heeft de volgende

Subbeleggingsbeheerder aangesteld voor Schroder GAIA Egerton Equity:

- Egerton Capital (US), LP.

Schroder Investment Management Limited

1 London Wall Place, Londen EC2Y 5AU
Verenigd Koninkrijk
Schroder GAIA Helix
Schroder GAIA M&A*

Schroder Investment Management Limited heeft de volgende
Subbeleggingsbeheerder aangesteld voor Schroder GAIA Helix:

- BennBridge Ltd.

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

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

Sirios Capital Management LP

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

Systematica Investments Limited

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

Systematica Investments Limited heeft de volgende

Subbeleggingsbeheerders aangesteld voor Schroder GAIA BlueTrend:

- Systematica Investments UK LLP;

- Systematica Investments Jersey Limited;

- Systematica Investments GP Limited, Geneva branch; en

- Systematica Investments Singapore PTE.

Two Sigma Advisers LP

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

Wellington Management International Limited

Cardinal Place, 80 Victoria Street, Londen SW1E 5JL
Verenigd Koninkrijk
Schroder GAIA Wellington Pagosa

Wellington Management International Limited heeft de volgende

Subbeleggingsbeheerders aangesteld voor Schroder GAIA Wellington Pagosa:

- Wellington Management Company LLP.

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

Verslag van de Bestuurders

Inleiding

De bestuurders van de Vennootschap presenteren hun verslag en de financiële overzichten voor de periode afgesloten op 31 maart 2021.

Activiteiten tijdens de periode

Op 31 maart 2021 bedroeg het totale nettovermogen van de Vennootschap EUR 5.180.821.032, in vergelijking met EUR 4.869.786.470 op 30 september 2020, wat een stijging van 6,39% vertegenwoordigt.

1. Nieuwe Compartimenten

Tijdens de verslagperiode werd 1 nieuw Subfonds ter beschikking gesteld voor beleggingen in de Vennootschap:

Compartiment	Basisvaluta van het Compartiment	Introductiedatum
Schroder GAIA M&A	USD	29 januari 2021

2. Nieuwe aandelencategorieën

Naast de 12 aandelencategorieën die in het bovenstaande Subfonds werden geïntroduceerd op de introductiedatum, werden ook de volgende aandelencategorieën tijdens de verslagperiode beschikbaar gemaakt:

Compartiment en Aandelencategorie	Valuta van de aandelencategorie	Basisvaluta van het Compartiment	Introductiedatum
Schroder GAIA BlueTrend			
Categorie C Acc BRL Hedged	USD	USD	21 januari 2021
Schroder GAIA Cat Bond			
Categorie IF Acc SEK Hedged	SEK	USD	11 december 2020
Categorie A Acc SEK Hedged	SEK	USD	29 januari 2021

3. Vereffening van aandelencategorieën

De volgende aandelencategorie werd vereffend tijdens de verslagperiode:

Compartiment en Aandelencategorie	Valuta van de aandelencategorie	Basisvaluta van het Compartiment	Vereffeningdatum
Schroder GAIA Egerton Equity			
Categorie C Acc JPY Hedged	JPY	EUR	24 maart 2021

De Raad van Bestuur

Schroder GAIA
31 maart 2021

Verslag van de Beleggingsbeheerder

De subfondsen in het Schroder GAIA-assortiment kunnen via long- of shortposities profiteren van gunstige of ongunstige marktomstandigheden. Deze benadering kan soms leiden tot zeer uiteenlopende resultaten op korte termijn in verhouding tot de markten waarin de subfondsen beleggen.

Economisch verslag

De periode van zes maanden kende een bemoedigende wending in de Covid-19-pandemie met de aankondiging in november dat er succesvolle vaccins waren ontdekt. De andere belangrijke gebeurtenis was de Amerikaanse presidentsverkiezingen, ook in november, met een overwinning voor de Democratische kandidaat Joe Biden. In januari wonnen de Democraten de beslissende stemronde voor de Senaatsverkiezingen in Georgia, waardoor de Democratische partij de controle kreeg over het Witte Huis, de Senaat en het Huis van Afgevaardigden.

De Democraten maakten schoon schip, wat de weg vrijmaakte voor aanzienlijke fiscale stimulansen. In maart werd een coronasteunpakket van \$ 1,9 biljoen goedgekeurd met als doel het economische herstel van de recessie ten gevolge van de pandemie te versnellen. Bbp-gegevens wijzen op een krimp van 3,5% voor de Amerikaanse economie in 2020. De VS was ook een van de toonaangevende grote economieën wat betreft de vaccinatie van de bevolking tegen Covid-19. President Biden stelde een doel van 100 miljoen vaccindoses die tijdens zijn eerste 100 dagen als president zouden worden toegediend. Hij verhoogde dit aantal vervolgens tot 200 miljoen nadat het oorspronkelijke doel vroegtijdig werd bereikt.

Ook het VK was een van de grote economieën die snel overging tot vaccinatie. Het land bracht een groot deel van de periode door in lockdown nadat het aantal Covid-19-besmettingen aanzienlijk toenam tijdens de herfst en de winter. De economie kromp met 9,8% voor het jaar. Dankzij de lockdowns die de overdracht van het virus aan banden konden leggen en de snelheid waarmee het vaccinprogramma werd geïmplementeerd, kon de regering een plan voorstellen voor de heropening van de gesloten sectoren in het voorjaar. Een andere belangrijke gebeurtenis voor het VK was het afsluiten van een nieuw handels- en samenwerkingsakkoord met de EU, net voor het verstrijken van de brexit-overgangperiode op 1 januari 2021.

Het tempo van de uitrol van de Covid-19-vaccinatieprogramma's verschilde van land tot land in de EU, maar was doorgaans trager dan in de VS en het VK. De meeste landen hielden een bepaalde vorm van Covid-19-beperkingen aan, maar ook deze verschilden tussen de landen en de regio's. Gegevens wezen op een krimp van 6,6% in de eurozone voor 2020. Italië werd geconfronteerd met politieke verandering door de ineenstorting van de centrumlinkse coalitieregering onder leiding van Giuseppe Conte. Mario Draghi, voormalig voorzitter van de Europese Centrale Bank, nam het over aan het hoofd van een eenheidsregering.

China was begin 2020 het eerste land waar het virus woedde, maar tegen de verslagperiode was het er grotendeels in geslaagd om het virus in te dammen. China kon hierdoor een positieve bbp-groei voor het jaar noteren, wat een economische groei van 2,3% betekent voor 2020. Handelsspanningen bleven eigen aan de periode, hoewel er enige hoop was op een wijziging in toon gezien de verandering in het Amerikaanse politieke landschap. De periode vertoonde ook tekenen van een toegenomen regulering van Chinese financiële technologiebedrijven, wat resulteerde in de stopzetting van de beursintroductie van Ant Group.

Overzicht aandelenmarkten

In de zes maanden van de verslagperiode noteerden de wereldwijde aandelen een extreem sterke groei van 19,6% (bron: FactSet, netto totaalrendement, Amerikaanse dollar) zoals gemeten door MSCI World Index. Het nieuws over de vaccins en de aanhoudende fiscale en monetaire stimulansen van overheden en centrale banken dreven de aandelenkoersen op. Vooral de hoop dat gesloten delen van de economie binnenkort zouden heropenen, zorgde in november voor een sterke heropleving in onder meer de reissector.

De best presterende wereldwijde sector voor de zes maanden was energie. De olieprijsen waren in het voorjaar van 2020 sterk gedaald omdat de Covid-crisis op de vraag naar olie woog. Het nieuws over de vaccinaties zorgde voor een stijging van de olieprijsen vanuit de verwachting dat de vraag weer zou normaliseren. Een andere sector die een outperformance neerzette was financials. Naast de bezorgdheid rond mogelijke insolventie zagen vooral banken de prijzen van hun aandelen sterk dalen tijdens de eerste fase van de Covid-crisis. In verschillende landen voorkwamen toezichhouders uitbetalingen aan aandeelhouders om te garanderen dat banken voldoende buffer zouden hebben, mochten ze geconfronteerd worden met een insolventiegolf. Ook hier brachten de vaccins hoop op een terugkeer naar een normale situatie.

De sectoren die het minder goed deden omvatten daarentegen defensieve delen van de markt, zoals basisconsumptiegoederen en gezondheidszorg. Aandelen in de sector van de basisconsumptiegoederen, zoals supermarkten en voedselproducenten, ondervonden doorgaans weinig negatieve impact van het virus. Vanwege de verwachtingen dat de wereldwijde economie binnenkort haar herstel zou inzetten, gaven beleggers de voorkeur aan andere delen van de markt die waarschijnlijk meer zouden profiteren van dat herstel.

Elders bracht de plotse heropening van verschillende delen van de wereldwijde economie pieken in de vraag en enkele voorraadbeperkingen met zich mee. De halfgeleidersector was hiervan een goed voorbeeld met een grote vraag vanuit verschillende eindmarkten, waaronder fabrikanten van auto's en mobiele telefoons.

Aandelen uit opkomende markten noteerden ook een solide rendement gedurende de periode. De MSCI Emerging Markets Index noteerde een rendement van 22,4% (bron: FactSet, netto totaalrendement, Amerikaanse dollar). Chili was de best presterende markt van de index dankzij een rally in koperprijzen en een snelle uitrol van vaccins. Thailand en de Verenigde Arabische Emiraten noteerden sterke winsten in afwachting van een herstel van het toerisme, terwijl Rusland profiteerde van de hogere prijzen voor ruwe olie.

Turkije hinkte echter achterop nadat de gouverneur van de centrale bank onverwacht werd vervangen, waardoor aandelen en de valuta sterk daalden. China boekte een stijging van twee cijfers in dollar, maar presteerde ondermaats. Na eerdere sterke prestaties temperden de verwachtingen voor beleidsnormalisatie, samen met de onzekerheid over de regelgeving voor bepaalde sectoren en aanhoudende geopolitieke bezorgdheden het sentiment tot op zekere hoogte.

De informatie in dit verslag is van historische aard en vormt niet noodzakelijk een indicatie voor toekomstige resultaten.

Verslag Beleggingsbeheerders (vervolg)

Overzicht obligatiemarkten

In de zes maanden tot eind maart was er een duidelijke positieve verschuiving in de economische vooruitzichten. De opkomst van Covid-19-vaccins in het laatste kwartaal van 2020 heeft het optimisme van beleggers aanzienlijk versterkt. Dit leidde ertoe dat de winsten in risicovollere activa en de rente op staatsobligaties stegen.

De Amerikaanse verkiezingen kenden in november een beslissende overwinning voor de Democraten. In de daaropvolgende maanden groeide het optimisme over een mogelijk groot Amerikaans steunpakket, dat werd aangenomen in maart. Dit leidde tot een grote uitverkoop in staatsobligaties als gevolg van stijgende groei- en inflatieverwachtingen, en sommige beleggers begonnen de hoop te koesteren van eerder dan verwachte renteverhogingen. De rente op 10-jarig Amerikaans schatkistpapier steeg van 0,68% naar 1,75%, met een stijging van meer dan 30 basispunten in februari en maart.

De rente op 10-jarig Brits schatkistpapier steeg tijdens de periode met 0,88%, een stijging van 69 basispunten. Het VK rondde zijn vertrek uit de EU eind 2020 relatief ordelijk af. De overheid bemachtigde grote voorraden vaccins en engageerde zich om het vaccinatieprogramma snel uit te rollen.

In Europa steeg de rente minder. De regio had moeite met het uitvoeren van het vaccinatieprogramma terwijl een derde besmettingsgolf woekerde en diverse landen nog steeds in lockdown zaten. De rente op 10-jarig Duits schatkistpapier steeg van -0,52% naar -0,33%. De rente op 10-jarig Italiaans schatkistpapier daalde met 15 basispunten tot 0,63% waaruit het optimisme blijkt na de aankondiging van het corona-herstelfonds van de EU eind 2020, maar steeg sinds de jaarwissel opnieuw met 11 basispunten.

Bedrijfsobligaties deden het beter dan staatsobligaties, en hoogrentende obligaties boekten winst. Obligaties van beleggingskwaliteit noteerden een negatief totaalrendement van -0,7% (lokale valuta) in de periode, omdat stijgende rentevoeten negatieve rendementen veroorzaakten in het eerste kwartaal van 2021. Hoogrentende obligaties stegen met 7,2% (Bron: ICE BofAML).

Vooruitzichten

Het Schroder Economics team verwacht een groei van het wereldwijde bbp van 5,3% in 2021 en 4,6% in 2022. Voor 2021 zal het begrotingsbeleid in de VS een positief effect hebben, maar de groei in de eurozone zal waarschijnlijk negatief beïnvloed worden door de verlengde lockdownmaatregelen en de trage vooruitgang van de vaccinaties. Gezien de context voor de groeivoorzichten wordt er na een daling van het wereldwijde bbp met bijna 4% in 2020 voor 2021 een van de sterkste herstelperioden ooit verwacht voor de wereldeconomie, waarmee het herstel na de wereldwijde financiële crisis (Global Financial Crisis) wordt overtroffen.

Een sterkere groei brengt een stijging van de inflatie met zich mee, grotendeels veroorzaakt door hogere olie- en grondstoffenprijzen. Het Schroders Economics team verwacht dat de wereldwijde inflatie van de consumptieprijzen dit jaar zal stijgen naar 2,6% voor het terug licht zal dalen naar 2,4% in 2022.

Wat het monetair beleid betreft is er voldoende speling in de wereldeconomie om een sterke initiële opleving van de mondiale vraag op te vangen naarmate de economieën weer opengaan. In de VS ziet het Economics team de Federal Reserve de rente dit jaar of volgend jaar niet verhogen. Waarschijnlijk gebeurt dit niet voor eind 2023.

Dit jaar zal de dienstensector het waarschijnlijk overnemen van de industriële sector, die de groei tot nu toe heeft ondersteund, vanwege een zekere vorm van normalisatie door de vaccins en de heropening van dit aanzienlijke onderdeel van de economie. Een gevolg hiervan is dat het komende herstel naar verwachting meer zal worden aangestuurd door de serviceafhankelijke geavanceerde economieën dan na de wereldwijde financiële crisis (GFC).

Het is ook zo dat de opkomende economieën in vergelijking met tien jaar geleden niet het voordeel hebben van een enorme fiscale impuls van China. De pandemie vormt voor hen ook een grotere uitdaging dan voor hun rijkere burens omdat ze minder toegang hebben tot medische zorg en vaccins.

De Beleggingsbeheerders

Schroder GAIA

De informatie in dit verslag is van historische aard en vormt niet noodzakelijk een indicatie voor toekomstige resultaten.

Overzicht van het nettovermogen per 31 maart 2021

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
ACTIVA					
Beleggingen					
Effecten tegen kostprijs	115.179.221	1.804.454.778	308.965.686	731.942.426	392.624.033
Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/ (-vermindering)	895.988	(999.453)	40.633.214	200.477.747	35.779.571
Effecten tegen marktwaarde	116.075.209	1.803.455.325	349.598.900	932.420.173	428.403.604
Netto niet-gerealiseerde waardevermeerdering/ (-vermindering)					
op valutatermijncontracten	(1.582.751)	(11.822.992)	(1.624.064)	(18.202.804)	(3.335.660)
op spottransacties	-	-	-	-	-
op futurescontracten	177.904	-	-	-	(277.601)
op credit default swaps	-	-	-	-	-
op credit default index swaps	3.762.900	-	-	-	-
op cross-currency swaps	-	-	-	-	-
op renteswapcontracten	(788.267)	-	-	-	-
op total return swaps	-	-	-	29.725.481	10.981.932
op contracts for differences	596.649	-	12.372.716	-	1.734.717
	2.166.435	(11.822.992)	10.748.652	11.522.677	9.103.388
Te ontvangen voor verkochte effecten	261.102	9.159	5.248.044	27.406.203	5.838.431
Cash bij banken	15.657.891	46.705.573	36.876.242	7.771.668	82.585.920
Termijndeposito's	-	-	-	-	-
Broker Margin Account	2.436.830	-	-	-	5.643.678
Te ontvangen onderpand voor betaald onderpand	11.099.948	41.720.000	35.501.336	41.620.101	-
Te ontvangen voor inschrijvingen	1.743.231	6.922.617	-	-	7.711.628
Opties en swaptions tegen marktwaarde	-	-	466.321	573	337.791
Te ontvangen dividenden en rente	759.090	12.665.726	270.711	775.723	3.993.903
Te ontvangen fondsvergoedingen	45.032	-	-	-	4.556
Te ontvangen onderpand op termijncontracten voor categorieën met afgedekte valuta, netto	222.949	8.170.000	1.000.000	-	980.000
Te ontvangen calls voor onderpand op termijncontracten voor klassen met afgedekte valuta	270.000	90.000	220.000	2.560.000	80.000
Overige te ontvangen posten	-	-	-	9.259.744	-
TOTAAL ACTIVA	150.737.717	1.907.915.408	439.930.206	1.033.336.862	544.682.899
PASSIVA					
Beleggingen					
Short verkochte effecten, opbrengsten ontvangen	-	-	-	-	183.558
Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/ (-vermindering)	-	-	-	-	849
Effecten tegen marktwaarde	-	-	-	-	184.407
Te betalen voor aangekochte effecten	2.599.152	25.359.792	3.452.718	11.323.063	33.793.818
Te betalen voor aflossingen	233.943	4.211.476	-	-	1.600
Te betalen beheervergoedingen	149.582	1.578.075	482.795	1.264.570	171.189
Te betalen prestatievergoedingen	62.112	-	7.784.000	5.868.556	3.842.433
Te betalen dividenden en rente	5.095	-	1.333.179	646.905	698.649
Te betalen onderpand voor ontvangen onderpand	-	-	-	-	5.139.140
Te betalen onderpand op termijncontracten voor categorieën met afgedekte valuta, netto	-	-	-	2.560.000	-
Te betalen calls voor onderpand op termijncontracten voor klassen met afgedekte valuta	492.949	8.260.000	1.220.000	-	1.060.000
Overige te betalen posten en overlopende posten	2.381.790	42.465.740	5.794.857	1.175.821	4.867.869
TOTAAL PASSIVA	5.924.623	81.875.083	20.067.549	22.838.915	49.759.105
TOTAAL NETTOVERMOGEN	144.813.094	1.826.040.325	419.862.657	1.010.497.947	494.923.794

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Overzicht van het nettovermogen per 31 maart 2021 (vervolg)

	Schroder GAIA M&A* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Totaal** EUR
ACTIVA						
Beleggingen						
Effecten tegen kostprijs	5.243.571	322.489.006	464.975.042	29.609.804	354.702.723	3.980.389.737
Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/ (-vermindering)	(2.906)	63.181.959	72.098	127.058	23.144.589	339.371.090
Effecten tegen marktwaarde	5.240.665	385.670.965	465.047.140	29.736.862	377.847.312	4.319.760.827
Netto niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)						
op valutatermijncontracten	12.233	(634.496)	772.665	(215.486)	(80.391)	(34.057.263)
op spottransacties	-	-	27.183	-	-	23.180
op futurescontracten	(470)	-	8.007.609	8.430	471.646	7.155.035
op credit default swaps	-	-	-	-	(261.063)	(222.617)
op credit default index swaps	-	-	(148.063)	-	(294.231)	2.831.590
op cross-currency swaps	-	-	-	-	2.664.519	2.272.123
op renteswapcontracten	-	-	-	-	1.103.554	268.856
op total return swaps	-	(5.559.610)	18.587.592	-	533.487	50.654.449
op contracts for differences	16.173	-	-	74.904	-	12.640.503
	27.936	(6.194.106)	27.246.986	(132.152)	4.137.521	41.565.856
Te ontvangen voor verkochte effecten	10.179	808.165	158.599.392	104.752	48.539.383	214.545.514
Cash bij banken	5.736.579	36.409.486	358.085.435	2.847.690	32.685.193	535.330.420
Termijndeposito's	-	-	161.573.700	-	-	137.779.228
Broker Margin Account	11.040	-	62.031.917	-	23.116.048	79.508.411
Te ontvangen onderpand voor betaald onderpand	10.000	10.030.000	19.314.305	1.813.296	48.845.828	185.750.081
Te ontvangen voor inschrijvingen	-	1.921.118	-	-	-	15.603.815
Opties en swaptions tegen marktwaarde	550	-	-	78.407	4.353.306	4.491.116
Te ontvangen dividenden en rente	3.187	232.059	30.301	48.944	1.418.718	17.353.850
Te ontvangen fondsvergoedingen	-	-	-	-	-	42.285
Te ontvangen onderpand op termijncontracten voor klassen met afgedekte valuta, netto	-	720.000	1.443.278	80.000	700.000	11.381.014
Te ontvangen calls voor onderpand op termijncontracten voor klassen met afgedekte valuta	-	60.000	1.260.000	20.000	330.000	4.553.325
Overige te ontvangen posten	-	-	-	-	-	9.259.744
TOTAAL ACTIVA	11.040.136	429.657.687	1.254.632.454	34.597.799	541.973.309	5.576.925.486
PASSIVA						
Beleggingen						
Short verkochte effecten, opbrengsten ontvangen	-	-	-	-	-	156.526
Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/ (-vermindering)	-	-	-	-	-	724
Effecten tegen marktwaarde	-	-	-	-	-	157.250
Te betalen voor aangekochte effecten	4.060.613	2.980.723	163.107.965	-	49.222.785	253.991.751
Te betalen voor aflossingen	-	21.390.137	-	80.675	-	22.127.036
Te betalen beheervergoedingen	75	615.538	1.469.772	23.254	546.838	5.567.394
Te betalen prestatievergoedingen	-	46.378	-	754.492	5.252.011	21.240.839
Te betalen dividenden en rente	7.868	517.233	647.016	5.193	690.717	3.978.461
Te betalen onderpand voor ontvangen onderpand	-	-	-	-	-	4.382.314
Te betalen onderpand op termijncontracten voor klassen met afgedekte valuta, netto	-	-	-	-	-	2.560.000
Te betalen calls voor onderpand op termijncontracten voor klassen met afgedekte valuta	-	780.000	2.703.278	100.000	1.030.000	13.374.339
Overige te betalen posten en overlopende posten	5.303	4.306.444	13.716.464	79.200	5.567.352	68.725.070
TOTAAL PASSIVA	4.073.859	30.636.453	181.644.495	1.042.814	62.309.703	396.104.454
TOTAAL NETTOVERMOGEN	6.966.277	399.021.234	1.072.987.959	33.554.985	479.663.606	5.180.821.032

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

** Voor het totaal van het Overzicht van het nettovermogen, dat gepresenteerd is in euro, zijn activa en verplichtingen die luiden in een andere valuta dan de euro omgerekend tegen de volgende geldende wisselkoersen per 31 maart 2021: 1 euro = 1,17270 Amerikaanse dollar en 1 euro = 0,85065 Britse pond.

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Overzicht van het nettovermogen per 31 maart 2021 (vervolg)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Netto-inventariswaarde per 31 maart 2021	144.813.094	1.826.040.325	419.862.657	1.010.497.947	494.923.794
Uitstaande aandelen** per 31 maart 2021					
Categorie A Acc	17.833	374	231.877	463.026	9.504
Categorie A Acc CHF Hedged	100	-	1.600	-	411
Categorie A Acc EUR Hedged	348.933	-	51.094	-	75.269
Categorie A Acc GBP Hedged	-	-	-	13.307	-
Categorie A Acc SEK Hedged	-	100	-	-	-
Categorie A Acc SGD Hedged	100	-	100	-	140
Categorie A Acc USD Hedged	-	-	-	346.145	-
Categorie A Dis GBP	-	-	-	900	-
Categorie A1 Acc	-	-	38.865	24.045	-
Categorie A1 Acc USD Hedged	-	-	-	92.628	-
Categorie C Acc	274.380	843	1.190.173	1.702.326	19.216
Categorie C Acc BRL Hedged	71.225	-	-	-	-
Categorie C Acc CHF Hedged	4.563	819	28.861	-	100
Categorie C Acc EUR Hedged	82.240	5.314	855.125	-	331.577
Categorie C Acc GBP Hedged	283.037	100	223.513	264.782	58.326
Categorie C Acc SEK Hedged	-	-	88.326	-	-
Categorie C Acc SGD Hedged	-	-	100	-	140
Categorie C Acc USD Hedged	-	-	-	1.447.426	-
Categorie C Dis	-	-	-	5.793	-
Categorie C Dis GBP	-	-	-	9.767	-
Categorie C Dis GBP Hedged	185	-	-	-	-
Categorie C1 Acc	-	-	-	-	1
Categorie C1 Acc CHF Hedged	-	-	-	-	2
Categorie C1 Acc EUR Hedged	-	-	-	-	2
Categorie E Acc	84.090	-	24.739	1.475	375.335
Categorie E Acc CHF	19	-	-	-	-
Categorie E Acc CHF Hedged	128	-	3.030	-	5.523
Categorie E Acc EUR Hedged	5.000	-	59.005	-	305.201
Categorie E Acc GBP	18	-	-	-	-
Categorie E Acc GBP Hedged	90	-	51.079	-	37.102
Categorie E Acc SEK Hedged	-	-	52.883	-	-
Categorie E Acc SGD Hedged	-	-	100	-	140
Categorie E Dis GBP Hedged	120.006	-	-	-	-
Categorie F Acc	-	20.108	-	-	-
Categorie F Acc CHF Hedged	-	3.300	-	-	-
Categorie F Acc EUR Hedged	-	14.516	-	-	-
Categorie F Dis	-	222	-	-	-
Categorie F Dis SGD Hedged	-	477	-	-	-
Categorie I Acc	15	148.206	15	14	1.977.669
Categorie I Acc CHF Hedged	-	25.294	-	-	-
Categorie I Acc EUR Hedged	-	9	-	-	-
Categorie I Acc JPY Hedged	-	120	-	-	103
Categorie I Acc USD Hedged	-	-	-	65	-
Categorie IF Acc	-	182.884	-	-	-
Categorie IF Acc CHF Hedged	-	125.435	-	-	-
Categorie IF Acc EUR Hedged	-	452.008	-	-	-
Categorie IF Acc SEK Hedged	-	3.041.450	-	-	-
Categorie IF Dis QV	-	13.308	-	-	-
Categorie K Acc	-	-	-	-	-
Categorie K Acc CHF Hedged	-	-	-	-	-
Categorie K Acc EUR Hedged	-	-	-	-	-
Categorie K Acc USD Hedged	-	-	-	-	-
Categorie N Acc GBP Hedged	1.250	-	-	-	-
Categorie R Acc	-	-	-	-	-
Categorie R Acc EUR Hedged	-	-	-	-	-
Categorie R Acc USD Hedged	-	-	-	-	-
Categorie X Acc	-	-	-	304.909	-
Categorie X Acc EUR Hedged	-	-	-	-	661.167

** Raadpleeg de rubriek 'Aandelen categorieën' in de Toelichting bij de financiële overzichten voor de naamconventies die voor de Aandelen categorieën worden gebruikt.

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Overzicht van het nettovermogen per 31 maart 2021 (vervolg)

	Schroder GAIA M&A* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Netto-inventariswaarde per 31 maart 2021	6.966.277	399.021.234	1.072.987.959	33.554.985	479.663.606
Uitstaande aandelen** per 31 maart 2021					
Categorie A Acc	15	845.927	-	-	122.508
Categorie A Acc CHF Hedged	100	7.285	-	-	1.873
Categorie A Acc EUR Hedged	100	194.622	-	-	106.819
Categorie A Acc GBP Hedged	-	-	-	-	-
Categorie A Acc SEK Hedged	-	-	-	-	-
Categorie A Acc SGD Hedged	-	-	-	-	16.833
Categorie A Acc USD Hedged	-	-	-	-	-
Categorie A Dis GBP	-	-	-	-	-
Categorie A1 Acc	-	-	-	-	15
Categorie A1 Acc USD Hedged	-	-	-	-	-
Categorie C Acc	15	813.714	3.531.336	2.812	2.193.182
Categorie C Acc BRL Hedged	-	-	-	-	131.345
Categorie C Acc CHF Hedged	100	14.912	80.755	1.022	30.817
Categorie C Acc EUR Hedged	100	422.646	2.033.255	113.706	809.821
Categorie C Acc GBP Hedged	100	64.438	2.000.746	-	426.689
Categorie C Acc SEK Hedged	-	-	-	-	-
Categorie C Acc SGD Hedged	-	-	-	-	96
Categorie C Acc USD Hedged	-	-	-	20.673	-
Categorie C Dis	-	-	-	-	-
Categorie C Dis GBP	-	-	-	-	-
Categorie C Dis GBP Hedged	-	3.291	-	-	-
Categorie C1 Acc	-	-	-	-	1
Categorie C1 Acc CHF Hedged	-	-	-	-	6
Categorie C1 Acc EUR Hedged	-	-	-	-	43
Categorie E Acc	15	2.620	-	-	51.825
Categorie E Acc CHF	-	-	-	-	-
Categorie E Acc CHF Hedged	100	-	-	-	54.007
Categorie E Acc EUR Hedged	100	25.516	-	-	171.570
Categorie E Acc GBP	-	-	-	-	-
Categorie E Acc GBP Hedged	100	-	-	-	77.869
Categorie E Acc SEK Hedged	-	-	-	-	-
Categorie E Acc SGD Hedged	-	-	-	-	96
Categorie E Dis GBP Hedged	-	-	-	-	-
Categorie F Acc	-	-	-	-	-
Categorie F Acc CHF Hedged	-	-	-	-	-
Categorie F Acc EUR Hedged	-	-	-	-	-
Categorie F Dis	-	-	-	-	-
Categorie F Dis SGD Hedged	-	-	-	-	-
Categorie I Acc	68.704	15	15	15	15
Categorie I Acc CHF Hedged	-	-	-	-	-
Categorie I Acc EUR Hedged	-	-	-	-	-
Categorie I Acc JPY Hedged	-	-	-	-	-
Categorie I Acc USD Hedged	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc CHF Hedged	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc EUR Hedged	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc SEK Hedged	-	-	-	-	-
Categorie IF Dis QV	-	-	-	-	-
Categorie K Acc	-	-	1.100.844	-	-
Categorie K Acc CHF Hedged	-	-	3.174	-	-
Categorie K Acc EUR Hedged	-	-	100.747	95	-
Categorie K Acc USD Hedged	-	-	-	77	-
Categorie N Acc GBP Hedged	-	-	-	-	-
Categorie R Acc	-	-	-	131.801	-
Categorie R Acc EUR Hedged	-	-	-	27.965	-
Categorie R Acc USD Hedged	-	-	-	7.597	-
Categorie X Acc	-	15	-	-	-
Categorie X Acc EUR Hedged	-	168.216	-	-	-

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

** Raadpleeg de rubriek 'Aandelen categorieën' in de Toelichting bij de financiële overzichten voor de naamconventies die voor de Aandelen categorieën worden gebruikt.

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Overzicht van het nettovermogen per 31 maart 2021 (vervolg)

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Intrinsieke Waarde per Aandeel**					
per 31 maart 2021					
Categorie A Acc	98,12	1.446,87	136,34	216,71	116,22
Categorie A Acc CHF Hedged	85,78	-	127,05	-	110,33
Categorie A Acc EUR Hedged	88,52	-	128,69	-	111,18
Categorie A Acc GBP Hedged	-	-	-	202,54	-
Categorie A Acc SEK Hedged	-	902,81	-	-	-
Categorie A Acc SGD Hedged	133,79	-	189,08	-	114,77
Categorie A Acc USD Hedged	-	-	-	214,32	-
Categorie A Dis GBP	-	-	-	204,87	-
Categorie A1 Acc	-	-	135,90	203,62	-
Categorie A1 Acc USD Hedged	-	-	-	206,91	-
Categorie C Acc	100,67	1.453,03	140,19	232,73	118,08
Categorie C Acc BRL Hedged	95,35	-	-	-	-
Categorie C Acc CHF Hedged	88,29	1.148,17	132,08	-	112,97
Categorie C Acc EUR Hedged	90,28	1.207,10	132,03	-	113,66
Categorie C Acc GBP Hedged	95,90	103,29	108,28	215,87	115,85
Categorie C Acc SEK Hedged	-	-	1.094,72	-	-
Categorie C Acc SGD Hedged	-	-	193,21	-	117,02
Categorie C Acc USD Hedged	-	-	-	230,20	-
Categorie C Dis	-	-	-	232,10	-
Categorie C Dis GBP	-	-	-	220,39	-
Categorie C Dis GBP Hedged	96,05	-	-	-	-
Categorie C1 Acc	-	-	-	-	5.830,17
Categorie C1 Acc CHF Hedged	-	-	-	-	5.648,41
Categorie C1 Acc EUR Hedged	-	-	-	-	5.670,07
Categorie E Acc	103,68	-	140,80	230,91	120,13
Categorie E Acc CHF	91,97	-	-	-	-
Categorie E Acc CHF Hedged	89,46	-	131,37	-	114,68
Categorie E Acc EUR Hedged	92,82	-	132,50	-	115,54
Categorie E Acc GBP	99,76	-	-	-	-
Categorie E Acc GBP Hedged	99,35	-	107,85	-	117,44
Categorie E Acc SEK Hedged	-	-	1.091,29	-	-
Categorie E Acc SGD Hedged	-	-	194,46	-	118,95
Categorie E Dis GBP Hedged	98,93	-	-	-	-
Categorie F Acc	-	1.445,60	-	-	-
Categorie F Acc CHF Hedged	-	1.145,12	-	-	-
Categorie F Acc EUR Hedged	-	1.201,43	-	-	-
Categorie F Dis	-	1.174,61	-	-	-
Categorie F Dis SGD Hedged	-	1.570,97	-	-	-
Categorie I Acc	113,02	1.626,22	160,23	329,94	124,58
Categorie I Acc CHF Hedged	-	1.383,95	-	-	-
Categorie I Acc EUR Hedged	-	1.457,24	-	-	-
Categorie I Acc JPY Hedged	-	10.394,02	-	-	12.793,39
Categorie I Acc USD Hedged	-	-	-	265,73	-
Categorie IF Acc	-	1.489,50	-	-	-
Categorie IF Acc CHF Hedged	-	1.267,33	-	-	-
Categorie IF Acc EUR Hedged	-	1.334,54	-	-	-
Categorie IF Acc SEK Hedged	-	909,44	-	-	-
Categorie IF Dis QV	-	1.397,96	-	-	-
Categorie K Acc	-	-	-	-	-
Categorie K Acc CHF Hedged	-	-	-	-	-
Categorie K Acc EUR Hedged	-	-	-	-	-
Categorie K Acc USD Hedged	-	-	-	-	-
Categorie N Acc GBP Hedged	99,11	-	-	-	-
Categorie R Acc	-	-	-	-	-
Categorie R Acc EUR Hedged	-	-	-	-	-
Categorie R Acc USD Hedged	-	-	-	-	-
Categorie X Acc	-	-	-	231,33	-
Categorie X Acc EUR Hedged	-	-	-	-	114,27

** De Intrinsieke Waarde per Aandeel van elke Aandelencategorie is vermeld in de valuta van de Aandelencategorie.

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Overzicht van het nettovermogen per 31 maart 2021 (vervolg)

	Schroder GAIA M&A* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Intrinsieke Waarde per Aandeel**					
per 31 maart 2021					
Categorie A Acc	99,75	147,01	-	-	108,72
Categorie A Acc CHF Hedged	99,46	175,66	-	-	100,77
Categorie A Acc EUR Hedged	99,55	132,33	-	-	101,64
Categorie A Acc GBP Hedged	-	-	-	-	-
Categorie A Acc SEK Hedged	-	-	-	-	-
Categorie A Acc SGD Hedged	-	-	-	-	149,60
Categorie A Acc USD Hedged	-	-	-	-	-
Categorie A Dis GBP	-	-	-	-	-
Categorie A1 Acc	-	-	-	-	107,32
Categorie A1 Acc USD Hedged	-	-	-	-	-
Categorie C Acc	99,87	153,44	111,42	112,07	110,76
Categorie C Acc BRL Hedged	-	-	-	-	108,86
Categorie C Acc CHF Hedged	99,58	181,10	100,79	141,67	102,75
Categorie C Acc EUR Hedged	99,67	137,71	102,68	126,78	103,59
Categorie C Acc GBP Hedged	99,78	143,24	106,49	-	85,10
Categorie C Acc SEK Hedged	-	-	-	-	-
Categorie C Acc SGD Hedged	-	-	-	-	152,48
Categorie C Acc USD Hedged	-	-	-	149,48	-
Categorie C Dis	-	-	-	-	-
Categorie C Dis GBP	-	-	-	-	-
Categorie C Dis GBP Hedged	-	143,14	-	-	-
Categorie C1 Acc	-	-	-	-	5.541,13
Categorie C1 Acc CHF Hedged	-	-	-	-	5.135,24
Categorie C1 Acc EUR Hedged	-	-	-	-	5.177,41
Categorie E Acc	99,91	163,74	-	-	112,53
Categorie E Acc CHF	-	-	-	-	-
Categorie E Acc CHF Hedged	99,62	-	-	-	104,15
Categorie E Acc EUR Hedged	99,71	147,61	-	-	105,12
Categorie E Acc GBP	-	-	-	-	-
Categorie E Acc GBP Hedged	99,82	-	-	-	86,43
Categorie E Acc SEK Hedged	-	-	-	-	-
Categorie E Acc SGD Hedged	-	-	-	-	154,94
Categorie E Dis GBP Hedged	-	-	-	-	-
Categorie F Acc	-	-	-	-	-
Categorie F Acc CHF Hedged	-	-	-	-	-
Categorie F Acc EUR Hedged	-	-	-	-	-
Categorie F Dis	-	-	-	-	-
Categorie F Dis SGD Hedged	-	-	-	-	-
Categorie I Acc	99,96	196,11	128,81	117,84	117,51
Categorie I Acc CHF Hedged	-	-	-	-	-
Categorie I Acc EUR Hedged	-	-	-	-	-
Categorie I Acc JPY Hedged	-	-	-	-	-
Categorie I Acc USD Hedged	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc CHF Hedged	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc EUR Hedged	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc SEK Hedged	-	-	-	-	-
Categorie IF Dis QV	-	-	-	-	-
Categorie K Acc	-	-	109,15	-	-
Categorie K Acc CHF Hedged	-	-	98,70	-	-
Categorie K Acc EUR Hedged	-	-	100,41	124,66	-
Categorie K Acc USD Hedged	-	-	-	146,94	-
Categorie N Acc GBP Hedged	-	-	-	-	-
Categorie R Acc	-	-	-	112,02	-
Categorie R Acc EUR Hedged	-	-	-	126,81	-
Categorie R Acc USD Hedged	-	-	-	149,49	-
Categorie X Acc	-	101,46	-	-	-
Categorie X Acc EUR Hedged	-	146,56	-	-	-

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

** De Intrinsieke Waarde per Aandeel van elke Aandelen categorie is vermeld in de valuta van de Aandelen categorie.

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Winst-en-verliesrekening voor de periode afgesloten op 31 maart 2021

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
INKOMSTEN					
Nettodividenden	-	-	-	282.691	6.603.640
Obligatierente	856.651	40.506.712	-	-	109.970
Netto-inkomsten op swaps	726.836	-	-	-	-
Bankrente	79	274	4.453	-	-
Overige inkomsten	81.864	-	-	-	-
Totaal Inkomsten	1.665.430	40.506.986	4.453	282.691	6.713.610
KOSTEN					
Prestatievergoedingen	62.112	-	7.784.000	5.895.379	3.842.454
Beheervergoedingen	661.147	7.937.930	2.130.694	7.013.938	748.923
Nettodividendkosten	-	-	1.871.782	-	-
Nettoswapkosten	-	-	987.804	1.302.160	1.062.086
Bewaarvergoedingen	40.771	208.312	42.266	131.996	62.413
Administratiekosten	186.116	1.256.451	517.397	1.579.013	237.837
Taxe d'abonnement	32.573	90.853	93.526	238.334	49.908
Distributievergoedingen	-	-	10.779	51.153	-
Afschrijving van oprichtingskosten	3.770	-	-	-	-
Bank- en rentekosten	16.798	3.775	26	188.642	26.279
Overige kosten	35.166	251.072	88.224	1.404.533	89.529
Totaal Kosten	1.038.453	9.748.393	13.526.498	17.805.148	6.119.429
Minus: Kostensubsidie	(45.032)	-	-	-	(4.556)
NETTOBELEGGINGSINKOMSTEN/(-VERLIES)	672.009	30.758.593	(13.522.045)	(17.522.457)	598.737

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Winst-en-verliesrekening voor de periode afgesloten op 31 maart 2021 (vervolg)

	Schroder GAIA M&A* USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Totaal** EUR
INKOMSTEN						
Nettodividenden	-	1.310.605	248	300.556	541.268	7.846.524
Obligatierente	-	406.048	58.801	178.483	2.267.767	37.905.693
Netto-inkomsten op swaps	-	-	-	-	-	619.797
Bankrente	39	5.582	-	-	198	9.060
Overige inkomsten	-	52.460	-	-	9.749	122.856
Totaal Inkomsten	39	1.774.695	59.049	479.039	2.818.982	46.503.930
KOSTEN						
Prestatievergoedingen	-	46.378	-	754.492	5.252.011	21.267.679
Beheervergoedingen	137	3.713.603	9.282.878	194.215	3.192.029	30.835.108
Nettodividendkosten	206	-	-	-	-	1.596.306
Nettoswapkosten	3.635	2.069.794	6.624.193	166.253	1.860.370	12.248.761
Bewaarvergoedingen	843	64.517	168.179	7.485	128.787	751.427
Administratiekosten	876	771.521	1.984.080	60.795	802.581	6.559.546
Taxe d'abonnement	145	107.891	289.358	10.619	116.939	916.967
Distributievergoedingen	-	-	-	-	4	60.348
Afschrijving van oprichtingskosten	-	-	-	-	-	3.215
Bank- en rentekosten	-	150	183.163	1.984	60.514	438.868
Overige kosten	249	112.022	341.287	12.426	135.415	2.317.038
Totaal Kosten	6.091	6.885.876	18.873.138	1.208.269	11.548.650	76.995.263
Minus: Kostensubsidie	-	-	-	-	-	(42.286)
NETTOBELEGGINGSINKOMSTEN/(-VERLIJES)	(6.052)	(5.111.181)	(18.814.089)	(729.230)	(8.729.668)	(30.449.047)

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

** Voor het totaal van de Winst-en-verliesrekening, die gepresenteerd is in euro, zijn activa en verplichtingen die luiden in een andere valuta dan de euro omgerekend tegen de volgende geldende wisselkoersen per 31 maart 2021: 1 euro = 1,17270 Amerikaanse dollar en 1 euro = 0,85065 Britse pond.

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Mutatieoverzicht van het nettovermogen voor de periode afgesloten op 31 maart 2021

	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
NETTOBELEGGINGS-WINST/(-VERLIES)***	672.009	30.758.593	(13.522.045)	(17.522.457)	598.737
Netto gerealiseerde winsten/(verliezen)					
op verkochte effecten	230.318	(6.877.147)	62.767.036	121.874.512	29.001.189
op valutatermijncontracten	5.165.501	(9.128.190)	1.447.457	(232.439)	3.311.251
op spottransacties	-	-	-	-	-
op futurescontracten	4.309.906	-	(647)	-	(15.895.266)
op credit default swaps	-	-	-	-	-
op credit default index swaps	(2.231.834)	-	-	-	-
op cross-currency swaps	-	-	-	-	-
op renteswapcontracten	(1.215.556)	-	-	-	-
op total return swaps	-	-	-	(106.006.687)	(108.822.802)
op contracts for differences	-	-	(33.938.523)	-	105.935.170
op opties en swaptions	418.573	-	1.658.197	(271.635)	(2.871.730)
op vreemde valuta's op andere nettoactiva	276.639	(217.048)	66.378	(5.369.750)	1.153.693
Netto gerealiseerde winst/(verlies)	6.953.547	(16.222.385)	31.999.898	9.994.001	11.811.505
Nettowijziging in niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)					
op beleggingen	6.607.528	10.122.129	5.836.362	36.007.708	28.326.917
op valutatermijncontracten	(958.860)	(12.369.325)	(2.116.436)	(12.558.692)	(3.081.054)
op spottransacties	-	-	-	-	-
op futurescontracten	(650.494)	-	-	-	(1.118.363)
op credit default swaps	-	-	-	-	-
op credit default index swaps	2.245.623	-	-	-	-
op cross-currency swaps	-	-	-	-	-
op renteswapcontracten	98.110	-	-	-	-
op total return swaps	-	-	-	15.765.553	3.755.966
op contracts for differences	684.540	-	10.123.992	-	3.609.927
op opties en swaptions	784	-	(309.800)	98.204	(30.883)
op vreemde valuta's op andere nettoactiva	24.116	(51.974)	(601)	2.484	(68.968)
NETTOWIJZIGING IN NIET-GEREALISEERDE WAARDEVERMEERDERING/(-VERMINDERING)	8.051.347	(2.299.170)	13.533.517	39.315.257	31.393.542
NETTOWIJZIGING IN TOTAAL NETTOACTIVA ALS GEVOLG VAN TRANSACTIES	15.676.903	12.237.038	32.011.370	31.786.801	43.803.784
Netto-opbrengst uit de uitgifte van aandelen	51.348.091	695.532.256	206.043.591	99.375.150	84.156.600
Te betalen voor teruggekochte aandelen	(10.149.826)	(124.938.761)	(47.487.754)	(136.117.809)	(37.225.124)
Uitkeringen uit netto beleggingswinst	-	(233.016)	-	-	-
Stijging/(daling) in het nettovermogen over de periode	56.875.168	582.597.517	190.567.207	(4.955.858)	90.735.260
Nettovermogen aan het begin van de periode	87.937.926	1.243.442.808	229.295.450	1.015.453.805	404.188.534
Nominale valuta-aanpassing****	-	-	-	-	-
NETTOVERMOGEN AAN HET EIND VAN DE PERIODE	144.813.094	1.826.040.325	419.862.657	1.010.497.947	494.923.794

*** Raadpleeg de Winst-en-verliesrekening voor de berekening van de Nettobeleggingswinst/(het Nettobeleggingsverlies)

**** Deze aanpassing weerspiegelt het verschil tussen het beginsaldo volgens de wisselkoers per 30 september 2020 en dezelfde nettoactiva volgens de koers per 31 maart 2021.

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Mutatieoverzicht van het nettovermogen voor de periode afgesloten op 31 maart 2021 (vervolg)

	Schroder GAIA M&A* USD	Schroder GAIA Sirius US Equity USD	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund GBP	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Totaal** EUR
NETTOBELEGGINGS-WINST/(-VERLIES)***	(6.052)	(5.111.181)	(18.814.089)	(729.230)	(8.729.668)	(30.449.047)
Netto gerealiseerde winsten/(verliezen)						
op verkochte effecten	32.991	90.973.571	776.145	151.529	51.707.451	316.997.266
op valutatermijncontracten	(1.349)	737.673	17.726.461	(1.802.368)	12.024.361	24.324.925
op spottransacties	-	-	449.533	-	-	383.332
op futurescontracten	(4.600)	(287)	36.783.690	(412.770)	3.510.528	23.991.029
op credit default swaps	-	-	-	-	(764.848)	(652.211)
op credit default index swaps	-	-	619.941	-	(574.432)	(1.864.352)
op cross-currency swaps	-	-	-	-	(1.186.345)	(1.011.636)
op renteswapcontracten	-	-	-	-	1.699.842	412.967
op total return swaps	-	(48.715.545)	(114.900.932)	-	(28.488.617)	(362.617.839)
op contracts for differences	(27.798)	-	-	430.499	-	61.876.299
op opties en swaptions	(1.825)	-	-	(111.775)	(2.909.006)	(3.563.086)
op vreemde valuta's op andere nettoactiva	(12.545)	1.602.642	(37.875)	2.868	4.077.064	525.110
Netto gerealiseerde winst/(verlies)	(15.126)	44.598.054	(58.583.037)	(1.742.017)	39.095.998	58.801.804
Nettowijziging in niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)						
op beleggingen	(2.906)	13.448.351	(253.857)	7.612.584	13.643.502	111.238.145
op valutatermijncontracten	12.233	(1.547.001)	(7.187.078)	192.445	(5.761.952)	(40.480.725)
op spottransacties	-	-	30.977	-	-	26.415
op futurescontracten	(470)	-	7.078.825	27.520	718.026	5.172.221
op credit default swaps	-	-	-	-	(782.320)	(667.110)
op credit default index swaps	-	-	(273.763)	-	(120.678)	1.578.564
op cross-currency swaps	-	-	-	-	4.496.224	3.834.079
op renteswapcontracten	-	-	-	-	1.524.278	1.383.464
op total return swaps	-	(8.662.289)	22.434.784	-	(2.331.790)	28.724.256
op contracts for differences	16.173	-	-	159.218	-	12.496.060
op opties en swaptions	(6.535)	-	-	(22.843)	(886.828)	(980.293)
op vreemde valuta's op andere nettoactiva	47	(6.117)	(95.949)	-	(3.073.328)	(2.788.319)
NETTOWIJZIGING IN NIET-GEREALISEERDE WAARDEVERMEERDERING/(-VERMINDERING)	18.542	3.232.944	21.733.939	7.968.924	7.425.134	119.536.757
NETTOWIJZIGING IN TOTAAL NETTOACTIVA ALS GEVOLG VAN TRANSACTIES	(2.636)	42.719.817	(55.663.187)	5.497.677	37.791.464	147.889.514
Netto-opbrengst uit de uitgifte van aandelen	6.968.913	59.701.497	150.194.308	399.010	58.423.440	1.218.944.332
Te betalen voor teruggekochte aandelen	-	(199.829.209)	(458.682.725)	(25.574.145)	(168.441.670)	(1.058.784.810)
Uitkeringen uit netto beleggingswinst	-	-	-	-	-	(198.700)
Stijging/(daling) in het nettovermogen over de periode	6.966.277	(97.407.895)	(364.151.604)	(19.677.458)	(72.226.766)	307.850.336
Nettovermogen aan het begin van de periode	-	496.429.129	1.437.139.563	53.232.443	551.890.372	4.869.786.470
Nominale valuta-aanpassing****	-	-	-	-	-	3.184.226
NETTOVERMOGEN AAN HET EIND VAN DE PERIODE	6.966.277	399.021.234	1.072.987.959	33.554.985	479.663.606	5.180.821.032

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

** Voor het totaal van het Mutatieoverzicht van het nettovermogen, dat gepresenteerd is in euro, zijn activa en verplichtingen die luiden in een andere valuta dan de euro omgerekend tegen de volgende geldende wisselkoersen per 31 maart 2021: 1 euro = 1,17270 Amerikaanse dollar en 1 euro = 0,85065 Britse pond.

*** Raadpleeg de Winst-en-verliesrekening voor de berekening van de Nettobeleggingswinst/(het Nettobeleggingsverlies)

**** Deze aanpassing weerspiegelt het verschil tussen het beginsaldo volgens de wisselkoers per 30 september 2020 en dezelfde nettoactiva volgens de koers per 31 maart 2021.

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Spreiding van beleggingen per sector

	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Obligaties, handelspapier, door vermogen en door hypotheek gedekte effecten	80,16	98,76	-	-	30,99
Overige effecten					
Ruimtevaart & Defensie	-	-	-	-	-
Landbouw	-	-	-	-	-
Luchtvaartmaatschappijen	-	-	-	-	-
Kleding	-	-	-	-	-
Autofabrikanten	-	-	-	-	-
Auto-onderdelen en -uitrusting	-	-	-	-	0,24
Banken	-	-	-	0,72	8,86
Dranken	-	-	-	-	0,30
Biotechnologie	-	-	-	-	0,01
Bouwmaterialen	-	-	-	0,89	0,33
Chemische producten	-	-	-	4,18	1,04
Commerciële diensten	-	-	3,97	5,13	0,21
Computers	-	-	5,66	-	0,70
Distributie en groothandel	-	-	-	-	-
Gediversifieerde financiële diensten	-	-	-	6,36	2,05
Elektrisch	-	-	-	-	0,02
Elektrische onderdelen en instrumenten	-	-	-	-	0,60
Elektronica	-	-	4,10	-	1,27
Energie - Alternatieve bronnen	-	-	-	-	0,04
Bouw en techniek	-	-	-	-	0,03
Amusement	-	-	-	-	-
Milieubeheer	-	-	-	-	0,12
Voeding	-	-	-	-	1,68
Gas	-	-	-	-	-
Gezondheidszorg - producten	-	-	-	-	0,16
Gezondheidszorg - diensten	-	-	-	3,04	0,72
Houdstermaatschappijen - Gediversifieerd	-	-	-	-	0,37
Woningbouw	-	-	-	4,61	0,03
Woninginrichting	-	-	-	-	1,26
Huisraad	-	-	-	-	0,63
Verzekeringen	-	-	-	-	0,48
Internet	-	-	22,20	27,13	2,01
Beleggingsmaatschappijen	-	-	-	1,96	6,39
IJzer en Staal	-	-	-	-	0,56
Vrije tijd	-	-	-	-	0,18
Logies	-	-	-	-	-
Machines - Bouw & mijnbouw	-	-	-	-	0,65
Machines - Diverse producten	-	-	-	-	0,94
Media	-	-	6,13	8,00	-
Mijnbouw	-	-	-	-	1,65
Gemengde productie	-	-	-	-	0,58
Olie en gas	-	-	-	-	5,22
Olie- en gasdiensten	-	-	-	-	-
Verpakking en containers	-	-	-	-	-
Farmaceutische producten	-	-	-	-	1,04

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Spreiding van beleggingen per sector (vervolg)

	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Overige effecten (vervolg)					
Pijpleidingen	-	-	-	-	-
Vastgoed	-	-	4,64	0,49	0,16
Detailhandel	-	-	-	4,65	1,95
Spaar- en leenbanken	-	-	-	-	-
Halfgeleiders	-	-	11,90	4,63	10,95
Software	-	-	24,46	6,86	1,22
Opslag en warehousing	-	-	-	-	-
Telecommunicatie	-	-	0,21	3,93	0,65
Textiel	-	-	-	-	-
Speelgoed, games en hobby's	-	-	-	-	-
Transport	-	-	-	9,69	0,23
Beleggingsportefeuille als percentage van het nettovermogen	80,16	98,76	83,27	92,27	86,52
Termijndeposito's	-	-	-	-	-
Overige Nettoactiva	19,84	1,24	16,73	7,73	13,48
Totaal Nettovermogen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Spreiding van beleggingen per sector (vervolg)

	Schroder GAIA M&A* %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Obligaties, handelspapier, door vermogen en door hypotheek gedekte effecten	58,14	2,55	42,87	47,15	46,80
Overige effecten					
Ruimtevaart & Defensie	-	3,40	-	-	0,07
Landbouw	-	0,64	-	-	-
Luchtvaartmaatschappijen	-	1,62	-	-	-
Kleding	-	-	-	-	0,09
Autofabrikanten	-	-	-	-	0,22
Auto-onderdelen en -uitrusting	-	2,61	-	-	-
Banken	-	4,37	-	-	5,69
Dranken	-	1,70	-	2,08	0,22
Biotechnologie	-	-	-	-	3,26
Bouwmaterialen	-	0,82	-	-	0,24
Chemische producten	1,76	2,21	-	-	0,18
Commerciële diensten	3,65	8,87	-	5,32	1,36
Computers	0,88	0,90	-	3,33	0,27
Distributie en groothandel	-	-	-	-	0,15
Gediversifieerde financiële diensten	1,47	4,29	-	-	2,12
Elektrisch	-	0,39	-	-	0,94
Elektrische onderdelen en instrumenten	-	-	-	-	0,13
Elektronica	0,86	2,04	-	1,82	0,23
Energie - Alternatieve bronnen	-	0,11	-	-	0,02
Bouw en techniek	0,98	4,36	-	-	0,32
Amusement	-	-	-	2,00	0,04
Milieubeheer	-	0,74	-	-	-
Voeding	-	-	-	-	-
Gas	-	-	-	-	0,08
Gezondheidszorg - producten	-	10,06	-	2,01	1,47
Gezondheidszorg - diensten	-	-	-	-	0,52
Houdstermaatschappijen - Gediversifieerd	-	-	-	-	1,08
Woningbouw	-	1,60	-	-	0,19
Woninginrichting	-	-	-	-	-
Huisraad	-	-	-	3,44	-
Verzekeringen	1,00	0,20	-	-	2,91
Internet	2,58	-	-	-	0,31
Beleggingsmaatschappijen	-	-	0,47	1,24	0,11
IJzer en Staal	-	-	-	-	0,09
Vrije tijd	-	2,11	-	2,00	0,20
Logies	-	-	-	-	0,12
Machines - Bouw & mijnbouw	-	-	-	-	0,19
Machines - Diverse producten	1,67	0,84	-	1,30	0,27
Media	-	1,63	-	-	0,05
Mijnbouw	-	0,13	-	-	0,45
Gemengde productie	-	-	-	2,88	0,14
Olie en gas	-	1,46	-	-	4,26
Olie- en gasdiensten	-	2,50	-	-	0,09
Verpakking en containers	-	1,94	-	-	-
Farmaceutische producten	-	3,47	-	-	1,78

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode. De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Spreiding van beleggingen per sector (vervolg)

	Schroder GAIA M&A* %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Overige effecten (vervolg)					
Pijpleidingen	-	-	-	-	0,13
Vastgoed	-	0,66	-	3,11	0,29
Detailhandel	1,02	4,84	-	3,70	0,46
Spaar- en leenbanken	-	-	-	-	0,01
Halfgeleiders	-	7,67	-	-	0,29
Software	1,22	7,58	-	4,52	0,39
Opslag en warehousing	-	-	-	2,72	-
Telecommunicatie	-	3,09	-	-	0,11
Textiel	-	0,86	-	-	-
Speelgoed, games en hobby's	-	0,90	-	-	-
Transport	-	3,49	-	-	0,43
Beleggingsportefeuille als percentage van het nettovermogen	75,23	96,65	43,34	88,62	78,77
Termijndeposito's	-	-	15,06	-	-
Overige Nettoactiva	24,77	3,35	41,60	11,38	21,23
Totaal Nettovermogen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode. De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021

Schroder GAIA BlueTrend

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Obligaties			
Verenigde Staten		105.166.006	72,63
10.100.000	United States Treasury Note 15/04/21, 2,38%	10.109.030	6,97
9.100.000	United States Treasury Note 15/05/21, 3,13%	9.133.891	6,31
2.800.000	United States Treasury Note 15/07/21, 2,63%	2.821.082	1,95
3.200.000	United States Treasury Note 15/08/21, 2,13%	3.224.871	2,23
6.800.000	United States Treasury Note 15/10/21, 2,88%	6.903.434	4,77
7.000.000	United States Treasury Note 30/11/21, 1,75%	7.079.220	4,89
4.000.000	United States Treasury Note 15/12/21, 2,63%	4.072.318	2,81
7.000.000	United States Treasury Note 15/01/22, 2,50%	7.134.273	4,93
6.000.000	United States Treasury Note 15/02/22, 2,00%	6.101.079	4,21
7.000.000	United States Treasury Note 15/03/22, 2,38%	7.152.436	4,94
3.500.000	United States Treasury Note 15/07/22, 1,75%	3.574.375	2,47
8.000.000	United States Treasury Note 15/10/22, 1,38%	8.153.438	5,63
9.000.000	United States Treasury Note 15/11/22, 1,63%	9.217.617	6,37
9.000.000	United States Treasury Note 15/12/22, 1,63%	9.228.340	6,37
6.700.000	United States Treasury Note 15/01/23, 1,50%	6.862.004	4,74
4.300.000	United States Treasury Note 15/02/23, 1,38%	4.398.598	3,04
Totaal Obligatievermogen		105.166.006	72,63
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs		105.166.006	72,63
Aantal aandelen of hoofdsom	Overige effecten	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Obligaties			
Ierland		10.909.203	7,53
502.728.236	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	10.909.203	7,53
Totaal Obligatievermogen		10.909.203	7,53
Totaal Overige effecten		10.909.203	7,53
Totaal Beleggingen		116.075.209	80,16
Overige Nettoactiva		28.737.885	19,84
Netto-inventariswaarde		144.813.094	100,00

Schroder GAIA Cat Bond

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Obligaties			
Bermuda		616.724.733	33,77
14.563.000	3264 Re 07/02/23, variable	15.018.094	0,82
31.250.000	Acorn Re 10/11/21, variable	31.585.937	1,73
20.400.000	Bowline Re Series 2018-1 23/05/22, variable	20.723.339	1,13
4.250.000	Bowline Re Series 2019-1A 20/03/23, variable	4.372.613	0,24
10.350.000	Bowline Re Series 2019-1B 20/03/23, variable	10.648.598	0,58
31.350.000	Cape Lookout Re 25/02/22, variable	31.611.772	1,73
4.000.000	Cerulean Re SAC 08/07/21, variable	4.020.000	0,22
20.170	Eden Re II Series A 22/03/22, ZCP	275.064	0,02
6.006	Eden Re II Series B 22/03/22, ZCP	205.255	0,01
19.873	Eden Re II Series A 22/03/23, ZCP	373.159	0,02
13.309	Eden Re II Series B 22/03/23, ZCP	656.572	0,04
1.800.000	Eden Re II 22/03/24, ZCP	2.387.880	0,13
7.200.000	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP	7.276.320	0,40
16.200.000	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP	16.344.180	0,90
17.500.000	FloodSmart Re Series A 07/03/22, variable	17.563.874	0,96
3.000.000	FloodSmart Re Series B 07/03/22, variable	3.010.950	0,16
6.500.000	FloodSmart Re Series A 27/02/23, variable	6.589.375	0,36
9.750.000	FloodSmart Re Series B 27/02/23, variable	9.884.063	0,54
4.700.000	Galileo Re Series C 08/01/24, variable	4.751.230	0,26
3.750.000	Galileo Re Series D 08/01/24, variable	3.803.625	0,21
2.400.000	Herbie Re 08/01/25, variable	2.559.240	0,14
5.000.000	Integrity Re 12/06/23, variable	5.099.750	0,28
7.750.000	Integrity Re II 12/04/23, variable	8.080.344	0,44
19.825.000	Kilimanjaro II Re Series ** 20/04/21, variable	19.929.080	1,09
22.000.000	Kilimanjaro II Re Series A-1 20/04/21, variable	22.126.499	1,21
4.750.000	Kilimanjaro II Re 21/04/22, variable	4.830.038	0,26

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Cat Bond (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen	Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
2.850.000	Kilimanjaro II Re Series * 21/04/22, variable	2.887.763	0,16	2.800.000	Sanders Re 07/04/22, variable	2.390.500	0,13
15.450.000	Kilimanjaro II Re Series ** 21/04/22, variable	15.713.423	0,86	15.250.000	Sanders Re II 07/04/23, variable	2.287.500	0,13
5.250.000	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/23, variable	5.469.188	0,30	5.270.000	Sanders Re II 07/06/23, variable	5.395.163	0,30
10.250.000	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/23, variable	10.441.163	0,57	7.125.000	Sanders Re II 07/04/24, variable	7.227.778	0,40
5.250.000	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variable	5.501.213	0,30	5.950.000	Spectrum Capital Series A 08/06/21, variable	5.999.683	0,33
9.087.000	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variable	9.281.916	0,51	4.500.000	Sutter Re Series A 06/06/22, variable	4.634.775	0,25
3.950.000	Kilimanjaro Re Series A1 06/05/22, variable	3.977.058	0,22	7.000.000	Sutter Re Series F 06/06/22, variable	7.219.450	0,40
18.600.000	Kilimanjaro Re Series B1 06/05/22, variable	18.786.929	1,03	4.500.000	Sutter Re Series A 23/05/23, variable	4.684.275	0,26
4.500.000	Kilimanjaro Re Series A2 05/05/23, variable	4.576.275	0,25	7.500.000	Sutter Re Series F 23/05/23, variable	7.860.375	0,43
17.600.000	Kilimanjaro Re Series B2 05/05/23, variable	17.854.319	0,98	14.800.000	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variable	15.006.460	0,82
8.650.000	Kizuna Re II Series A 11/04/23, variable	8.701.468	0,48	14.900.000	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variable	15.076.565	0,83
1.750.000	Kizuna Re II Series B 11/04/23, variable	1.762.163	0,10	9.550.000	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variable	9.673.673	0,53
1.750.000	Manatee Re III Series A 07/06/22, variable	1.756.913	0,10	6.920.000	Voussoir Re 01/03/24, variable	6.953.908	0,38
1.750.000	Manatee Re III Series B 07/06/22, variable	1.754.988	0,10	1.460.000	Voussoir Re perpetual, variable	257.325	0,01
5.750.000	Merna Re 08/04/21, variable	5.768.688	0,32	Ierland		22.205.954	1,22
18.312.000	Merna Reinsurance II 07/04/22, variable	18.385.247	1,01	7.856.000	Azzurro Re II DAC 17/01/24, variable	9.281.827	0,51
7.000.000	Mona Lisa Re Series A 09/01/23, variable	7.142.450	0,39	10.966.000	Hexagon II Reinsurance DAC 17/01/24, variable	12.924.127	0,71
9.714.000	Mona Lisa Re Series B 09/01/23, variable	9.900.995	0,54	Singapore		24.126.713	1,32
14.250.000	Mystic Re IV 08/01/24, variable	14.602.688	0,80	5.000.000	Alamo Re II 08/06/23, variable	5.246.250	0,29
15.690.000	Nakama Re 14/01/25, variable	15.776.295	0,86	2.250.000	Casablanca Re 07/06/21, ZCP	2.230.988	0,12
19.000.000	Northshore Re II 08/07/22, variable	19.432.249	1,06	9.783.000	Easton Re 08/01/24, variable	9.883.275	0,54
10.500.000	Northshore Re II 07/07/23, variable	11.038.125	0,60	6.750.000	Kizuna Re III 07/04/26, variable	6.766.200	0,37
6.462.000	Northshore Re II 08/01/24, variable	6.633.243	0,36	Supernationaal		30.706.768	1,68
8.884.000	Phoenician Re 14/12/23, variable	9.018.148	0,49	3.450.000	International Bank for Reconstruction & Development Series A 02/12/22, variable	3.459.660	0,19
23.029.000	Phoenician Re Series A 14/12/23, variable	23.392.857	1,28	14.800.000	International Bank for Reconstruction & Development Series B 02/12/22, variable	14.838.479	0,81
5.000.000	Power Protective Re 15/12/23, variable	5.013.000	0,27	3.697.000	International Bank for Reconstruction & Development Series A 13/03/24, variable	3.746.910	0,21
13.750.000	Sanders Re 06/12/21, variable	13.761.688	0,75				

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Cat Bond (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
1.550.000	International Bank for Reconstruction & Development Series B 13/03/24, variable	1.565.500	0,09
2.250.000	International Bank for Reconstruction & Development Series C 13/03/24, variable	2.276.156	0,12
4.750.000	International Bank for Reconstruction & Development Series D 13/03/24, variable	4.820.063	0,26
Verenigd Koninkrijk		1.758.138	0,10
1.750.000	Atlas Capital UK 2019 07/06/23, variable	1.758.138	0,10
Totaal Obligatievermogen		695.522.306	38,09
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs		695.522.306	38,09

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Obligaties			
Bermuda			
7.308.000	2001 Cat Re 08/01/24, variable	7.594.839	0,42
19.900.000	Akibare Re 07/04/22, variable	20.039.299	1,10
9.091.085	Akibare Re 07/04/23, variable	30.910	-
16.700.000	Aozora Re 07/04/21, variable	16.783.500	0,92
3.250.000	Armor Re II 08/06/22, variable	3.312.238	0,18
9.780.000	Bonanza Re 20/02/24, variable	9.904.695	0,54
16.996.000	Bonanza Re 23/12/24, variable	17.209.300	0,94
7.500.000	Cape Lookout Re 09/05/22, variable	7.569.375	0,42
17.917.000	Cape Lookout Re 22/03/24, variable	17.952.834	0,98
816.477	Citrus Re 20/03/23, variable	490.662	0,03
2.700.000	Aangeduid als Randolph Re 2020-1 06/07/21, ZCP	2.628.315	0,14
18.474.000	Everglades Re II 04/05/21, variable	18.576.531	1,02
8.000.000	Everglades Re II 04/05/23, variable	8.211.600	0,45

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
8.925.000	First Coast Re 2017-1 07/06/21, variable	8.984.351	0,49
12.650.000	FloodSmart Re Series A 06/08/21, variable	13.020.013	0,71
13.234.000	FloodSmart Re Series B 06/08/21, variable	13.654.180	0,75
25.504.000	FloodSmart Re Series A 01/03/24, variable	25.534.604	1,40
5.625.000	FloodSmart Re Series B 01/03/24, variable	5.631.188	0,31
9.800.000	Fortius Re II 07/07/21, variable	9.875.950	0,54
5.750.000	Frontline Re Series A 06/07/22, variable	4.255.000	0,23
2.303.695	Frontline Re Series B 06/07/22, variable	350.162	0,02
7.000.000	Herbie Re 08/07/24, variable	7.241.500	0,40
3.833.000	Herbie Re 08/01/25, variable	4.061.255	0,22
5.114.000	Hypatia Series A 07/06/23, variable	5.431.068	0,30
379.000	Hypatia Series B 07/06/23, variable	404.204	0,02
4.950.000	Integrity Re 10/06/22, variable	4.964.603	0,27
20.775.000	Kendall Re 06/05/21, variable	20.821.743	1,14
26.707.000	Kilimanjaro II Re Series * 20/04/21, variable	26.847.211	1,47
15.250.000	Manatee Re II 07/06/21, variable	15.337.688	0,84
3.750.000	Manatee Re Series B 07/06/21, variable	3.771.188	0,21
12.000.000	Matterhorn Re 07/12/21, variable	12.138.600	0,66
6.500.000	Matterhorn Re Series A 07/12/21, variable	6.662.825	0,36
3.500.000	Matterhorn Re Series A 07/12/21, variable	3.614.625	0,20
8.000.000	Matterhorn Re Series B 07/12/21, variable	8.081.200	0,44
17.000.000	Matterhorn Re Series B 07/12/21, ZCP	15.870.350	0,87
7.250.000	Matterhorn Re Series B* 07/12/21, variable	7.331.925	0,40
11.118.000	Matterhorn Re Series A 07/12/22, variable	11.164.140	0,61
14.250.000	Matterhorn Re Series B 07/12/22, variable	14.360.438	0,79
7.500.000	Matterhorn Re 08/01/24, variable	7.338.000	0,40

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Cat Bond (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen	Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
10.500.000	Merna Reinsurance II 07/04/23, variable	10.593.450	0,58	2.500.000	Caelus Re VI 07/06/23, variable	2.556.500	0,14
22.340.000	Merna Reinsurance II 05/04/24, variable	22.393.615	1,23	2.750.000	Caelus Re VI 07/06/24, variable	2.828.925	0,15
6.000.000	MetroCat Re 08/05/23, variable	6.126.600	0,34	500.000	Long Point Re III 01/06/22, variable	503.225	0,03
1.250.000	Nakama Re 13/10/21, variable	1.256.063	0,07	4.750.000	Residential Reinsurance 2017 Series 11 06/06/21, variable	4.717.225	0,26
7.500.000	Nakama Re 144A 13/10/21, variable	7.540.125	0,41	6.150.000	Residential Reinsurance 2017 Series 13 06/06/21, variable	6.133.703	0,34
18.575.000	Nakama Re Series 1 13/04/23, variable	18.635.369	1,02	10.050.000	Residential Reinsurance 2017 06/12/21, variable	10.089.697	0,55
12.200.000	Nakama Re Series 2 13/04/23, variable	12.248.190	0,67	14.400.000	Residential Reinsurance 2018 Series 13 06/06/22, variable	14.245.199	0,78
3.022.000	Pelican IV Re 07/05/21, variable	3.034.541	0,17	9.697.000	Residential Reinsurance 2018 06/12/22, variable	7.664.269	0,42
9.697.000	Sakura Re Series A 07/04/25, variable	9.720.273	0,53	7.625.000	Residential Reinsurance 2019 Series 12 06/06/23, variable	3.617.200	0,20
14.242.000	Sakura Re Series B 07/04/25, variable	14.276.181	0,78	4.000.000	Residential Reinsurance 2019 Series 13 06/06/23, variable	2.228.513	0,12
3.000.000	SD Re 19/10/21, variable	2.957.550	0,16	2.250.000	Residential Reinsurance 2019 06/12/23, variable	6.075.640	0,33
3.750.000	Sierra Series A 28/12/22, variable	3.823.688	0,21	6.062.000	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variable	6.210.309	0,34
2.750.000	Sierra Series B 28/12/22, variable	2.808.163	0,15	6.154.000	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variable	5.535.824	0,30
14.500.000	Sierra Series A 31/01/24, variable	14.614.550	0,80	5.484.000	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variable	5.086.250	0,28
2.000.000	Sierra Series B 31/01/24, variable	2.008.600	0,11	1.050.000	Vitality Re IX Series A 10/01/22, variable	1.043.438	0,06
20.000.000	Torrey Pines Re Series A 07/06/24, variable	20.047.999	1,10	1.900.000	Vitality Re IX Series B 10/01/22, variable	1.878.625	0,10
19.250.000	Torrey Pines Re Series B 07/06/24, variable	19.296.200	1,06	5.250.000	Vitality Re X Series A 10/01/23, variable	5.243.438	0,29
17.050.000	Ursa Re 24/09/21, variable	17.132.693	0,94	2.250.000	Vitality Re X Series B 10/01/23, variable	2.213.438	0,12
20.732.000	Ursa Re 10/12/22, variable	21.070.967	1,15	9.117.000	Vitality Re XI Series A 09/01/24, variable	8.923.263	0,49
19.250.000	Ursa Re II Series AA 07/12/23, variable	19.723.549	1,08	3.500.000	Vitality Re XI Series B 09/01/24, variable	3.423.875	0,19
9.500.000	Ursa Re II Series D 07/12/23, variable	9.728.000	0,53	12.044.000	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variable	12.040.988	0,66
16.366.000	Ursa Re II 06/12/24, variable	16.406.915	0,90	6.000.000	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variable	5.992.500	0,33
8.269.000	Windmill II Re DAC 05/07/24, variable	9.842.512	0,54				
Kaaimaneilanden		122.958.255	6,73				
5.462.500	Caelus Re V Series B 05/06/24, variable	4.663.609	0,25				
6.600.000	Caelus Re V Series C 05/06/24, variable	41.250	-				
132.536	Caelus Re V Series D 05/06/24, variable	1.352	-				

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Cat Bond (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Ierland		37.531.637	2,06
10.000.000	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variable	10.544.500	0,58
4.100.000	Hexagon Reinsurance DAC Series A 19/01/22, variable	4.825.379	0,27
3.750.000	Hexagon Reinsurance DAC Series B 19/01/22, variable	4.409.718	0,24
15.100.000	Lion II Re DAC 15/07/21, variable	17.752.040	0,97
Singapore		23.431.354	1,28
6.000.000	Catahoula Re 09/05/23, variable	6.072.300	0,33
3.315.000	Cosaint Re 03/04/24, variable	3.321.630	0,18
9.966.000	First Coast Re III 07/04/25, variable	9.974.472	0,55
4.012.000	Phoenix 1 Re 04/01/27, ZCP	4.062.952	0,22
Verenigd Koninkrijk		42.833.086	2,35
27.275.000	Atlas Capital UK 2018 07/06/22, variable	27.491.836	1,51
15.000.000	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variable	15.341.250	0,84
Verenigde Staten		207.915.620	11,39
7.920.000	Chesterfield Financial Holdings 15/12/34, 4,50%	7.920.000	0,43
100.000.000	United States Treasury Bill 03/06/21, ZCP	99.997.812	5,48
100.000.000	United States Treasury Bill 17/06/21, ZCP	99.997.808	5,48
Totaal Obligatievermogen		1.087.007.854	59,53
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt		1.087.007.854	59,53

Aantal aandelen of hoofdsom	Overige effecten	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Obligaties			
Verenigde Staten		20.925.165	1,14
15.120.266	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5,96%	16.306.261	0,89
2.400	LionRock SideCar 2020-1C 31/12/00, ZCP	95	-
4.342.618	LionRock SideCar 2021-1 31/12/00, ZCP	4.618.809	0,25
Totaal Obligatievermogen		20.925.165	1,14
Totaal Overige effecten		20.925.165	1,14
Totaal Beleggingen		1.803.455.325	98,76
Overige Nettoactiva		22.585.000	1,24
Netto-inventariswaarde		1.826.040.325	100,00

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Aandelen			
Verenigde Staten		349.598.900	83,27
22.958	Adobe	10.913.544	2,60
460.672	ADT	3.888.072	0,93
606.661	Avaya Holdings	17.004.708	4,05
9.569	Bill.com Holdings	1.392.290	0,33
234.112	Box	5.375.212	1,28
739.790	Cargurus	17.629.196	4,20
359.000	Ceridian HCM Holding	30.252.929	7,22
193.415	Cirrus Logic	16.399.658	3,91
448.950	Cornerstone OnDemand	19.565.241	4,66
22.889	DoorDash	3.001.435	0,71
36.642	EchoStar	879.408	0,21
278.820	Green Dot	12.767.168	3,04
425.791	Marvell Technology Group	20.855.243	4,97
501.484	NCR	19.031.318	4,53
12.298	Netflix	6.415.375	1,53
220.900	New Relic	13.580.932	3,23
1.011.935	News	25.733.506	6,14
69.478	Qorvo	12.693.631	3,02
292.320	Redfin	19.465.589	4,64
221.409	Trimble	17.223.406	4,10
368.000	TripAdvisor	19.794.720	4,71
324.230	Twitter	20.630.755	4,91
198.660	Zillow Group	25.754.281	6,13
27.489	Zscaler	4.719.037	1,12
453.697	Zynga	4.632.246	1,10
Totaal Aandelenvermogen		349.598.900	83,27
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs		349.598.900	83,27
Totaal Beleggingen		349.598.900	83,27
Overige Nettoactiva		70.263.757	16,73
Netto-inventariswaarde		419.862.657	100,00

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Egerton Equity

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde EUR	% Netto-vermogen
Aandelen			
Argentinië			
5.421	MercadoLibre	6.805.211	0,67
Brazilië			
190.857	StoneCo	9.963.559	0,99
Canada			
172.543	Canadian Pacific Railway	56.197.893	5,56
5.507	Shopify	5.196.125	0,51
China			
82.335	JD.com	5.920.790	0,59
533.100	Tencent Holdings	35.669.865	3,53
India			
309.377	Housing Development Finance	9.013.882	0,89
Rusland			
227.581	Yandex	12.431.857	1,23
Zwitserland			
69.157	Cie Financiere Richemont	5.661.705	0,56
Taiwan			
40.478	Sea	7.705.214	0,76
2.375.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	41.664.612	4,12
Verenigd Koninkrijk			
177.046	Linde	42.293.567	4,19
Verenigde Staten			
42.193	Alphabet	74.427.992	7,37
363.906	Altice USA	10.094.536	1,00
15.374	Amazon.com	40.563.133	4,01
38.466	Analog Devices	5.086.814	0,50
87.627	Blackstone Group	5.569.063	0,55
186.015	Blackstone Mortgage Trust	4.917.255	0,49
88.508	Charter Communications	46.568.778	4,61
23.198	CME Group	4.040.017	0,40
524.244	Comcast	24.189.343	2,39
507.257	CSX	41.706.933	4,13
549.138	DR Horton	41.732.053	4,13
189.746	Facebook	47.655.743	4,72
157.927	Global Payments	27.146.691	2,69
341.043	KKR	14.206.490	1,41
783.182	L Brands	41.312.901	4,09
9.274	Martin Marietta Materials	2.655.747	0,26

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde EUR	% Netto-vermogen
42.230	Mastercard	12.821.686	1,27
87.394	Match Group	10.238.073	1,01
306.667	Microsoft	61.655.051	6,10
79.152	Netflix	35.209.715	3,48
1.207	NVR	4.848.719	0,48
71.359	PayPal Holdings	14.776.856	1,46
371.506	T-Mobile US	39.691.299	3,93
96.794	UnitedHealth Group	30.710.449	3,04
212.661	Visa	38.395.765	3,80
44.242	Vulcan Materials	6.366.366	0,63
219.365	Wells Fargo	7.308.425	0,72
Totaal Aandelenvermogen		932.420.173	92,27
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs		932.420.173	92,27
Totaal Beleggingen		932.420.173	92,27
Overige Nettoactiva		78.077.774	7,73
Netto-inventariswaarde		1.010.497.947	100,00

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Helix

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Aandelen - Long			
Brazilië		7.364.509	1,49
15.400	Aeris Industria E Comercio de Equipamentos Para Geracao de Energia	24.186	-
22.463	Banco Bradesco	105.576	0,02
59.090	BR Malls Participacoes	106.241	0,02
6.200	Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista	27.901	0,01
287.774	Duratex	955.557	0,19
19.406	Itau Unibanco Holding	96.254	0,02
1.179.700	Itausa	2.162.953	0,44
17.924	Lojas Americanas	71.204	0,01
168.031	Lojas Renner	1.271.431	0,26
536.600	Raia Drogasil	2.389.062	0,49
8.856	Vale	154.144	0,03
Canada		7.277	0,00
704	Loop Energy	7.277	-
Chili		2.775.624	0,56
224.731	Empresas COPEC	2.775.624	0,56
China		21.290.760	4,30
65.200	Baozun	796.748	0,16
249.000	Budweiser Brewing	743.083	0,15
211.900	China Jushi	619.723	0,13
10.500	China Tourism Group Duty Free	489.542	0,10
7.100	Contemporary Amperex Technology	348.425	0,07
29.400	Eve Energy	336.544	0,07
19.165	Gongniu Group	521.644	0,11
246.195	Gree Real Estate	213.382	0,04
85.000	Hengli Petrochemical	379.749	0,08
22.183	Hongfa Technology	166.854	0,03
26.523	Huizhou Desay Sv Automotive	346.476	0,07
60.900	Keboda Technology	649.816	0,13
7.400	Kuaishou Technology	257.007	0,05
402.778	Midea Group	5.045.001	1,01
16.400	New Oriental Education & Technology Group	224.247	0,05
49.747	Oppein Home Group	1.194.307	0,24
130.000	PICC Property & Casualty	112.708	0,02
91.400	SF Holding	1.127.986	0,23
27.453	Shandong Sinocera Functional Material	177.556	0,04

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
321.700	Shanghai Hanbell Precise Machinery	1.225.547	0,25
31.504	Shanghai Kelai Mechatronics Engineering	139.357	0,03
4.300	Shenzhen Inovance Technology	56.008	0,01
58.218	Shenzhen Sunlord Electronics	294.238	0,06
141.100	Sinoma Science & Technology	500.996	0,10
25.000	Streamax Technology	192.955	0,04
66.808	Thunder Software Technology	1.239.992	0,25
56.000	Tongcheng-Elong Holdings	126.348	0,03
3.757	Tuya	79.423	0,02
55.766	Venustech Group	283.459	0,06
13.400	Wanhua Chemical Group	215.543	0,04
142.288	Winning Health Technology Group	355.666	0,07
40.900	Wuxi Lead Intelligent Equipment	492.108	0,10
385.500	XCMG Construction Machinery	445.689	0,09
104.100	Xuji Electric	244.195	0,05
112.378	Zhejiang Dingli Machinery	1.648.438	0,32
Tsjechië		2.378.564	0,48
77.057	Komerčni banka	2.378.564	0,48
Egypte		861.367	0,17
215.826	Commercial International Bank Egypt	769.420	0,15
231.228	Talaat Moustafa Group	91.947	0,02
Georgië		2.664.707	0,54
152.511	Georgia Capital	1.215.255	0,25
106.849	TBC Bank Group	1.449.452	0,29
Griekenland		1.859.419	0,38
1.581.463	Eurobank Ergasias	1.344.572	0,28
30.700	Hellenic Telecommunications Organization	492.506	0,10
1.512	Terna Energy	22.341	-
Hongarije		7.508.355	1,52
56.245	OTP Bank	2.404.120	0,49
173.122	Richter Gedeon	5.104.235	1,03
India		132.145	0,03
6.854	Larsen & Toubro	132.145	0,03

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Helix (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Indonesië			
1.291.000	Bank Central Asia	2.761.985	0,55
783.700	Bank Mandiri Persero	331.825	0,07
969.800	Telekomunikasi Indonesia Persero	228.345	0,05
Italië			
4.481.074 0,91			
1.274	Amplifon	47.420	0,01
3.626	DiaSorin	581.702	0,12
8.154	Falck Renewables	58.377	0,01
37.358	GVS	587.927	0,12
323.712	Intesa Sanpaolo	877.105	0,18
18.863	Moncler	1.081.036	0,23
9.691	Nexi	169.106	0,03
1.118	Philogen	20.086	-
30.908	Prysmian	1.004.371	0,20
7.145	Terna Rete Elettrica Nazionale	53.944	0,01
Japan			
473.403 0,10			
14.500	WealthNavi	473.403	0,10
Kazachstan			
5.683.802 1,15			
242.277	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	3.403.992	0,69
32.110	Kaspi.KZ JSC	2.279.810	0,46
Kenia			
1.156.312 0,23			
3.473.700	Safaricom	1.156.312	0,23
Mexico			
440.712 0,09			
181.196	Cemex SAB de CV	127.390	0,03
64.162	Corp Moctezuma SAB de CV	197.765	0,04
20.494	Grupo Financiero Banorte SAB de CV	115.557	0,02
Nederland			
1.580.898 0,32			
18.739	EXOR	1.580.898	0,32
Peru			
212.604 0,04			
164.442	Ferreycorp SAA	97.519	0,02
3.849	Intercorp Financial Services	115.085	0,02
Filipijnen			
1.451.589 0,29			
527.120	Ayala Land	373.043	0,08
213.320	Universal Robina	584.528	0,11
1.347.100	Wilcon Depot	494.018	0,10
Polen			
13.588.629 2,75			
100.921	Allegro.eu	1.419.110	0,29
1.862.778	Bank Millennium	1.783.637	0,36
71.674	CCC	1.656.596	0,33

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
31.441	KGHM Polska Miedz	1.513.216	0,31
28.011	KRUK	1.298.518	0,26
30.918	mBank	1.677.376	0,34
53.968	Polski Koncern Naftowy ORLEN	866.623	0,18
147.346	Powszechna Kasa Oszczednosci Bank Polski	1.220.333	0,25
57.766	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	498.449	0,10
9.065	Santander Bank Polska	501.432	0,10
8.799	TEN Square Games	1.153.339	0,23
Rusland		50.721.456	10,24
751.723	Gazprom	4.483.276	0,91
76.457	LUKOIL	6.182.313	1,25
203.155	Magnit	3.045.293	0,62
95.704	MMC Norilsk Nickel	2.984.051	0,60
39.355	Novatek	7.772.613	1,57
91.827	Polymetal International	1.796.983	0,36
4.463	Polyus	410.819	0,08
522.216	Rosneft Oil	3.948.997	0,80
629.144	Sberbank of Russia	9.691.963	1,95
89.978	TCS Group Holding	5.218.724	1,05
71.831	X5 Retail Group	2.315.831	0,47
44.811	Yandex	2.870.593	0,58
Slovenië		3.303.536	0,67
268.289	Nova Ljubljanska Banka dd	3.303.536	0,67
Zuid-Afrika		3.316.868	0,67
13.837	Capitec Bank Holdings	1.331.052	0,27
63.921	FirstRand	223.550	0,05
7.365	Naspers	1.762.266	0,35
Zuid-Korea		31.430.772	6,35
6.524	KB Financial Group	323.966	0,07
797	Koh Young Technology	80.985	0,02
4.109	Korea Zinc	1.483.125	0,30
3.695	LG Chem	2.628.209	0,53
488	LG Chem-Preference	165.577	0,03
8.147	NAVER	2.713.867	0,55
180.539	Samsung Electronics	12.985.088	2,62
113.018	Samsung Electronics - Preferent	7.289.873	1,47
10.370	Samsung Fire & Marine Insurance	1.740.932	0,35
668	Samsung SDI	389.556	0,08
8.469	SK Hynix	991.511	0,20

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Helix (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
2.626	SK Telecom	638.083	0,13
Spanje		33.445	0,01
2.711	Soltec Power Holdings	33.445	0,01
Zwitserland		1.984.578	0,40
503.738	Mediclinic International	1.984.578	0,40
Taiwan		48.779.159	9,86
86.792	Advantech	1.076.801	0,22
6.000	Alchip Technologies	189.255	0,04
89.000	ASE Technology Holding	335.314	0,07
14.000	Asustek Computer	182.771	0,04
182.000	Chroma ATE	1.202.362	0,24
11.250	Dadi Early-Childhood Education Group	69.985	0,01
55.000	Delta Electronics	555.147	0,11
307.000	Formosa Plastics	1.086.707	0,22
330.000	Getac Technology	677.742	0,14
743.000	Hon Hai Precision Industry	3.228.962	0,65
9.000	Largan Precision	1.012.512	0,20
138.000	MediaTek	4.686.572	0,95
207.000	Mega Financial Holding	231.427	0,05
74.000	Merida Industry	905.127	0,18
223.000	Nien Made Enterprise	3.110.574	0,63
54.000	Novatek Microelectronics	1.088.214	0,22
9.000	Parade Technologies	386.395	0,08
74.000	Sporton International	637.998	0,13
110.651	Taiwan Cement	181.490	0,04
1.249.000	Taiwan Semiconductor Manufacturing	25.695.264	5,19
170.000	Uni-President Enterprises	434.935	0,09
18.000	Universal Vision Biotechnology	203.764	0,04
150.000	Vanguard International Semiconductor	567.764	0,11
26.650	Voltronic Power Technology	1.032.077	0,21
Thailand		4.077.907	0,82
167.600	Intouch Holdings	311.066	0,06
292.400	Kasikornbank	1.356.736	0,27
482.100	Kasikornbank-XDR	2.236.944	0,46
632.900	Land & Houses	173.161	0,03
Turkije		10.353.232	2,09
87.477	Coca-Cola Icecek	728.865	0,15
1.405.628	Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	2.597.702	0,53

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
785.948	KOC Holding	1.847.497	0,37
189.628	Mavi Giyim Sanayi Ve Ticaret	1.063.281	0,21
150.979	Migros Ticaret	639.955	0,13
622.783	MLP Saglik Hizmetleri	1.556.722	0,31
929.676	Sok Marketler Ticaret	1.321.796	0,27
737.369	Turkiye Garanti Bankasi	597.414	0,12
Verenigd Koninkrijk		8.372.574	1,69
202.306	Avast	1.271.780	0,26
250.410	CNH Industrial	3.874.789	0,77
250.252	Melrose Industries	575.801	0,12
78.210	Science in Sport	66.309	0,01
278.308	TT Electronic	882.453	0,18
85.284	Vesuvius	633.716	0,13
117.171	Watches of Switzerland Group	1.067.726	0,22
Verenigde Staten		6.089.677	1,23
1.364	Array Technologies	40.674	0,01
78.641	HUUUGE	841.751	0,17
6.428	Mastercard	2.288.689	0,46
851	Silverback Therapeutics	37.129	0,01
13.609	Visa	2.881.434	0,58
Totaal Aandelen - Long		247.697.109	50,05
Obligaties - Long			
Argentinië		98.923	0,02
33.000	Argentine Republic Government International Bond 09/01/38, 0,13%	12.158	-
34.000	Argentine Republic Government International Bond 09/07/41, 0,13%	11.806	-
241.741	Argentine Republic Government International Bond 09/07/46, 0,13%	74.959	0,02
Brazilië		248.350	0,05
1.306.000	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10,00%	248.350	0,05
Ecuador		160.950	0,03
370.000	Ecuador Government International Bond 31/07/40, 0,50%	160.950	0,03
Egypte		102.033	0,02
1.450.000	Egypt Government Bond 09/05/27, 17,18%	102.033	0,02

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Helix (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktw waarde USD	% Netto-vermogen
Indonesië		685.258	0,14
4.100.000.000	Indonesia Treasury Bond 15/09/30, 7,00%	286.404	0,06
2.100.000.000	Indonesia Treasury Bond 15/06/36, 6,25%	139.489	0,03
2.350.000.000	Indonesia Treasury Bond 15/05/38, 7,50%	163.277	0,03
1.260.000.000	Indonesia Treasury Bond 15/02/44, 8,75%	96.088	0,02
Ivoorkust		248.225	0,05
200.000	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5,88%	248.225	0,05
Mexico		745.334	0,15
1.800.000	Mexican Bonos 18/11/38, 8,50%	96.892	0,02
3.600.000	Mexican Bonos 13/11/42, 7,75%	178.061	0,04
1.950.000	Mexican Bonos 07/11/47, 8,00%	97.961	0,02
3.800.000	Petroleos Mexicanos 12/09/24, 7,19%	174.613	0,04
4.600.000	Petroleos Mexicanos 12/11/26, 7,47%	197.807	0,03
Zuid-Afrika		458.349	0,09
2.740.000	Republic of South Africa Government Bond 31/01/30, 8,00%	169.400	0,03
1.650.000	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8,25%	96.694	0,02
3.340.000	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8,88%	192.255	0,04
Supranationaal		100.358	0,02
7.120.000	International Finance 25/11/24, 6,30%	100.358	0,02
Turkije		88.489	0,02
68.000	Turkey Government International Bond 15/01/30, 11,88%	88.489	0,02
Totaal Obligaties - Long		2.936.269	0,59
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs		250.633.378	50,64

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktw waarde USD	% Netto-vermogen
Obligaties - Long			
Ghana		288.765	0,06
500.000	Republic of Ghana Government Bonds 25/07/22, 18,25%	88.696	0,02
300.000	Republic of Ghana Government Bonds 28/09/23, 18,85%	53.254	0,01
840.000	Republic of Ghana Government Bonds 02/11/26, 19,00%	146.815	0,03
Oekraïne		158.097	0,03
1.860.000	Ukraine Government Bond 26/02/25, 15,84%	74.279	0,02
2.590.000	Ukraine Government Bond 26/05/27, 9,79%	83.818	0,01
Verenigde Staten		149.996.304	30,31
10.000.000	United States Treasury Bill 08/04/21, ZCP	9.999.893	2,02
10.000.000	United States Treasury Bill 15/04/21, ZCP	9.999.788	2,02
25.000.000	United States Treasury Bill 22/04/21, ZCP	24.999.381	5,06
5.000.000	United States Treasury Bill 29/04/21, ZCP	4.999.883	1,01
15.000.000	United States Treasury Bill 06/05/21, ZCP	14.999.599	3,03
10.000.000	United States Treasury Bill 13/05/21, ZCP	9.999.732	2,02
10.000.000	United States Treasury Bill 20/05/21, ZCP	9.999.476	2,02
20.000.000	United States Treasury Bill 27/05/21, ZCP	19.998.927	4,04
15.000.000	United States Treasury Bill 03/06/21, ZCP	14.999.974	3,03
10.000.000	United States Treasury Bill 10/06/21, ZCP	9.999.737	2,02
20.000.000	United States Treasury Bill 17/06/21, ZCP	19.999.914	4,04
Totaal Obligaties - Long		150.443.166	30,40
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt		150.443.166	30,40

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Helix (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Deelbewijzen in Open-Ended Beleggingsinstrumenten	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Aandelen - Long			
Hongkong			
16.376	Schroder Umbrella Fund II-China Equity Alpha Fund	7.120.776	1,44
Luxemburg			
60.000	Schroder GAIA M&A	5.991.000	1,21
18.722	Schroder ISF Indian Equity	5.871.298	1,19
76.669	Schroder ISF Securitised Credit	8.343.986	1,68
Totaal Aandelen - Long		27.327.060	5,52
Totaal Deelbewijzen in Open-Ended Beleggingsinstrumenten		27.327.060	5,52

Aantal aandelen of hoofdsom	Overige effecten	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Aandelen - Short			
Rusland			
(30.920)	Gazprom	(184.407)	(0,04)
Totaal Aandelen - Short		(184.407)	(0,04)
Totaal Overige effecten		(184.407)	(0,04)
Totaal Beleggingen		428.219.197	86,52
Overige Nettoactiva		66.704.597	13,48
Netto-inventariswaarde		494.923.794	100,00

Schroder GAIA M&A*

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Aandelen			
China			
9.277	Hollysys Automation Technologies	116.148	1,67
Verenigde Staten			
2.368	Aegion	68.080	0,98
5.025	Brightsphere Investment Group	102.410	1,47
3.842	Change Healthcare	84.908	1,22
1.500	CoreLogic	118.875	1,71
4.258	Macquarie Infrastructure	135.446	1,94
5.304	NIC	179.965	2,58
1.643	ODP	71.125	1,02
2.122	Perspecta	61.644	0,88
1.981	Vontier	59.965	0,86
1.090	Voya Financial	69.368	1,00
2.051	WR Grace	122.773	1,76
Totaal Aandelenvermogen		1.190.707	17,09
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs		1.190.707	17,09

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Obligaties			
Verenigde Staten			
450.000	United States Treasury Bill 15/04/21, ZCP	450.000	6,46
450.000	United States Treasury Bill 22/04/21, ZCP	449.998	6,46
450.000	United States Treasury Bill 29/04/21, ZCP	449.998	6,46
450.000	United States Treasury Bill 06/05/21, ZCP	449.997	6,46
450.000	United States Treasury Bill 13/05/21, ZCP	449.994	6,46
450.000	United States Treasury Bill 20/05/21, ZCP	449.994	6,46
450.000	United States Treasury Bill 27/05/21, ZCP	449.995	6,46

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode. De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA M&A* (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
450.000	United States Treasury Bill 03/06/21, ZCP	449.994	6,46
450.000	United States Treasury Bill 10/06/21, ZCP	449.988	6,46
Totaal Obligatievermogen		4.049.958	58,14
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt		4.049.958	58,14
Totaal Beleggingen		5.240.665	75,23
Overige Nettoactiva		1.725.612	24,77
Netto-inventariswaarde		6.966.277	100,00

Schroder GAIA Sirios US Equity

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Aandelen			
Frankrijk		11.485.142	2,88
85.312	Airbus	9.658.381	2,42
13.423	Safran	1.826.761	0,46
Spanje		15.039.035	3,77
261.187	Cellnex Telecom	15.039.035	3,77
Zweden		3.976.049	1,00
300.516	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	3.976.049	1,00
Verenigd Koninkrijk		13.965.735	3,50
7.025	Linde	1.968.110	0,49
125.400	London Stock Exchange Group	11.997.625	3,01
Verenigde Staten		331.028.678	82,95
100.207	Abbott Laboratories	12.008.807	3,01
57.838	AES	1.550.637	0,39
255.269	Allison Transmission Holdings	10.422.633	2,61
92.730	Analog Devices	14.380.568	3,62
18.363	Anterix	865.999	0,22
11.368	AptarGroup	1.610.504	0,40
6.284	Arthur J Gallagher	784.055	0,20
42.214	Axalta Coating Systems	1.248.690	0,31
35.760	AZEK	1.503.708	0,38
234.960	Baker Hughes	5.077.486	1,27
4.333	Ball	367.178	0,09
66.511	Berry Global Group	4.083.775	1,02
95.228	BJ's Wholesale Club Holdings	4.271.928	1,07
220.177	Boston Scientific	8.509.841	2,13
17.456	Brunswick	1.664.779	0,42
15.792	Bunge	1.251.832	0,31
254.271	Carnival	6.748.352	1,69
85.858	ConocoPhillips	4.547.898	1,14
29.747	Constellation Brands	6.782.316	1,70
17.148	Crown Holdings	1.664.042	0,42
20.676	CyberArk Software	2.674.234	0,67
58.146	Danaher	13.087.502	3,28
17.616	Darling Ingredients	1.296.185	0,32
71.644	DR Horton	6.384.913	1,60
187.340	Dropbox	4.994.484	1,25
13.314	Eagle Materials	1.789.535	0,45
948	Ecolab	202.938	0,05

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode. De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Sirios US Equity (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
55.870	Eli Lilly	10.437.633	2,62
1.830	FMC	202.416	0,05
15.820	Freeport-McMoRan	520.953	0,13
37.548	Hasbro	3.609.114	0,90
57.132	Huntsman	1.647.116	0,41
304.005	IHS Markit	29.421.605	7,37
163.894	Janus Henderson Group	5.105.298	1,28
44.865	Kansas City Southern	11.840.771	2,97
134.211	KeyCorp	2.681.536	0,67
56.802	Keysight Technologies	8.145.407	2,04
63.742	Kohl's	3.799.661	0,95
22.613	Lowe's	4.300.540	1,08
25.206	MasTec	2.361.802	0,59
55.447	Medtronic	6.549.954	1,64
29.522	Mercury Systems	2.085.729	0,52
35.106	Microsoft	8.276.942	2,07
191.078	Option Care Health	3.389.724	0,85
12.313	PayPal Holdings	2.990.089	0,75
49.861	PotlatchDeltic	2.638.644	0,66
39.799	PTC	5.478.332	1,37
122.266	QUALCOMM	16.211.249	4,07
21.254	Roper Technologies	8.572.588	2,15
2.189	S&P Global	772.432	0,19
150.295	Sabre	2.225.869	0,56
180.463	Schlumberger	4.906.789	1,23
2.782	Sherwin-Williams	2.053.144	0,51
105.766	Southwest Airlines	6.458.072	1,62
59.893	T-Mobile US	7.503.994	1,88
13.091	Toro	1.350.206	0,34
7.807	TPI Composites	440.549	0,11
144.545	Umpqua Holdings	2.536.765	0,64
15.284	UniFirst	3.419.184	0,86
9.475	Union Pacific	2.088.385	0,52
17.887	Valero Energy	1.280.709	0,32
58.083	Valvoline	1.514.224	0,38
17.636	Varonis Systems	905.432	0,23
214.778	Verra Mobility	2.907.020	0,73
21.441	Walt Disney	3.956.293	0,99
27.255	Waste Connections	2.942.995	0,74
312.970	Wells Fargo	12.227.738	3,07
25.342	Westinghouse Air Brake Technologies	2.006.073	0,50

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
38.831	Williams-Sonoma	6.958.515	1,74
46.671	World Wrestling Entertainment	2.532.368	0,63
Totaal Aandelenvermogen		375.494.639	94,10
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs		375.494.639	94,10

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Obligaties			
Verenigde Staten		10.176.326	2,55
7.317.000	American Airlines Group 01/06/22, 5,00%	7.198.098	1,80
3.484.000	American Airlines Group 01/03/25, 3,75%	2.978.228	0,75
Totaal Obligatievermogen		10.176.326	2,55
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt		10.176.326	2,55
Totaal Beleggingen		385.670.965	96,65
Overige Nettoactiva		13.350.269	3,35
Netto-inventariswaarde		399.021.234	100,00

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Obligaties			
Duitsland		114.734	0,01
10.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4,25%	20.890	-
10.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4,75%	22.467	0,01
10.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3,25%	19.650	-
10.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2,50%	18.192	-
10.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2,50%	18.577	-
10.000	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1,25%	14.958	-
Verenigde Staten		31.483	0,00
10.000	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2,50%	10.189	-
10.000	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3,00%	11.124	-
10.000	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2,50%	10.170	-
Totaal Obligatievermogen		146.217	0,01
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs		146.217	0,01

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Obligaties			
Oostenrijk		199.980.411	18,64
75.000.000	Austrian Treasury Bill 12/04/21, ZCP	74.997.250	7,00
45.000.000	Austrian Treasury Bill 16/04/21, ZCP	44.997.657	4,19
25.000.000	Austrian Treasury Bill 18/05/21, ZCP	24.995.432	2,33
55.000.000	Austrian Treasury Bill 21/05/21, ZCP	54.990.072	5,12

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Finland		74.911.472	6,98
75.000.000	Finnish Treasury Bill 17/11/21, ZCP	74.911.472	6,98
Duitsland		184.976.829	17,24
75.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 22/04/21, ZCP	74.995.188	6,99
45.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 04/05/21, ZCP	44.993.608	4,19
65.000.000	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau 10/05/21, ZCP	64.988.033	6,06
Verenigde Staten		32.211	0,00
10.000	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2,88%	10.898	-
10.000	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3,00%	11.142	-
10.000	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2,50%	10.171	-
Totaal Obligatievermogen		459.900.923	42,86
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt		459.900.923	42,86

Aantal aandelen of hoofdsom	Deelbewijzen in Open-Ended Beleggingsinstrumenten	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Aandelen			
Luxemburg		5.000.000	0,47
5.000.000	JPMorgan Liquidity Funds-US Dollar Treasury Liquidity Fund	5.000.000	0,47
Totaal Aandelenvermogen		5.000.000	0,47
Totaal Deelbewijzen in Open-Ended Beleggingsinstrumenten		5.000.000	0,47
Totaal Beleggingen		465.047.140	43,34

Termijndeposito's			
Financiële sector		161.573.700	15,06
50.000.000	Banque NA 01/04/21, 0,07%	50.000.000	4,66
50.000.000	Mizuho Bank 01/04/21, 0,07%	50.000.000	4,66
50.000.000	NRW Bank 01/04/21, 0,05%	50.000.000	4,66
11.573.700	Rabobank 01/04/21, 0,05%	11.573.700	1,08
Totaal termijndeposito's		161.573.700	15,06
Overige Nettoactiva		446.367.119	41,60
Netto-inventariswaarde		1.072.987.959	100,00

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde GBP	% Netto-vermogen
Aandelen			
Verenigd Koninkrijk		13.916.419	41,47
32.123	AB Dynamics	652.097	1,94
1.296.958	Comptoir Group	68.090	0,20
311.727	Creo Medical Group	673.330	2,01
467.277	Everyman Media Group	670.543	2,00
42.746	GB Group	362.486	1,08
291.780	Hollywood Bowl Group	671.094	2,00
195.733	IG Design Group	1.154.824	3,44
310.811	Johnson Service Group	462.487	1,38
248.604	Melrose Industries	414.920	1,24
168.555	Midwich Group	754.284	2,25
18.218.869	Napster Group	400.815	1,19
339.873	Quixant	431.639	1,29
714.047	Science in Sport	439.139	1,31
289.937	Secure Income Real Estate Investment Trust	1.042.323	3,11
266.212	TT Electronic	612.288	1,82
81.128	Vesuvius	437.280	1,30
84.439	Vitec Group	966.827	2,88
82.627	Vp	672.584	2,00
148.967	WANdisco	685.248	2,04
111.114	Watches of Switzerland Group	734.464	2,19
234.709	Wincanton	913.018	2,72
36.692	Young & Company's Brewery	328.393	0,98
25.309	Young & Company's Brewery Class A	368.246	1,10
Totaal Aandelenvermogen		13.916.419	41,47
Obligaties			
Verenigd Koninkrijk		10.320.845	30,76
2.000.000	United Kingdom Gilt 07/09/21, 3,75%	2.032.752	6,06
1.700.000	United Kingdom Gilt 07/03/22, 4,00%	1.763.198	5,25
4.650.000	United Kingdom Gilt 22/07/22, 0,50%	4.680.457	13,95
1.800.000	United Kingdom Gilt 07/09/22, 1,75%	1.844.438	5,50
Totaal Obligatievermogen		10.320.845	30,76
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs		24.237.264	72,23

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde GBP	% Netto-vermogen
Obligaties			
Verenigd Koninkrijk		5.499.598	16,39
3.000.000	United Kingdom Treasury Bill 23/08/21, ZCP	2.999.858	8,94
2.500.000	United Kingdom Treasury Bill 06/09/21, ZCP	2.499.740	7,45
Totaal Obligatievermogen		5.499.598	16,39
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt		5.499.598	16,39
Totaal Beleggingen		29.736.862	88,62
Overige Nettoactiva		3.818.123	11,38
Netto-inventariswaarde		33.554.985	100,00

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktw waarde USD	% Netto-vermogen
Aandelen			
Australië		697.803	0,15
32.568	Glencore	127.623	0,03
58.097	Pilbara Minerals	46.113	0,01
6.803	Rio Tinto	520.514	0,11
1.422	Tyro Payments	3.553	-
Oostenrijk		1.645.011	0,34
22.640	BAWAG Group	1.169.259	0,24
14.028	Erste Group Bank	475.752	0,10
België		1.085.038	0,23
1.124	Galapagos	87.154	0,02
2.310	KBC Ancora	98.876	0,02
11.564	KBC Group	840.789	0,18
612	UCB	58.219	0,01
Brazilië		1.343.738	0,28
1.100	BK Brasil Operacao e Assessoria a Restaurantes	1.890	-
130	BR Properties	199	-
479	Lojas Renner	3.624	-
3.896	StoneCo	238.513	0,05
29.188	XP	1.099.512	0,23
Canada		12.073.553	2,52
48.304	Advantage Oil & Gas	91.096	0,02
276.938	ARC Resources	1.701.250	0,36
1.120	Barrick Gold	22.176	-
4.622	Canadian Natural Resources	142.681	0,03
3.200	Clementia Pharmaceuticals	-	-
11.903	Dollarama	525.865	0,11
32.658	Enerplus	163.979	0,03
234.110	Headwater Exploration	728.392	0,15
22.476	Intact Financial	2.754.279	0,58
56.537	Kelt Exploration	119.669	0,02
37.826	MEG Energy	196.249	0,04
23.113	Parex Resources	412.161	0,09
31.907	Seven Generations Energy	215.811	0,04
647.194	Storm Resources	1.405.936	0,29
81.289	Suncor Energy	1.698.940	0,35
90.636	Tourmaline Oil	1.725.163	0,37
74.430	Trican Well Service	122.599	0,03
10.770	Whitecap Resources	47.307	0,01

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktw waarde USD	% Netto-vermogen
Kaaimaneilanden		191.732	0,04
6.269	AEA-Bridges Impact	61.562	0,01
13.017	Alussa Energy Acquisition	130.170	0,03
Chili		6.168	0,00
21	Sociedad Quimica y Minera de Chile	65	-
115	Sociedad Quimica y Minera de Chile-ADR	6.103	-
China		7.555.104	1,58
132.000	Akeso	833.691	0,18
7.640	Amoy Diagnostics	83.022	0,02
186.000	Angang Steel Class A	105.395	0,02
28.000	Angang Steel Class H	13.975	-
23.231	Baidu	636.499	0,13
305	Baidu-ADR	66.353	0,01
116.000	Baoshan Iron & Steel	142.769	0,03
212	BeiGene	73.793	0,02
519.882	China Longyuan Power Group	706.185	0,15
1.339.914	China Machinery Engineering	598.076	0,12
2.798	China Merchants Port Holdings	4.290	-
370.000	China Pharmaceutical Group	447.383	0,09
5.900	Connect Biopharma Holdings	109.150	0,02
5.416	Contemporary Amperex Technology	265.784	0,06
53.772	CStone Pharmaceuticals	63.981	0,01
34.253	Everest Medicines	324.064	0,07
557	Ganfeng Lithium	7.997	-
18.551	Gracell Biotechnologies	285.685	0,06
10.290	Guangzhou Automobile Group	8.643	-
920.162	Hope Education Group	307.743	0,06
10.863	InnoCare Pharma	25.376	0,01
52.445	Lifetech Scientific	24.084	0,01
9.900	Linklogis	22.387	-
2.000	Microport Cardioflow Medtech	3.386	-
7.000	Ningbo Joyson Electronic	19.203	-
184.245	Shenzhen Airport	249.215	0,05
2.445	Tencent Holdings	191.849	0,04
16.728	Venustech Group	85.029	0,02
12.683	WuXi AppTec	249.448	0,05

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktw waarde USD	% Netto-vermogen
29.101	Wuxi Biologics Cayman	364.413	0,08
11.200	Wuxi Lead Intelligent Equipment	134.758	0,03
4.671	XPeng	170.538	0,04
6.977	Zai Lab	930.940	0,20
Colombia		50.272	0,01
3.142	Geopark	50.272	0,01
Tsjechië		116.558	0,02
2.339	Komercni banka	72.200	0,01
11.909	Moneta Money Bank	44.358	0,01
Denemarken		1.592.984	0,33
3.333	Ascendis Pharma	429.557	0,09
57.573	Spar Nord Bank	614.464	0,13
16.413	Tryg	387.086	0,08
5.065	Zealand Pharma	161.877	0,03
Frankrijk		7.349.652	1,53
44.066	ALD	644.919	0,13
6.664	Amundi	532.974	0,11
40.303	AXA	1.081.621	0,23
9.543	BNP Paribas	580.593	0,12
9.244	Cie de Saint-Gobain	545.491	0,11
28.288	Credit Agricole	409.525	0,09
127.610	Engie	1.811.493	0,38
1.224	Rothschild	44.210	0,01
5.853	Rubis	277.298	0,06
2.477	Safran	337.099	0,07
1.576	Schneider Electric	240.725	0,05
6.633	TOTAL	308.700	0,06
6.386	Worldline	535.004	0,11
Duitsland		2.393.355	0,50
401	BioNTech	43.785	0,01
5.372	Brenntag	458.621	0,10
40.889	Commerzbank	250.685	0,05
592	Covestro	39.808	0,01
612	RWE	23.985	0,01
3.168	Stabilus	222.907	0,05
16.704	Talanx	708.331	0,14
2.306	Volkswagen	645.233	0,13
Hongkong		1.433.703	0,30
91.427	AIA Group	1.109.011	0,23
1.990	ASM Pacific Technology	25.355	0,01
10.596	Hutchison China Mediatech	299.337	0,06

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktw waarde USD	% Netto-vermogen
Hongarije		66.072	0,01
2.241	Richter Gedeon	66.072	0,01
India		2.178.151	0,45
103.038	Bandhan Bank	477.747	0,10
2.289	Hindustan Petroleum	7.342	-
59.771	Oberoi Realty	470.189	0,10
181.541	Power Grid of India	535.458	0,11
2.064	RBL Bank	5.859	-
24.877	Reliance Industries	681.556	0,14
Indonesië		363.876	0,08
16.664.600	Panin Financial	234.050	0,05
2.402.200	Paninvest	129.826	0,03
Ierland		1.241.861	0,26
13.524	AerCap Holdings	794.400	0,16
84.267	AIB Group	221.554	0,05
43.534	Irish Continental Group	225.907	0,05
Israël		457.915	0,10
34.370	Israel Discount Bank	142.801	0,03
11.238	Tower Semiconductor	315.114	0,07
Italië		2.762.981	0,58
12.513	Banca Generali	440.513	0,09
125.673	Banco BPM	358.862	0,07
30.919	Cerved Group	341.920	0,07
1.100	Ferrari	230.066	0,05
183.607	Intesa Sanpaolo	497.487	0,10
80.632	Mediobanca Banca di Credito Finanziario	894.133	0,20
Japan		4.338.859	0,90
52.941	Astellas Pharma	813.778	0,18
31	Bandai Namco Holdings	2.210	-
6.587	Daiichi Sankyo	191.854	0,04
1.984	Eisai	132.936	0,03
800	ENEOS Holdings	3.624	-
4.407	JFE Holdings	54.249	0,01
5.500	JGC Holdings	67.356	0,01
33.956	Mitsubishi UFJ Financial Group	181.456	0,04
1.561	Nippon Shinyaku	116.026	0,02
6.776	Nippon Steel	115.448	0,02
120.300	Nomura Holdings	631.677	0,13
3.297	Ono Pharmaceutical	86.054	0,02
42.500	ORIX	717.002	0,15
490	Renesas Electronics	5.310	-
83.847	Resona Holdings	351.972	0,07

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
32.142	Shinsei Bank	519.323	0,11
12.253	Showa Denko KK	348.584	0,07
Jordanië		44.367	0,01
1.414	Hikma Pharmaceuticals	44.367	0,01
Kazachstan		416.601	0,09
16.935	NAC Kazatomprom	416.601	0,09
Luxemburg		294.813	0,06
19.795	Addiko Bank	294.813	0,06
Macau		8.171	0,00
824	Sands China	4.118	-
2.084	Wynn Macau	4.053	-
Maleisië		8.914	0,00
5.914	Malaysia Airports Holdings	8.914	-
Mexico		309.320	0,06
25.963	Fresnillo	309.320	0,06
Nederland		1.557.116	0,32
1.416	Argenx	389.952	0,08
137.079	DP Eurasia	120.000	0,03
1.509	Koninklijke Philips	86.135	0,02
29.102	Merus	607.942	0,12
2.582	Pryme	20.830	-
17.047	Royal Dutch Shell	332.257	0,07
Noorwegen		735.544	0,15
8.779	Aker Carbon Capture	15.761	-
27.104	Equinor	527.445	0,11
30.042	Norsk Hydro	192.338	0,04
Filipijnen		509.283	0,11
239.245	BDO Unibank	502.765	0,11
45.453	Bloomerry Resorts	6.518	-
Puerto Rico		1.621.157	0,34
23.054	Popular	1.621.157	0,34
Zuid-Afrika		373.183	0,08
1.972	Anglo American	77.276	0,02
29.050	Gold Fields	275.685	0,06
4.592	Sibanye Stillwater	20.222	-
Zuid-Korea		587.122	0,12
34	CJ Logistics	5.498	-
172	Hyundai Steel	7.303	-
254	KB Financial Group	12.613	-
16.975	Shinhan Financial Group	561.708	0,12
Spanje		2.183.369	0,46
110.471	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	573.385	0,12
154.287	Bankinter	1.071.120	0,22
6.370	Cellnex Telecom	366.782	0,08
3.190	Laboratorios Farmaceuticos Rovi	172.082	0,04

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Zweden		2.401.184	0,50
1.802	Boliden	66.852	0,01
6.814	Lundin Energy	214.092	0,04
17.832	Sandvik	487.175	0,10
150.351	Svenska Handelsbanken	1.633.065	0,35
Zwitserland		1.820.235	0,38
9.874	Alcon	691.384	0,14
5.474	Novartis	467.793	0,10
2.329	STMicroelectronics	88.737	0,02
536	Tecan Group	237.844	0,05
21.601	UBS Group	334.477	0,07
Taiwan		610.956	0,13
53.630	Accton Technology	518.764	0,11
13.955	Chroma ATE	92.192	0,02
Thailand		103.472	0,02
22.300	Kasikornbank	103.472	0,02
Verenigde Arabische Emiraten		207.497	0,04
36.391	Network International Holdings	207.497	0,04
Verenigd Koninkrijk		7.307.909	1,52
75.031	AJ Bell	433.921	0,09
129	Aston Martin Lagonda Global Holdings	3.555	-
1.913	AstraZeneca	191.122	0,04
131.246	Babcock International Group	413.619	0,09
318.128	Barclays	815.393	0,17
120.496	Beazley	584.395	0,12
139.549	ConvaTec Group	377.262	0,08
15.791	Freeline Therapeutics Holdings	194.229	0,04
312	Genus	20.895	-
12.827	Hunting	45.269	0,01
17.165	Intermediate Capital Group	435.885	0,09
70.938	Legal & General Group	272.946	0,06
8.200	Liberty Global	210.412	0,04
1.730.254	Lloyds Banking Group	1.014.600	0,20
50.890	National Express Group	215.943	0,05
15.185	National Grid	180.870	0,04
353	National Grid-ADR	20.912	-
29.339	Prudential	623.082	0,13
368.252	Serco Group	698.557	0,15
4.229	Smith & Nephew	80.339	0,02
26.134	Standard Chartered	179.962	0,04
24.612	Subsea 7	247.180	0,05
1.007	Whitbread	47.561	0,01

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen	Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Verenigde Staten		82.551.445	17,22	26.951	Brigham Minerals	394.563	0,08
4.202	Acceleron Pharma	569.833	0,12	2.162	Bristol-Myers Squibb	136.487	0,03
9.793	AdaptHealth	359.991	0,08	40.200	Butterfly Network	650.986	0,14
2.796	Aemetis	68.558	0,01	6.417	BWX Technologies	423.137	0,09
2.003	Agilent Technologies	254.661	0,05	25.819	Cactus	790.578	0,16
7.429	Akero Therapeutics	215.515	0,04	1.124	Capstar Financial Holdings	19.389	-
803	Align Technology	434.849	0,09	3.470	Cardlytics	380.659	0,08
24.186	Aligos Therapeutics	549.990	0,11	2.429	Cavco Industries	548.007	0,11
27.652	Alkermes	516.539	0,11	3.357	Charles Schwab	218.809	0,05
4.786	American Electric Power	405.374	0,08	805	Chart Industries	114.592	0,02
9.806	American Express	1.386.960	0,29	2.118	Chesapeake Energy	91.900	0,02
12.010	American International Group	554.982	0,12	7.721	Churchill Capital VII	76.978	0,02
10.354	Amicus Therapeutics	102.298	0,02	32.770	Cimarex Energy	1.946.209	0,41
208	Anthem	74.662	0,02	7.303	CIT Group	376.178	0,08
31.100	APA	556.690	0,12	16.237	Citizens Financial Group	716.864	0,15
13.292	Apellis Pharmaceuticals	570.360	0,12	3.495	CME Group	713.784	0,15
12.100	Apria	337.953	0,07	4.757	CNX Resources	69.928	0,01
13.049	Arch Capital Group	500.690	0,10	16.018	Coherus Biosciences	234.023	0,05
1.777	ArcLight Clean Transition	31.773	0,01	14.177	ConocoPhillips	750.956	0,16
1.237	Arena Pharmaceuticals	85.835	0,02	3.322	Constellation Brands	757.416	0,16
71.438	Ares Acquisition	714.380	0,15	9.484	Constellation Pharmaceuticals	221.831	0,05
29.287	Ares Management	1.640.950	0,34	6.630	Copart	720.084	0,15
11.021	Artisan Partners Asset Management	574.966	0,12	404	CoStar Group	332.044	0,07
4.726	Artius Acquisition	47.733	0,01	2.605	Danaher	586.333	0,12
8.578	Assurant	1.216.102	0,25	3.409	Denbury	163.257	0,03
6.042	Assured Guaranty	255.456	0,05	2.300	Design Therapeutics	68.770	0,01
5.742	Atreca	88.025	0,02	789	Diamondback Energy	57.984	0,01
2.549	Avangrid	126.966	0,03	7.002	DiamondHead Holdings	69.390	0,01
9.391	Avidbank Holdings	206.602	0,04	2.231	Digital Turbine	179.283	0,04
3.211	Bank of California	58.055	0,01	654	DISH Network	23.675	-
83.534	Bank of America	3.231.929	0,68	2.014	Duke Energy	194.411	0,04
1.624	Baxter International	136.968	0,03	12.705	Dyne Therapeutics	197.309	0,04
964	Becton Dickinson	234.397	0,05	1.264	Edwards Lifesciences	105.721	0,02
1.300	BioAtla	66.092	0,01	959	Elanco Animal Health	28.243	0,01
1.908	Biogen	533.763	0,11	862	Eli Lilly	161.039	0,03
386	Biohaven Pharmaceutical Holding	26.383	0,01	2.229	Encompass Health	182.555	0,04
6.543	Black Diamond Therapeutics	158.733	0,03	4.187	Enstar Group	1.033.059	0,22
3.719	Blueprint Medicines	361.598	0,08	5.071	Enterprise Financial Services	250.710	0,05
22.352	Bluescape Opportunities Acquisition	222.402	0,05	33.681	Equitable Holdings	1.098.673	0,23
100	Booking Holdings	232.984	0,05	3.263	Exact Sciences	429.998	0,09
268	Boston Beer	323.283	0,07	147	Fair Isaac	71.449	0,01
50.148	BowX Acquisition	615.817	0,13	2.199	FedEx	624.604	0,13
8.799	Boyd Gaming	518.789	0,11	3.347	Fidelity National Information Services	470.622	0,10
				39.237	Fifth Wall Acquisition I	392.370	0,08

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen	Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
9.833	Fintech Acquisition IV	109.933	0,02	11.777	Knight-Swift		
5.122	First Merchants	238.173	0,05		Transportation Holdings	566.356	0,12
8.470	FirstEnergy	293.824	0,06	6.222	Kodiak Sciences	705.513	0,15
1.553	FleetCor Technologies	417.182	0,09	3.577	Kymera Therapeutics	139.002	0,03
5.639	Floor & Decor Holdings	538.412	0,11	5.260	Lazard Growth Acquisition I	52.600	0,01
20.688	Fluor	477.686	0,10	1.019	Leidos Holdings	98.109	0,02
5.974	Forma Therapeutics Holdings	167.391	0,03	565	LHC Group	108.034	0,02
14.648	Fortistar Sustainable Solutions	141.793	0,03	3.553	Livent	61.538	0,01
1.479	Fortive	104.477	0,02	2.421	Magellan Midstream Partners	104.975	0,02
72.151	FTAC Olympus Acquisition	813.863	0,17	23.575	Magnolia Oil & Gas	270.641	0,06
11.408	Generation Bio	324.672	0,07	619	Marsh & McLennan	75.394	0,02
248	Glaukos	20.815	-	19.848	Marvell Technology Group	972.155	0,20
5.975	Global Blood Therapeutics	243.481	0,05	285	Masimo	65.453	0,01
11.005	Global Payments	2.218.387	0,46	42.401	Medical Properties Trust	902.293	0,19
60.239	Hamilton Lane Alliance Holdings I	598.776	0,12	15.751	Mersana Therapeutics	254.851	0,05
3.004	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital	168.524	0,04	5.288	MetroMile	54.414	0,01
420	HCA Healthcare	79.103	0,02	52.928	MGIC Investment	733.053	0,15
718	Health Catalyst	33.581	0,01	538	Middleby	89.174	0,02
24.840	Heritage Commerce	303.545	0,06	2.666	Mirati Therapeutics	456.686	0,10
875	Hologic	65.083	0,01	775	Molina Healthcare	181.164	0,04
27	Humana	11.320	-	8.233	Morgan Stanley	639.375	0,13
1.423	IDEXX Laboratories	696.288	0,15	4.396	Motive Capital	43.081	0,01
9.217	IHS Markit	892.021	0,19	1.879	MPLX	48.159	0,01
9.241	II-VI	631.807	0,13	6.001	Multiplan	33.306	0,01
225	Illumina	86.414	0,02	20.926	MVB Financial	707.299	0,15
80.059	ImmunoGen	648.478	0,14	22.116	Myovant Sciences	455.147	0,09
227	Inari Medical	24.289	0,01	1.744	National Fuel Gas	87.183	0,02
1.388	Incyte	112.803	0,02	19.898	Navigator Holdings	177.092	0,04
2.020	Ingersoll Rand	99.404	0,02	5.800	nCino	386.976	0,08
4.100	Innovage Holding	105.739	0,02	5.835	Northeast Bank	153.986	0,03
4.400	Instil Bio	110.352	0,02	3.763	Novavax	682.270	0,14
212	Insulet	55.315	0,01	12.357	Nurix Therapeutics	384.179	0,08
5.562	Integra LifeSciences Holdings	384.279	0,08	1.516	NuVasive	99.389	0,02
48	Intuitive Surgical	35.469	0,01	8.987	Oak Street Health	487.724	0,10
42.362	Ironwood Pharmaceuticals	473.607	0,10	5.397	Oasis Petroleum	320.528	0,07
3.430	ITT	311.821	0,07	6.251	Ollie's Bargain Outlet Holdings	543.837	0,11
531	Johnson & Johnson	87.270	0,02	11.494	Oscar Health	308.959	0,06
10.122	Johnson Controls International	603.980	0,13	11.203	Ovintiv	266.855	0,06
4.073	Karuna Therapeutics	489.697	0,10	9.794	Owens & Minor	368.156	0,08
				11.395	Oyster Point Pharma	208.301	0,04
				709	PDC Energy	24.390	0,01

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
1.433.761	Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0,13%	482.819	0,10
4.354.510	Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 0,13%	1.308.573	0,26
55.965	Cia Latinoamericana de Infraestructura & Servicios 20/07/23, 9,50%	18.891	-
303.600	Provincia de Cordoba 01/06/27, 3,00%	180.642	0,04
307.481	Provincia de Cordoba 01/02/29, 3,00%	176.805	0,04
350.000	YPF 27/06/29, 8,50%	222.562	0,05
Oostenrijk		600.036	0,13
600.000	Oesterreichische Kontrollbank 22/11/21, variable	600.036	0,13
Azerbeidzjan		527.383	0,11
445.000	Southern Gas Corridor 24/03/26, 6,88%	527.383	0,11
Bahrein		186.244	0,04
200.000	Bahrain Government International Bond 25/01/51, 6,25%	186.244	0,04
Brazilië		426.106	0,09
200.000	MARB BondCo 29/01/31, 3,95%	190.865	0,04
220.000	Petrobras Global Finance 03/06/50, 6,75%	235.241	0,05
China		5.376.471	1,11
200.000	Bank of China 12/07/21, 2,25%	200.790	0,04
200.000	Bank of China 20/11/21, variable	200.220	0,04
500.000	Bank of China 16/01/22, variable	499.928	0,10
750.000	China Construction Bank 24/09/21, variable	750.518	0,16
400.000	CIFI Holdings Group 12/04/27, 4,38%	392.436	0,08
525.000	Country Garden Holdings 12/07/26, 2,70%	520.924	0,11
450.000	ICBCIL Finance 15/05/21, variable	449.909	0,09
650.000	Industrial & Commercial Bank of China 16/04/21, variable	650.101	0,14
200.000	Industrial & Commercial Bank of China 14/06/21, variable	200.033	0,04

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
200.000	Prosus 08/02/51, 3,83%	175.583	0,04
340.000	Tequ Mayflower 02/03/26, ZCP	336.855	0,07
515.000	Times China Holdings 14/01/27, 5,75%	498.924	0,10
600.000	Yuzhou Group Holdings 13/01/27, 6,35%	500.250	0,10
Colombia		334.496	0,07
330.000	Bancolombia 18/12/29, variable	334.496	0,07
Kroatië		959.188	0,20
440.000	Croatia Government International Bond 17/06/31, 1,50%	544.543	0,11
345.000	Croatia Government International Bond 04/03/41, 1,75%	414.645	0,09
Dominicaanse Republiek		1.144.045	0,24
410.000	Dominican Republic International Bond 23/09/32, 4,88%	419.225	0,09
490.000	Dominican Republic International Bond 21/01/41, 5,30%	483.262	0,10
230.000	Dominican Republic International Bond 05/06/49, 6,40%	241.558	0,05
Egypte		833.271	0,17
140.000	Egypt Government International Bond 11/04/25, 4,75%	170.725	0,04
230.000	Egypt Government International Bond 16/02/26, 3,88%	222.295	0,05
230.000	Egypt Government International Bond 29/05/32, 7,63%	236.095	0,04
225.000	Egypt Government International Bond 16/02/61, 7,50%	204.156	0,04
El Salvador		134.625	0,03
150.000	El Salvador Government International Bond 20/01/50, 7,12%	134.625	0,03
Ethiopië		240.380	0,05
260.000	Ethiopia International Bond 11/12/24, 6,63%	240.380	0,05
Finland		792.511	0,17
620.000	Finnair perpetual, variable	792.511	0,17
Gabon		415.809	0,09
400.000	Gabon Government International Bond 12/12/24, 6,38%	415.809	0,09

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Duitsland		3.163.094	0,66
600.000	Allianz perpetual, variable	710.100	0,15
190.000	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank 27/09/21, variable	190.107	0,04
200.000	State of North Rhine-Westphalia Germany 27/08/21, variable	200.106	0,04
900.000	Wintershall DeaFinance 2 Series NC5 perpetual, variable	1.032.992	0,22
900.000	Wintershall DeaFinance 2 Series NC8 perpetual, variable	1.029.789	0,21
Ghana		805.562	0,17
280.000	Ghana Government International Bond 07/04/29, 7,75%	279.650	0,06
355.000	Ghana Government International Bond 11/02/35, 7,88%	331.264	0,07
205.000	Kosmos Energy 01/03/28, 7,50%	194.648	0,04
Honduras		157.500	0,03
150.000	Honduras Government International Bond 24/06/30, 5,63%	157.500	0,03
Hongkong		328.757	0,07
305.000	Bank of East Asia perpetual, variable	328.757	0,07
Hongarije		892.425	0,19
475.000	Hungary Government International Bond 28/04/32, 1,63%	597.605	0,13
235.000	Hungary Government International Bond 05/06/35, 1,75%	294.820	0,06
Italië		671.118	0,14
600.000	Nexi 24/02/28, ZCP	671.118	0,14
Ivoorkust		778.296	0,16
230.000	Ivory Coast Government International Bond 30/01/32, 4,88%	263.629	0,05
100.000	Ivory Coast Government International Bond 17/10/40, 6,88%	123.186	0,03
330.000	Ivory Coast Government International Bond 22/03/48, 6,63%	391.481	0,08
Luxemburg		677.349	0,14
590.000	Altice Financing 15/01/25, 2,25%	677.349	0,14

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Macedonië		806.498	0,17
470.000	North Macedonia Government International Bond 03/06/26, 3,68%	605.579	0,13
175.000	North Macedonia Government International Bond 10/03/28, 1,63%	200.919	0,04
Mexico		2.736.783	0,57
300.000	America Movil 02/03/24, ZCP	372.959	0,08
710.000	Mexico Government International Bond 27/04/32, 4,75%	792.360	0,17
830.000	Mexico Government International Bond 27/04/51, 5,00%	898.624	0,18
720.000	Petroleos Mexicanos 23/01/50, 7,69%	672.840	0,14
Marokko		217.966	0,05
200.000	OCP 25/04/24, 5,63%	217.966	0,05
Nederland		1.397.320	0,29
845.000	Aegon eeuwigdurend, variable	847.604	0,18
555.000	VEON Holdings 25/11/27, 3,38%	549.716	0,11
Pakistan		209.279	0,04
200.000	Pakistan Government International Bond 05/12/27, 6,88%	209.279	0,04
Peru		1.907.585	0,40
3.285.000	Peru Government Bond 12/08/26, 8,20%	1.147.803	0,24
2.435.000	Peru Government Bond 12/08/28, 6,35%	759.782	0,16
Roemenië		1.149.774	0,24
130.000	Romanian Government International Bond 02/12/29, 1,38%	151.746	0,03
335.000	Romanian Government International Bond 16/07/31, 2,12%	402.195	0,08
65.000	Romanian Government International Bond 08/02/38, 3,38%	82.656	0,02
250.000	Romanian Government International Bond 02/12/40, 2,63%	291.513	0,06
180.000	Romanian Government International Bond 28/01/50, 3,38%	221.664	0,05

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Rusland		2.071.417	0,43
52.280.000	Russian Federal Bond - OFZ 12/03/31, 5,90%	640.290	0,13
102.545.000	Russian Federal Bond - OFZ 23/03/33, 7,70%	1.431.127	0,30
Senegal		268.554	0,06
225.000	Senegal Government International Bond 13/03/28, 4,75%	268.554	0,06
Servië		468.422	0,10
360.000	Serbia International Bond 15/05/27, 3,13%	468.422	0,10
Zuid-Afrika		2.566.348	0,54
22.870.000	Republic of South Africa Government Bond 28/02/31, 7,00%	1.266.837	0,26
22.175.000	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8,25%	1.299.511	0,28
Zuid-Korea		2.543.225	0,53
1.185.000	Export-Import Bank of Korea 01/06/21, variable	1.185.812	0,25
200.000	Export-Import Bank of Korea 05/07/22, variable	201.451	0,04
200.000	Industrial Bank of Korea 02/08/21, variable	200.631	0,04
250.000	Korea Development Bank 12/04/21, variable	250.029	0,05
200.000	Korea Development Bank 27/02/22, variable	200.923	0,04
500.000	Korea Development Bank 30/10/22, variable	504.379	0,11
Spanje		1.786.289	0,37
1.400.000	Cellnex Telecom 20/11/31, 0,75%	1.586.436	0,33
200.000	Instituto de Credito Oficial 15/12/21, variable	199.853	0,04
Supranationaal		5.041.085	1,05
127.500.000	Asian Development Bank 30/04/40, ZCP	1.486.420	0,30
16.000.000	European Bank for Reconstruction & Development 15/10/26, ZCP	792.468	0,17
58.000.000	European Bank for Reconstruction & Development 29/01/33, ZCP	1.218.383	0,25
11.750.000	International Bank for Reconstruction & Development 25/05/33, ZCP	250.067	0,05

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
7.200.000	International Finance 09/05/27, ZCP	328.471	0,07
55.300.000	International Finance 29/01/36, ZCP	747.353	0,16
16.400.000	International Finance 22/02/38, ZCP	217.923	0,05
Zwitserland		407.077	0,08
375.000	Credit Suisse Group eeuwigdurend, variable	407.077	0,08
Turkije		203.769	0,04
250.000	Turkey Government International Bond 11/05/47, 5,75%	203.769	0,04
Oekraïne		1.209.657	0,25
370.000	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance 19/07/22, 7,38%	381.770	0,08
830.000	Ukraine Government International Bond 15/03/33, 7,25%	827.887	0,17
Verenigd Koninkrijk		4.423.991	0,92
800.000	AA Bond 31/01/26, 6,50%	1.140.791	0,24
665.000	Heathrow Funding 16/03/28, 2,63%	908.703	0,19
995.000	National Express Group perpetual, variable	1.421.432	0,29
785.000	Vodafone Group 27/08/80, variable	953.065	0,20
Verenigde Staten		979.675	0,20
185.000	Oracle 25/03/51, 3,95%	190.033	0,04
220.000	Oracle 25/03/61, 4,10%	226.625	0,05
260.000	United States Treasury Note 30/04/21, variable	260.017	0,05
303.000	Vine Energy Holdings 15/04/29, 6,75%	303.000	0,06
Venezuela		37.800	0,01
360.000	Venezuela Government International Bond 07/05/28, 9,25%*	37.800	0,01
Vietnam		251.916	0,05
250.000	Mong Duong Finance Holdings 07/05/29, 5,13%	251.916	0,05
Totaal Obligatievermogen		53.019.106	11,05
Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten toegelaten tot de notering op een officiële effectenbeurs		206.232.619	43,00

* Effect in gebreke.

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen	Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Aandelen				450.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Deposit 16/04/21, ZCP	358.056	0,07
Rusland		117.713	0,02	990.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Deposit 14/05/21, ZCP	787.620	0,17
30.663	Sberbank of Russia	117.713	0,02	200.000	New Brunswick Municipal Finance 27/05/21, 4,25%	160.137	0,03
Totaal Aandelenvermogen				200.000	Nova Scotia Treasury Bill 08/04/21, ZCP	159.142	0,03
Obligaties				700.000	Ontario Treasury Bill 07/04/21, ZCP	557.000	0,12
Brazilië		772.806	0,16	250.000	Ontario Treasury Bill 14/04/21, ZCP	198.923	0,04
200.000	Centrais Eletricas Brasileiras 04/02/25, 3,63%	201.756	0,04	300.000	Province of Alberta Coupon Strip 01/06/21, ZCP	238.754	0,05
540.000	Rumo Luxembourg 18/01/25, 5,88%	571.050	0,12	200.000	Province of Alberta's Canadian Note 12/04/21, ZCP	159.140	0,03
Canada				200.000	Province of British Columbia 19/04/21, ZCP	159.136	0,03
200.000	Alberta Treasury Bill 20/04/21, ZCP	159.133	0,03	700.000	Province of British Columbia Canada Interest Strip 04/06/21, ZCP	557.098	0,12
200.000	Canadian Government Bond Coupon Strip 01/06/21, ZCP	159.193	0,03	250.000	Province of Manitoba Canada Treasury Bill 07/04/21, ZCP	198.928	0,04
250.000	CDP Financial 25/05/21, ZCP	249.854	0,05	250.000	PSP Capital 27/04/21, ZCP	198.874	0,04
900.000	City of Montreal Canada 01/12/21, 4,50%	736.658	0,15	1.250.000	Regional Municipality of York 30/06/21, 4,00%	1.004.079	0,22
100.000	City of Quebec Canada 07/06/21, 4,00%	80.330	0,02	580.000	Shopify 01/11/25, 0,13%	664.100	0,14
346.000	City of Quebec Canada 05/03/22, 1,65%	279.542	0,06	250.000	Societe de Transport de Montreal 10/05/21, ZCP	198.892	0,04
200.000	City of Toronto Canada 06/12/21, 3,50%	162.683	0,03	250.000	Societe de Transport de Montreal 17/06/21, ZCP	198.850	0,04
960.000	City of Vancouver 02/12/21, 3,45%	780.421	0,16	Chili			
435.000	Empire Communities 15/12/25, 7,00%	459.469	0,10	1.410.000	Chile Government International Bond 15/04/53, 3,50%	1.427.209	0,30
300.000	Municipal Finance Authority of British Columbia 19/04/21, 1,65%	238.904	0,05	China			
350.000	Municipal Finance Authority of British Columbia 01/06/21, 4,15%	280.365	0,06	400.000	Yingde Gases Investment 19/01/23, 6,25%	413.660	0,09
95.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 07/04/21, ZCP	75.593	0,02	Egypte			
250.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 21/04/21, ZCP	198.920	0,04	14.050.000	Egypt Treasury Bill 12/10/21, ZCP	837.561	0,17
205.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 28/04/21, ZCP	163.103	0,03	Frankrijk			
35.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 05/05/21, ZCP	27.846	0,01	250.000	Electricite De France 07/06/21, ZCP	249.874	0,05

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Japan		16.985.220	3,55
129.550.000	Japan Treasury Discount Bill Series 942 12/04/21, ZCP	1.170.059	0,24
85.700.000	Japan Treasury Discount Bill Series 964 12/04/21, ZCP	774.010	0,16
137.750.000	Japan Treasury Discount Bill 19/04/21, ZCP	1.244.131	0,26
27.800.000	Japan Treasury Discount Bill 26/04/21, ZCP	251.088	0,05
170.800.000	Japan Treasury Discount Bill 10/05/21, ZCP	1.542.712	0,32
159.300.000	Japan Treasury Discount Bill 17/05/21, ZCP	1.438.870	0,30
63.500.000	Japan Treasury Discount Bill 24/05/21, ZCP	573.575	0,12
215.200.000	Japan Treasury Discount Bill 31/05/21, ZCP	1.943.880	0,41
224.900.000	Japan Treasury Discount Bill 07/06/21, ZCP	2.031.550	0,42
162.400.000	Japan Treasury Discount Bill 14/06/21, ZCP	1.467.005	0,31
62.400.000	Japan Treasury Discount Bill 16/06/21, ZCP	563.666	0,12
234.700.000	Japan Treasury Discount Bill 21/06/21, ZCP	2.120.121	0,45
197.850.000	Japan Treasury Discount Bill 28/06/21, ZCP	1.787.315	0,37
8.550.000	Japan Treasury Discount Bill 05/07/21, ZCP	77.238	0,02
Mexico		74.200	0,02
85.000	Petroleos Mexicanos 02/06/41, 6,50%	74.200	0,02
Panama		255.524	0,05
240.000	Cable Onda 30/01/30, 4,50%	255.524	0,05
Peru		494.887	0,10
275.000	Banco de Credito del Peru 01/07/30, variable	275.492	0,05
200.000	Kallpa Generacion 24/05/26, 4,88%	219.395	0,05
Rusland		641.825	0,13
53.255.000	Russian Federal Bond - OFZ 18/07/35, 6,10%	641.825	0,13
Zuid-Korea		650.084	0,14
250.000	Korea Development Bank 28/05/21, ZCP	249.893	0,05
400.000	Korea Development Bank 07/11/21, variable	400.191	0,09

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
Zwitserland		211.955	0,04
200.000	Switzerland Treasury Bill 17/06/21, ZCP	211.955	0,04
Verenigde Staten		138.597.413	28,90
240.000	Adams Homes 15/02/25, 7,50%	252.150	0,05
1.795.000	Advantage Loyalty IP 20/04/29, 5,75%	1.915.355	0,40
650.000	Antero Resources 15/07/26, 8,38%	717.844	0,15
1.105.000	Broadcom 15/02/51, 3,75%	1.063.105	0,22
1.760.000	Community Health Systems 15/02/31, 4,75%	1.721.544	0,36
1.740.000	Continental Resources 15/01/31, 5,75%	1.968.566	0,41
1.760.000	Cornerstone Building Brands 15/01/29, 6,13%	1.877.700	0,39
1.785.000	DISH DBS 01/07/28, 7,38%	1.874.786	0,39
2.030.000	DraftKings 15/03/28, ZCP	2.018.834	0,42
250.000	Electricite de France 28/06/21, ZCP	249.866	0,05
265.000	Endeavor Energy Resources/EER Finance 15/07/25, 6,63%	283.630	0,06
1.540.000	Freedom Mortgage 01/05/26, 7,63%	1.617.924	0,34
1.044.000	JetBlue Airways 01/04/26, 0,50%	1.152.367	0,24
1.000.000	LD Holdings Group LLC 01/11/25, 6,50%	1.050.300	0,22
837.000	Morgan Stanley 28/04/32, variable	786.313	0,16
472.000	OMP Finance 01/04/29, 8,00%	486.160	0,10
1.190.000	Pebblebrook Hotel Trust 15/12/26, 1,75%	1.398.250	0,29
635.000	PennyMac 15/03/26, 5,50%	650.875	0,14
920.000	Redfin 01/04/27, 0,50%	941.850	0,20
490.000	Scripps Escrow II 15/01/31, 5,38%	488.616	0,10
10.000	United States Cash Management Bill 01/06/21, ZCP	9.999	-
2.060.000	United States Cash Management Bill 08/06/21, ZCP	2.059.689	0,43
500.000	United States Cash Management Bill 15/06/21, ZCP	499.956	0,10

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Beleggingsportefeuille per 31 maart 2021 (vervolg)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)

Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen	Aantal aandelen of hoofdsom	Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	Marktwaaarde USD	% Netto-vermogen
1.370.000	United States Cash Management Bill 29/06/21, ZCP	1.369.856	0,29	460.000	United States Treasury Bill 12/08/21, ZCP	459.910	0,10
2.375.000	United States Cash Management Bill 06/07/21, ZCP	2.374.704	0,50	285.000	United States Treasury Bill 19/08/21, ZCP	284.950	0,06
6.610.000	United States Cash Management Bill 13/07/21, ZCP	6.609.159	1,38	2.920.000	United States Treasury Bill 26/08/21, ZCP	2.919.355	0,61
1.510.000	United States Cash Management Bill 20/07/21, ZCP	1.509.748	0,31	7.210.000	United States Treasury Bill 02/09/21, ZCP	7.208.305	1,50
8.020.000	United States Treasury Bill 01/04/21, ZCP	8.020.000	1,67	2.560.000	United States Treasury Bill 09/09/21, ZCP	2.559.081	0,53
1.155.000	United States Treasury Bill 06/04/21, ZCP	1.154.986	0,24	200.000	United States Treasury Bill 16/09/21, ZCP	199.968	0,04
3.080.000	United States Treasury Bill 08/04/21, ZCP	3.079.990	0,64	500.000	United States Treasury Bill 23/09/21, ZCP	499.927	0,10
2.780.000	United States Treasury Bill 13/04/21, ZCP	2.779.962	0,58	450.000	United States Treasury Bill 30/09/21, ZCP	449.915	0,09
3.310.000	United States Treasury Bill 20/04/21, ZCP	3.309.909	0,69	125.000	United States Treasury Bill 04/11/21, ZCP	124.926	0,03
1.902.200	United States Treasury Bill 22/04/21, ZCP	1.902.126	0,40	131.000	Vine Oil & Gas/Vine Oil & Gas Finance 15/04/23, 8,75%	140.105	0,03
4.843.000	United States Treasury Bill 27/04/21, ZCP	4.842.720	1,01	1.383.000	Vine Oil & Gas/Vine Oil & Gas Finance 15/04/23, 9,75%	1.482.403	0,31
1.030.000	United States Treasury Bill 29/04/21, ZCP	1.029.985	0,21		Venezuela	10.424	-
2.878.000	United States Treasury Bill 04/05/21, ZCP	2.877.846	0,60	220.000	Petroleos de Venezuela 15/11/26, 6,00%*	10.424	-
3.575.000	United States Treasury Bill 06/05/21, ZCP	3.574.809	0,75		Totaal Obligatievermogen	171.473.385	35,75
567.000	United States Treasury Bill 11/05/21, ZCP	566.978	0,12		Totaal Overdraagbare effecten en Geldmarktinstrumenten verhandeld op een andere Gereguleerde Markt	171.591.098	35,77
11.315.000	United States Treasury Bill 13/05/21, ZCP	11.314.563	2,36		Aantal aandelen of hoofdsom	Marktwaarde USD	% Netto-vermogen
17.837.000	United States Treasury Bill 18/05/21, ZCP	17.836.474	3,72		Warrants		
4.900.000	United States Treasury Bill 20/05/21, ZCP	4.899.450	1,02		Verenigde Staten	23.595	-
4.835.000	United States Treasury Bill 25/05/21, ZCP	4.834.764	1,01	7.865	Ribbit LEAP Warrants 09/09/25	23.595	-
3.301.000	United States Treasury Bill 27/05/21, ZCP	3.300.602	0,69		Totaal Warrants	23.595	-
1.180.000	United States Treasury Bill 03/06/21, ZCP	1.179.904	0,25		Totaal Beleggingen	377.847.312	78,77
890.000	United States Treasury Bill 10/06/21, ZCP	889.911	0,19		Overige Nettoactiva	101.816.294	21,23
2.910.000	United States Treasury Bill 17/06/21, ZCP	2.909.782	0,61		Netto-inventariswaarde	479.663.606	100,00
4.280.000	United States Treasury Bill 24/06/21, ZCP	4.279.820	0,89				
735.000	United States Treasury Bill 01/07/21, ZCP	734.841	0,15				

* Effect in gebreke.

De toelichtingen op pagina's 52 tot 130 maken integraal deel uit van deze jaarrekening.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021

De Vennootschap

De Vennootschap is een beleggingsvennootschap van het open type die georganiseerd is als een naamloze vennootschap ('société anonyme') naar het recht van het Groothertogdom Luxemburg en in aanmerking komt als een beleggingsvennootschap met veranderlijk kapitaal (société d'investissement à capital variable ('sicav')). De Vennootschap heeft uitsluitend als doel haar beschikbare middelen te beleggen in overdraagbare effecten van enigerlei aard en andere toegestane activa, met inbegrip van financiële derivaten, teneinde de beleggingsrisico's te spreiden en haar Aandeelhouders de resultaten van het beheer van haar portefeuilles te kunnen bieden.

De beleggingsstrategie van elk subfonds is gebaseerd op een alternatieve beleggingsstrategie die is ontworpen door elk van de Beleggingsbeheerders.

Aandelencategorieën

Aandelen worden doorgaans uitgegeven als Kapitalisatieaandelen. Uitkeringsaandelen worden in een subfonds alleen uitgegeven als de Bestuurders dat beslissen. Beleggers kunnen bij de Beheermaatschappij of hun Distributeur vragen of er voor een bepaalde Aandelencategorie of een bepaald subfonds Uitkeringsaandelen beschikbaar zijn.

De Bestuurders kunnen besluiten om binnen elk subfonds verschillende Aandelencategorieën te creëren, waarvan de activa gezamenlijk zullen worden belegd volgens het specifieke beleggingsbeleid van het betreffende subfonds, maar waarbij er voor elke Aandelencategorie een specifieke kostenstructuur, noteringsvaluta of andere specifieke kenmerken kunnen gelden. Voor elke Aandelencategorie zal per Aandeel een afzonderlijke Intrinsieke Waarde worden berekend, die als gevolg van deze variabele factoren per Aandelencategorie kan verschillen. De beschikbare Aandelencategorieën voor elk subfonds worden in detail beschreven in het huidige prospectus.

De E-Aandelencategorie is niet verkrijgbaar via Schroders' wereldwijde netwerk van distributeurs. Voor alle vragen hierover kunt u terecht bij de Beheermaatschappij.

Instapvergoeding

De Beheermaatschappij en de Distributeurs hebben recht op een instapvergoeding, waar naar goedgevonden van de Bestuurders volledig of gedeeltelijk kan worden afgezien.

Aandelencategorieën	Instapvergoeding
A ¹ - en K-Aandelen	Maximaal 3,09278% van de Intrinsieke Waarde per Aandeel
A1-Aandelen	Maximaal 2,04081% van de Intrinsieke Waarde per Aandeel
C-, C1-, E- en F-Aandelen	Maximaal 1,01010% van de Intrinsieke Waarde per Aandeel
I-, IF-, N-, R- en X-Aandelen	Geen instapvergoeding

Distributiekosten

Op de datum van dit verslag geldt een tarief voor de distributiekosten van 0,50% op alle A1-Aandelencategorieën van Schroder GAIA. Binnen de Vennootschap worden op andere Aandelencategorieën voor beleggingen geen andere distributiekosten in rekening gebracht.

Swing Pricing

De Intrinsieke Waarde per Aandeel van een subfonds kan verwateren wanneer beleggers Aandelen van het subfonds kopen of verkopen tegen een prijs die niet representatief is voor de handelskosten en andere kosten die ontstaan wanneer de Beleggingsbeheerder portefeuilletransacties verricht in het kader van de inkomende en uitgaande cashflows. Om de impact daarvan te beperken, kan er een swingpricingmechanisme worden gebruikt om de belangen van de Aandeelhouders in het compartiment te beschermen. Als de totale nettotransacties met Aandelen van een subfonds op een Waarderingsdag een vooraf bepaalde drempel overschrijden die voor elk subfonds periodiek door de Beheermaatschappij wordt vastgesteld en gecontroleerd, dan kan de Intrinsieke Waarde per Aandeel naar boven of naar beneden worden aangepast om de respectieve netto-instroom en netto-uitstroom te weerspiegelen.

De nettokapitaalstromen zullen door de Beheermaatschappij worden vastgesteld op basis van de laatste beschikbare informatie op het tijdstip van de berekening van de Intrinsieke Waarde per Aandeel. De mate van de prijsaanpassing wordt bepaald door de Beheermaatschappij, waarbij rekening gehouden wordt met transactie- en andere kosten. Deze aanpassing kan van compartiment tot compartiment verschillen en zal niet meer bedragen dan 2% van de oorspronkelijke Intrinsieke Waarde per Aandeel.

Het mechanisme is voor subfondsen van Schroder GAIA ingevoerd sinds hun oprichting.

Op 31 maart 2021, de laatste Berekeningsdag van de verslagperiode, werd er een aanpassing voor swing pricing toegepast op Schroder GAIA Cat Bond, Schroder GAIA Contour Tech Equity, Schroder GAIA Egerton Equity, Schroder GAIA Sirios US Equity, Schroder GAIA Two Sigma Diversified en Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund. De officiële Intrinsieke Waarde per Aandeel van deze subfondsen na de toepassing van de swingpricingaanpassing op die datum, wordt weergegeven in de volgende tabel. Alle andere financiële informatie in dit verslag wordt weergegeven vóór enige Swing Pricing-aanpassingen.

¹ De instapvergoeding voor Schroder GAIA Cat Bond Share Categorie A bedraagt tot 1,01010% van de Intrinsieke Waarde per Aandeel.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Swing Pricing (vervolg)

	Valuta	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Sirios US Equity	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund
Intrinsieke Waarde per Aandeel* (inclusief aanpassing voor swing pricing)							
per 31 maart 2021							
Categorie A Acc	EUR	-	-	216,62	-	-	-
Categorie A Acc	USD	1.448,89	136,38	-	146,94	-	-
Categorie A Acc CHF Hedged	CHF	-	127,09	-	175,57	-	-
Categorie A Acc EUR Hedged	EUR	-	128,73	-	132,26	-	-
Categorie A Acc GBP Hedged	GBP	-	-	202,46	-	-	-
Categorie A Acc SEK Hedged	SEK	904,08	-	-	-	-	-
Categorie A Acc SGD Hedged	SGD	-	189,13	-	-	-	-
Categorie A Acc USD Hedged	USD	-	-	214,23	-	-	-
Categorie A Dis GBP	GBP	-	-	204,79	-	-	-
Categorie A1 Acc	EUR	-	-	203,53	-	-	-
Categorie A1 Acc	USD	-	135,94	-	-	-	-
Categorie A1 Acc USD Hedged	USD	-	-	206,83	-	-	-
Categorie C Acc	EUR	-	-	232,63	-	-	-
Categorie C Acc	USD	1.455,05	140,23	-	153,36	111,41	-
Categorie C Acc	GBP	-	-	-	-	-	111,53
Categorie C Acc CHF Hedged	CHF	1.149,78	132,12	-	181,01	100,78	140,98
Categorie C Acc EUR Hedged	EUR	1.208,79	132,07	-	137,64	102,67	126,17
Categorie C Acc GBP Hedged	GBP	103,44	108,31	215,78	143,16	106,48	-
Categorie C Acc SEK Hedged	SEK	-	1.095,05	-	-	-	-
Categorie C Acc SGD Hedged	SGD	-	193,27	-	-	-	-
Categorie C Acc USD Hedged	USD	-	-	230,11	-	-	148,76
Categorie C Dis	EUR	-	-	232,00	-	-	-
Categorie C Dis GBP	GBP	-	-	220,30	-	-	-
Categorie C Dis GBP Hedged	GBP	-	-	-	143,07	-	-
Categorie E Acc	EUR	-	-	230,82	-	-	-
Categorie E Acc	USD	-	140,84	-	163,66	-	-
Categorie E Acc CHF Hedged	CHF	-	131,41	-	-	-	-
Categorie E Acc EUR Hedged	EUR	-	132,54	-	147,54	-	-
Categorie E Acc GBP Hedged	GBP	-	107,88	-	-	-	-
Categorie E Acc SEK Hedged	SEK	-	1.091,62	-	-	-	-
Categorie E Acc SGD Hedged	SGD	-	194,52	-	-	-	-
Categorie F Acc	USD	1.447,61	-	-	-	-	-
Categorie F Acc CHF Hedged	CHF	1.146,73	-	-	-	-	-
Categorie F Acc EUR Hedged	EUR	1.203,12	-	-	-	-	-
Categorie F Dis	USD	1.176,24	-	-	-	-	-
Categorie F Dis SGD Hedged	SGD	1.573,16	-	-	-	-	-
Categorie I Acc	EUR	-	-	329,81	-	-	-
Categorie I Acc	USD	1.628,49	160,28	-	196,01	128,80	-
Categorie I Acc	GBP	-	-	-	-	-	117,27
Categorie I Acc CHF Hedged	CHF	1.385,89	-	-	-	-	-
Categorie I Acc EUR Hedged	EUR	1.459,28	-	-	-	-	-
Categorie I Acc JPY Hedged	JPY	10.408,64	-	-	-	-	-
Categorie I Acc USD Hedged	USD	-	-	265,63	-	-	-
Categorie IF Acc	USD	1.491,57	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc CHF Hedged	CHF	1.269,11	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc EUR Hedged	EUR	1.336,41	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc SEK Hedged	SEK	910,72	-	-	-	-	-
Categorie IF Dis QV	USD	1.399,90	-	-	-	-	-
Categorie K Acc	USD	-	-	-	-	109,14	-
Categorie K Acc CHF Hedged	CHF	-	-	-	-	98,69	-
Categorie K Acc EUR Hedged	EUR	-	-	-	-	100,40	124,06
Categorie K Acc USD Hedged	USD	-	-	-	-	-	146,23
Categorie R Acc	GBP	-	-	-	-	-	111,49
Categorie R Acc EUR Hedged	EUR	-	-	-	-	-	126,20
Categorie R Acc USD Hedged	USD	-	-	-	-	-	148,77
Categorie X Acc	EUR	-	-	231,23	-	-	-
Categorie X Acc	USD	-	-	-	101,41	-	-
Categorie X Acc EUR Hedged	EUR	-	-	-	146,48	-	-

* De Intrinsieke Waarde per Aandeel van elke Aandelen categorie is vermeld in de valuta van de Aandelen categorie.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Minimale inleg, minimale bijkomende inleg en minimumdeelneming

Compartimenten	Aandelen categorieën	Minimuminleg		Minimale bijkomende inleg		Minimumdeelneming	
Schroder GAIA BlueTrend							
	A-, C-, E- en N-Aandelen	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Aandelen	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
Schroder GAIA Cat Bond							
	A-, C- en F-Aandelen	USD	100.000	USD	50.000	USD	100.000
	I-Aandelen	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
	IF-Aandelen	USD	1.000.000	USD	500.000	USD	1.000.000
Schroder GAIA Contour Tech Equity							
	A-, A1-, C- en E-Aandelen	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Aandelen	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
Schroder GAIA Egerton Equity							
	A-, A1-, C- en E-Aandelen	EUR	10.000	EUR	5.000	EUR	10.000
	I-Aandelen	EUR	5.000.000	EUR	2.500.000	EUR	5.000.000
	X-Aandelen	EUR	100.000.000	EUR	2.500.000	EUR	100.000.000
Schroder GAIA Helix							
	A-, C-, C1- en E-Aandelen	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Aandelen	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
	X-Aandelen	USD	100.000.000	USD	2.500.000	USD	100.000.000
Schroder GAIA M&A*							
	A-, C- en E-Aandelen	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Aandelen	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
Schroder GAIA Sirios US Equity							
	A-, C- en E-Aandelen	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Aandelen	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
	X-Aandelen	USD	100.000.000	USD	2.500.000	USD	100.000.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
	C- en K-Aandelen	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Aandelen	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund							
	C- en K-Aandelen	GBP	10.000	GBP	5.000	GBP	10.000
	I-Aandelen	GBP	5.000.000	GBP	2.500.000	GBP	5.000.000
	R-Aandelen		Nul		Nul		Nul
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
	A-, A1-, C-, C1- en E-Aandelen	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Aandelen	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Overzicht van belangrijke grondslagen voor financiële verslaggeving

De jaarrekening is opgesteld en gepresenteerd in overeenstemming met de algemeen aanvaarde boekhoudprincipes in Luxemburg voor beleggingsfondsen op basis van een gewaarborgde continuïteit. Het Subfonds Schroder GAIA M&A werd vereffend na de verslagperiode. Subfondsen die na afloop van de periode zijn vereffend of bestemd zijn om te worden vereffend, worden voorbereid op basis van niet-voortgezette activiteit. De toepassing van de veronderstelling dat de bedrijfsactiviteiten niet worden voortgezet, heeft niet geleid tot materiële aanpassingen van de gepubliceerde intrinsieke waarde van de Subfondsen.

Netto-inventariswaarde

Berekening van de Netto-inventariswaarde per aandeel

De Intrinsieke Waarde per Aandeel van elke Aandelencategorie wordt op de Berekeningsdag berekend in de valuta van de betreffende Aandelencategorie. Ze wordt berekend door de Intrinsieke Waarde die aan elke Aandelencategorie kan worden toegerekend, namelijk de evenredige waarde van de activa min de verplichtingen van die Aandelencategorie, te delen door het aantal Aandelen van die Aandelencategorie die op dat moment in omloop zijn. De resulterende som wordt afgerond tot vier decimalen. Meer informatie over de regels die van toepassing zijn bij het waarderen van de totale activa is terug te vinden in het huidige prospectus.

Waardering van de activa van de Vennootschap

De waarde van beschikbare of gestorte contanten, wissels en accepten en handelsvorderingen, vooruitbetaalde kosten, gedeclareerde dividenden in contanten of aangegroeide rente zoals eerder vermeld die nog niet zijn ontvangen, wordt geacht het volledige bedrag daarvan te vertegenwoordigen, tenzij het onwaarschijnlijk is dat het betreffende bedrag volledig zal worden betaald of ontvangen, in welk geval de waarde daarvan zal worden vastgesteld na de toepassing van een korting die de Vennootschap in dat geval gepast acht om de reële waarde daarvan te weerspiegelen.

De waarde van effecten, financiële derivaten en activa wordt bepaald op basis van de prijzen bij de sluiting van de markt op de Werkdag, op de effectenbeurs of een andere Gereguleerde Markt waarop deze effecten of activa worden verhandeld of tot de handel zijn toegelaten. Als een effect niet op een officiële effectenbeurs of Gereguleerde Markt wordt verhandeld of is toegelaten, of in geval van aldus verhandelde of toegelaten effecten waarvan de laatste bekende prijs niet de reële waarde ervan weerspiegelt, dan dienen de Bestuurders zich te baseren op de verwachte verkoopprijs ervan, die voorzichtig en te goeder trouw zal worden gewaardeerd.

De financiële derivaten die niet genoteerd zijn op een officiële effectenbeurs of worden verhandeld op een andere georganiseerde markt moeten dagelijks worden onderworpen aan een betrouwbare en controleerbare waardering en moeten op initiatief van de Vennootschap op elk moment via een salderende transactie tegen hun reële waarde kunnen worden verkocht, vereffend of afgesloten.

Indien een van de bovenvermelde waarderingsprincipes niet overeenstemt met de waarderingsmethode die gewoonlijk wordt gehanteerd op specifieke markten, of als dergelijke waarderingsprincipes niet nauwkeurig lijken om de waarde van de activa van de Vennootschap te kunnen bepalen, dan kunnen de Bestuurders te goeder trouw en in overeenstemming met de algemeen aanvaarde waarderingsprincipes en -procedures andere waarderingsprincipes vaststellen.

Deelbewijzen of aandelen in ICB's van het open-endtype zullen worden gewaardeerd op basis van hun laatste beschikbare Intrinsieke Waarde zoals gerapporteerd door deze ICB's.

Prijsberekening op basis van de reële waarde

De Bestuurders behouden zich het recht voor om de toepassing van de prijsberekeningsmethode op basis van de reële waarde in te voeren wanneer zij dat gepast achten.

Per 31 maart 2021 werd de aanpassing naar de reële waarde toegepast voor het volgende effect:

Compartiment	Naam effect
Schroder GAIA Cat Bond	Voussoir Re perpetual, variabel
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Butterfly Network

Belasting

De Vennootschap is in Luxemburg niet onderworpen aan inkomsten- of vermogenswinstbelasting.

De enige belasting waaraan de Vennootschap is onderworpen, is de 'taxe d'abonnement' tegen een tarief van 0,05% per jaar op basis van de Intrinsieke Waarde van elk compartiment aan het einde van het betreffende kwartaal, die elk kwartaal wordt berekend en betaald.

Voor Aandelencategorieën of subfondsen die zijn voorbehouden aan institutionele beleggers (in de zin van Artikel 174 van de Wet van Dec 17ember 2010, zoals gewijzigd), wordt de belasting geheven tegen het tarief van 0,01% per jaar.

Door de Vennootschap ontvangen rente- en dividendinkomsten kunnen in het land van herkomst aan een niet-terugvorderbare bronbelasting onderworpen zijn. Bovendien kan de Vennootschap onderworpen zijn aan belasting over de gerealiseerde of niet-gerealiseerde stijging van de kapitaalwaarde van haar activa in die landen, en in bepaalde rechtsgebieden kunnen hiervoor voorzieningen worden opgenomen.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Beheervergoedingen

De Beleggingsbeheerders hebben recht op een beheervergoeding voor hun diensten die dagelijks wordt berekend en verrekend op basis van de Intrinsieke Waarde van de Subfondsen en maandelijks wordt betaald. De actuele te betalen bedragen voor de beoordelingsperiode staan vermeld in de volgende tabel:

Compartimenten	Aandelencategorie	Beheervergoeding
Schroder GAIA BlueTrend	A-Aandelen	1,60%
	C-, E- en N-Aandelen	1,00%
	I-Aandelen	Geen
Schroder GAIA Cat Bond	A- en F-Aandelen	1,50%
	C- en IF-Aandelen	1,10%
	I-Aandelen	Geen
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A- en A1-Aandelen	2,00%
	C-Aandelen	1,25%
	E-Aandelen	1,00%
	I-Aandelen	Geen
Schroder GAIA Egerton Equity	A- en A1-Aandelen	2,00%
	C- en E-Aandelen	1,25%
	X-Aandelen (huidig tarief)	tot 1,25% (1,25%)
	I-Aandelen	Geen
Schroder GAIA Helix	A-Aandelen	2,00%
	C- en C1-Aandelen	1,00%
	E-Aandelen	0,75%
	X-Aandelen (huidig tarief)	tot 1,00% (0,60%)
	I-Aandelen	Geen
Schroder GAIA M&A*	A-Aandelen	1,50%
	C-Aandelen	0,75%
	E-Aandelen	0,50%
	I-Aandelen	Geen
Schroder GAIA Sirios US Equity	A-Aandelen	2,00%
	C-Aandelen	1,25%
	E-Aandelen	1,00%
	X-Aandelen (huidig tarief)	tot 1,25% (1,25%)
	I-Aandelen	Geen
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C-Aandelen	1,40%
	K-Aandelen	1,90%
	I-Aandelen	Geen
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	C ¹ - en R ² -Aandelen	0,75%
	K ³ Aandelen	1,25%
	I-Aandelen	Geen
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A- en A1-Aandelen	2,00%
	C- en C1-Aandelen	1,25%
	E-Aandelen	0,75%
	I-Aandelen	Geen

Naar keuze van de Beheermaatschappij kan gedeeltelijk van deze vergoedingen worden afgezien.

¹ 1,00% tot 31 oktober 2020; 0,75% sinds 1 november 2020.

² 1,00% tot 31 december 2020; 0,75% sinds 1 januari 2021.

³ 1,50% tot 31 oktober 2020; 0,75% sinds 1 november 2020.

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Vergoedingen van de Bestuurders

Marie-Jeanne Chevremont-Lorenzini, Bernard Herman en Eric Bertrand hebben elk een vergoeding van EUR 10.083 ontvangen voor de verslagperiode. Hugh Mullan heeft een vergoeding van EUR 8.000 ontvangen voor de verslagperiode. De resterende bestuurders hebben afstand gedaan van hun vergoeding.

Prestatievergoedingen

Er is een prestatievergoeding verschuldigd in geval van outperformance, d.w.z. als de stijging in de Intrinsieke Waarde per Aandeel tijdens de betreffende prestatieperiode hoger ligt dan het High Water Mark, nl. ten opzichte van de hoogste Intrinsieke Waarde per Aandeel aan het einde van een vorige prestatieperiode (het High Water Mark).

De prestatievergoeding van een Aandelen categorie groeit op elke Werkdag aan en wordt op de volgende Berekeningsdag opgenomen in de Intrinsieke Waarde van de subfondsen op basis van het verschil tussen de Intrinsieke Waarde per Aandeel vastgesteld op dezelfde Berekeningsdag (vóór de aftrek van enige voorziening voor de prestatievergoeding) en de hurdle rate, vermenigvuldigd met het gemiddelde aantal Aandelen dat tijdens de boekperiode in omloop was, of in geval van een prestatievergoeding die gebaseerd is op de outperformance ten opzichte van een benchmark, de hoogste waarde van de nagestreefde Intrinsieke Waarde per Aandeel (dat wil zeggen, de hypothetische Intrinsieke Waarde per Aandeel uitgaande van een rendement op basis van de benchmark tot de voorgaande Werkdag) of het High Water Mark, vermenigvuldigd met het gemiddelde aantal Aandelen dat tijdens de boekperiode in omloop was. Voor I-Aandelen wordt er geen prestatievergoeding berekend.

In de onderstaande tabel wordt er gedetailleerde informatie verstrekt over de berekeningen van de prestatievergoeding voor de verslagperiode. Meer informatie over de berekening van prestatievergoedingen is vermeld in het huidige prospectus. De vergoedingen die voor de periode moeten worden betaald, zijn in het Overzicht van het nettovermogen opgenomen onder 'Te betalen prestatievergoedingen'.

Compartmenten	Beleggingsbeheerder	Benchmark
Schroder GAIA BlueTrend	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend BRL Hedged*	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend CHF Hedged	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend EUR Hedged	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend GBP Hedged	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA BlueTrend SGD Hedged	Systematica Investments Limited	
Schroder GAIA Contour Tech Equity	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity CHF Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity EUR Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity GBP Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity SEK Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Contour Tech Equity SGD Hedged	Contour Asset Management, LLC	
Schroder GAIA Egerton Equity	Egerton Capital (UK) LLP	EONIA + 1,00%
Schroder GAIA Egerton Equity GBP Hedged	Egerton Capital (UK) LLP	SONIA + 1,00%
Schroder GAIA Egerton Equity JPY Hedged	Egerton Capital (UK) LLP	Mutan JYMUON + 1.00%
Schroder GAIA Egerton Equity USD Hedged	Egerton Capital (UK) LLP	US Overnight + 1,00%
Schroder GAIA Helix	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix CHF Hedged	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix EUR Hedged	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix GBP Hedged	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix JPY Hedged	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA Helix SGD Hedged	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA M&A*	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA M&A CHF Hedged*	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA M&A EUR Hedged*	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA M&A GBP Hedged*	Schroders Investment Management Limited	
Schroder GAIA Sirios US Equity	Sirios Capital Management LP	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Sirios US Equity CHF Hedged	Sirios Capital Management LP	BBA LIBOR CHF 3 Month Act 360
Schroder GAIA Sirios US Equity EUR Hedged	Sirios Capital Management LP	BBA LIBOR EUR 3 Month Act 360
Schroder GAIA Sirios US Equity GBP Hedged	Sirios Capital Management LP	BBA LIBOR GBP 3 Month Act 365
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified CHF Hedged	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified EUR Hedged	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified GBP Hedged	Two Sigma Advisers LP	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund CHF Hedged	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund EUR Hedged	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund USD Hedged	BennBridge Ltd.	
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Wellington Pagosa BRL Hedged	Wellington Management International Limited	Brazil CETIP DI Interbank Deposit Rate
Schroder GAIA Wellington Pagosa CHF Hedged	Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Wellington Pagosa EUR Hedged	Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Wellington Pagosa GBP Hedged	Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360
Schroder GAIA Wellington Pagosa SGD Hedged	Wellington Management International Limited	BBA LIBOR USD 3 Month Act 360

Voor Schroder GAIA Contour Tech Equity, Schroder GAIA Egerton Equity, Schroder GAIA Two Sigma Diversified en Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund bedraagt de prestatievergoeding 20% van de outperformance.

Voor Schroder GAIA Helix, Schroder GAIA M&A*, Schroder GAIA Sirios US Equity en Schroder GAIA Wellington Pagosa bedraagt de prestatievergoeding 20% van de outperformance (met uitzondering van de E-Aandelen, waarvoor de prestatievergoeding 15% van de outperformance bedroeg).

Voor Schroder GAIA BlueTrend bedraagt de prestatievergoeding 10% van de outperformance.

Voor Schroder GAIA Cat Bond wordt er geen prestatievergoeding gerekend.

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Herbelegging van onderpand in contanten

Om het tegenpartijrisico te beperken, zullen compartimenten met valuta-afdekkingstransacties voor afgedekte Aandelen categorieën dagelijks aan de tegenpartij onderpand in contanten betalen of van de tegenpartij onderpand in contanten ontvangen, wat hun blootstelling over de looptijd van het termijncontract vermindert.

Beleggingsbeheerders kunnen het onderpand in contanten dat zij van de tegenpartij ontvangen in het kader van valuta-afdekkingstransacties herbeleggen.

Te ontvangen of te betalen onderpand op de vervaldatum van de termijncontracten wordt in het Overzicht van het nettovermogen weergegeven als 'Te ontvangen/Te betalen onderpand op termijncontracten voor categorieën met afgedekte valuta, netto'. Te ontvangen of te betalen calls voor onderpand worden in het Overzicht van de netto-activa weergegeven als 'Te ontvangen/Te betalen calls voor onderpand op termijncontracten voor klassen met afgedekte valuta'.

Valutatermijncontracten

Uitstaande valutatermijncontracten zijn gewaardeerd tegen de laatste beschikbare prijs op de Berekeningsdag van de IW, op basis van de termijnvalutakoers die van toepassing is op de looptijd van het betreffende contract. De niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering) wordt weergegeven in het Overzicht van het nettovermogen onder 'Netto niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering) van valutatermijncontracten'.

Op 31 maart 2021 bestonden er voor de volgende subfondsen valutatermijncontracten:

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA BlueTrend					
Portefeuilleafdekking					
AUD	9.000.000	USD	7.032.840	21 apr 2021	(196.257)
BRL	1.403.318	USD	250.749	28 apr 2021	(1.775)
BRL	15.665.439	USD	2.808.646	16 jun 2021	(39.747)
CAD	33.519.569	USD	26.551.676	21 apr 2021	122.134
CLP	4.875.031.309	USD	6.714.519	16 jun 2021	55.334
CNH	16.813	USD	2.557	7 apr 2021	4
CNH	21.265.424	USD	3.267.384	21 apr 2021	(32.131)
EUR	7.100.000	USD	8.439.649	21 apr 2021	(110.716)
GBP	400.000	USD	551.832	6 apr 2021	(389)
GBP	8.500.000	USD	11.858.284	21 apr 2021	(139.563)
HUF	550.610.734	USD	1.830.158	21 apr 2021	(47.554)
IDR	119.858.079.089	USD	8.453.747	16 jun 2021	(247.498)
INR	1.621.646.092	USD	21.940.108	16 jun 2021	24.119
JPY	985.514.290	USD	9.140.508	21 apr 2021	(238.401)
JPY	22.993	USD	223	15 sep 2021	(15)
KRW	1.319.690.500	USD	1.173.786	16 jun 2021	(7.787)
MXN	8.343.765	USD	405.334	5 apr 2021	2.884
MXN	8.283.435	USD	404.593	6 apr 2021	628
MXN	84.201.136	USD	4.076.367	21 apr 2021	35.973
NOK	1.835.796	USD	214.672	6 apr 2021	(38)
NOK	985.661	USD	115.511	7 apr 2021	(271)
NOK	85.021.577	USD	9.987.338	21 apr 2021	(46.833)
NZD	19.400.000	USD	14.017.081	21 apr 2021	(468.424)
PHP	373.079.020	USD	7.696.981	16 jun 2021	(27.005)
PLN	8.039.327	USD	2.111.736	21 apr 2021	(77.297)
RUB	492.520.873	USD	6.613.498	16 jun 2021	(159.234)
SEK	307.207	USD	35.158	6 apr 2021	18
SEK	104.787.080	USD	12.490.600	21 apr 2021	(490.418)
SGD	10.416.804	USD	7.831.369	21 apr 2021	(88.337)
THB	220.289.052	USD	7.260.145	21 apr 2021	(211.422)
TWD	151.873.538	USD	5.534.871	16 jun 2021	(210.086)
USD	9.463.842	AUD	12.300.000	21 apr 2021	120.511
USD	452.179	AUD	590.000	28 apr 2021	3.988
USD	7.362.710	BRL	42.233.008	16 jun 2021	(102.065)
USD	7.321.706	CAD	9.209.799	21 apr 2021	(7.160)
USD	433.426	CAD	545.000	28 apr 2021	(272)
USD	1.304.075	CAD	1.691.820	19 mei 2021	(42.253)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Valutatermijncontracten (vervolg)

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA BlueTrend (vervolg)					
USD	101.688	CHF	95.000	28 apr 2021	1.112
USD	3.164.390	CLP	2.324.301.991	16 jun 2021	(63.319)
USD	2.560	CNH	16.813	7 apr 2021	-
USD	230.577	CNH	1.500.562	21 apr 2021	2.285
USD	10.440	CZK	230.000	28 apr 2021	105
USD	351.986	EUR	300.000	6 apr 2021	168
USD	13.557.899	EUR	11.400.000	21 apr 2021	184.680
USD	2.515.979	EUR	2.115.000	28 apr 2021	34.534
USD	11.735.027	GBP	8.500.000	21 apr 2021	16.304
USD	751.301	GBP	545.000	28 apr 2021	(93)
USD	585.835	HKD	4.550.000	28 apr 2021	519
USD	426.868	HUF	132.170.153	6 apr 2021	(1.116)
USD	6.186.451	HUF	1.907.032.912	21 apr 2021	12.430
USD	6.871	HUF	2.125.000	28 apr 2021	(8)
USD	3.249.621	IDR	46.744.932.309	16 jun 2021	49.162
USD	11.536.172	INR	855.453.051	16 jun 2021	(50.426)
USD	11.029.433	JPY	1.186.194.441	21 apr 2021	314.593
USD	790.615	JPY	85.875.000	28 apr 2021	14.852
USD	710.979	JPY	73.462.078	15 sep 2021	46.393
USD	978.093	KRW	1.105.886.735	28 apr 2021	1.086
USD	2.865.921	KRW	3.247.800.674	16 jun 2021	(3.642)
USD	990	MXN	20.437	5 apr 2021	(10)
USD	658	MXN	13.488	6 apr 2021	(2)
USD	779.001	MXN	16.118.452	21 apr 2021	(8.216)
USD	214.865	NOK	1.835.796	6 apr 2021	230
USD	6.221	NOK	53.203	7 apr 2021	1
USD	6.637.293	NOK	56.875.422	21 apr 2021	(12.430)
USD	70.161	NZD	100.000	6 apr 2021	321
USD	11.869.116	NZD	16.600.000	21 apr 2021	275.933
USD	24.476	NZD	35.000	28 apr 2021	33
USD	1.382.446	PHP	66.892.580	16 jun 2021	7.230
USD	4.839.611	PLN	18.733.395	21 apr 2021	98.920
USD	5.152	PLN	20.000	28 apr 2021	91
USD	5.760.651	RUB	438.713.100	16 jun 2021	11.512
USD	299.351	SEK	2.611.822	6 apr 2021	288
USD	4.906.513	SEK	42.242.273	21 apr 2021	68.947
USD	114.814	SEK	985.000	28 apr 2021	2.005
USD	6.443.029	SGD	8.663.714	21 apr 2021	3.100
USD	118.953	SGD	160.000	28 apr 2021	26
USD	5.214.718	THB	160.756.759	21 apr 2021	70.883
USD	97.200	THB	2.996.347	28 apr 2021	1.326
USD	298.060	TRY	2.460.000	28 apr 2021	5.356
USD	9.897.184	TWD	276.366.124	16 jun 2021	207.607
USD	411	ZAR	6.137	6 apr 2021	(5)
USD	1.768.443	ZAR	26.975.173	21 apr 2021	(55.037)
USD	3.142.616	ZAR	47.190.000	28 apr 2021	(44.409)
ZAR	4.553.104	USD	307.817	6 apr 2021	612
ZAR	104.649.117	USD	6.960.533	21 apr 2021	113.593
ZAR	75.710.000	USD	5.075.092	28 apr 2021	38.062

USD (1.281.769)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Valutatermijncontracten (vervolg)

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA BlueTrend (vervolg)					
Afdekking van aandelencategorieën					
BRL	38.464.021	USD	6.903.213	30 apr 2021	(79.793)
CHF	429.510	USD	459.944	30 apr 2021	(5.198)
EUR	39.062.938	USD	46.257.316	30 apr 2021	(424.451)
GBP	39.876.283	USD	54.767.716	30 apr 2021	210.319
SGD	13.607	USD	10.115	30 apr 2021	(2)
USD	259.553	BRL	1.466.134	30 apr 2021	(535)
USD	8.993	CHF	8.403	30 apr 2021	97
USD	527.763	EUR	445.736	30 apr 2021	4.776
USD	1.210.415	GBP	882.424	30 apr 2021	(6.195)
USD	214	SGD	288	30 apr 2021	-
					USD (300.982)
					USD (1.582.751)
Schroder GAIA Cat Bond					
Portefeuilleafdekking					
USD	61.259.961	EUR	50.400.001	16 apr 2021	2.142.431
					USD 2.142.431
Afdekking van aandelencategorieën					
CHF	200.076.096	USD	214.250.734	30 apr 2021	(2.419.710)
EUR	626.604.469	USD	741.999.502	30 apr 2021	(6.799.354)
GBP	10.319	USD	14.172	30 apr 2021	54
JPY	1.245.527	USD	11.471	30 apr 2021	(219)
SEK	2.763.520.222	USD	321.261.707	30 apr 2021	(4.758.100)
SGD	750.713	USD	558.081	30 apr 2021	(86)
USD	1.639.221	CHF	1.536.930	30 apr 2021	11.993
USD	1.757	SGD	2.366	30 apr 2021	(1)
					USD (13.965.423)
					USD (11.822.992)
Schroder GAIA Contour Tech Equity					
Portefeuilleafdekking					
AUD	7.546.940	USD	5.831.440	12 mei 2021	(98.076)
EUR	15.516.478	USD	18.670.518	12 mei 2021	(460.186)
GBP	4.033.060	USD	5.606.992	12 mei 2021	(46.343)
JPY	697.458.475	USD	6.537.264	12 mei 2021	(235.855)
NOK	74.320.144	USD	8.763.896	12 mei 2021	(74.638)
USD	6.284.325	AUD	8.103.426	12 mei 2021	128.204
USD	18.087.906	EUR	15.094.835	12 mei 2021	372.421
USD	5.314.658	GBP	3.815.411	12 mei 2021	54.096
USD	7.653.534	JPY	821.722.910	12 mei 2021	229.418
USD	8.691.040	NOK	74.112.426	12 mei 2021	26.067
					USD (104.892)
Afdekking van aandelencategorieën					
CHF	4.468.758	USD	4.785.017	30 apr 2021	(53.709)
EUR	128.716.351	USD	152.408.382	30 apr 2021	(1.384.434)
GBP	30.009.708	USD	41.216.661	30 apr 2021	158.177
SEK	156.071.368	USD	18.140.275	30 apr 2021	(265.555)
SGD	58.263	USD	43.313	30 apr 2021	(6)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Valutatermijncontracten (vervolg)

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Contour Tech Equity (vervolg)					
USD	89.043	CHF	83.191	30 apr 2021	965
USD	2.595.686	EUR	2.192.263	30 apr 2021	23.486
USD	651.972	GBP	475.343	30 apr 2021	(3.390)
USD	305.331	SEK	2.619.736	30 apr 2021	5.295
USD	693	SGD	935	30 apr 2021	(1)
					USD (1.519.172)
					USD (1.624.064)
Schroder GAIA Egerton Equity					
Portefeuilleafdekking					
CNY	125.022.000	EUR	16.014.705	9 apr 2021	243.180
EUR	18.954.923	BRL	129.761.000	9 apr 2021	(697.080)
EUR	29.173.725	CAD	44.431.000	8 apr 2021	(973.391)
EUR	5.339.094	DKK	39.714.000	8 apr 2021	385
EUR	11.021.353	HKD	103.252.000	8 apr 2021	(303.655)
EUR	3.509.689	IDR	60.577.258.000	9 apr 2021	(45.334)
EUR	9.587.397	INR	852.032.000	9 apr 2021	(342.129)
EUR	3.983.885	JPY	514.714.000	8 apr 2021	20.004
EUR	13.310.953	RUB	1.199.366.000	8 apr 2021	(209.882)
EUR	3.099.353	SEK	31.469.000	8 apr 2021	26.824
EUR	731.565.220	USD	882.685.000	8 apr 2021	(21.082.564)
EUR	2.927.125	ZAR	53.346.000	8 apr 2021	(153.255)
USD	61.013.000	EUR	50.965.780	8 apr 2021	1.058.780
ZAR	53.346.000	EUR	3.009.244	8 apr 2021	71.135
					EUR (22.386.982)
Afdekking van aandelencategorieën					
EUR	65.605	GBP	56.640	30 apr 2021	(951)
EUR	14.062	JPY	1.805.673	30 apr 2021	159
EUR	1.651.535	USD	1.952.316	30 apr 2021	(12.406)
GBP	59.996.756	EUR	69.601.072	30 apr 2021	899.161
JPY	1.805.673	EUR	14.025	30 apr 2021	(123)
USD	429.112.822	EUR	362.430.714	30 apr 2021	3.298.338
					EUR 4.184.178
					EUR (18.202.804)
Schroder GAIA Helix					
Portefeuilleafdekking					
AUD	1.748.000	USD	1.362.317	1 apr 2021	(34.624)
AUD	10.261.000	USD	7.996.736	22 apr 2021	(202.236)
AUD	10.107.000	USD	7.854.069	18 mei 2021	(175.681)
BRL	16.887.895	USD	2.924.058	22 apr 2021	73.208
CAD	6.690.000	USD	5.294.182	22 apr 2021	29.518
CHF	15.016.000	EUR	13.906.622	22 apr 2021	(419.261)
CHF	7.392.000	USD	8.310.879	22 apr 2021	(486.282)
CLP	164.700.000	USD	224.564	27 apr 2021	4.085
COP	969.620.000	USD	271.196	10 mei 2021	(6.551)
CZK	24.460.000	USD	1.125.207	22 apr 2021	(26.169)
DKK	20.391.000	EUR	2.741.340	22 apr 2021	(418)
DKK	18.859.000	USD	3.080.055	22 apr 2021	(106.156)
EUR	1.382.337	CHF	1.531.000	22 apr 2021	1.040
EUR	2.544.519	DKK	18.927.000	22 apr 2021	386

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Valutatermijncontracten (vervolg)

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)	
Schroder GAIA Helix (vervolg)						
EUR	3.052.378	GBP	2.620.000	22 apr 2021	(31.350)	
EUR	2.383.235	NOK	24.361.000	22 apr 2021	(52.423)	
EUR	3.003.740	SEK	30.369.000	22 apr 2021	45.847	
EUR	35.085.106	USD	42.525.502	22 apr 2021	(1.366.716)	
GBP	6.998.000	EUR	8.050.086	22 apr 2021	204.323	
GBP	990.000	USD	1.382.144	8 apr 2021	(17.318)	
GBP	16.888.650	USD	23.528.233	22 apr 2021	(244.236)	
GBP	624.000	USD	866.900	18 mei 2021	(6.537)	
HKD	808.246.000	USD	104.254.097	22 apr 2021	(282.353)	
INR	8.310.000	USD	112.237	19 apr 2021	1.185	
JPY	1.420.214.526	USD	13.405.641	22 apr 2021	(576.768)	
NOK	109.223.000	EUR	10.697.442	22 apr 2021	220.770	
NOK	17.733.000	USD	2.111.882	22 apr 2021	(38.585)	
NZD	369.000	USD	267.931	22 apr 2021	(10.228)	
NZD	1.538.000	USD	1.112.331	18 mei 2021	(38.294)	
RUB	5.610.000	USD	75.410	22 apr 2021	(1.376)	
SEK	203.168.000	EUR	20.191.839	22 apr 2021	(420.363)	
SEK	46.903.000	USD	5.617.930	22 apr 2021	(246.565)	
SGD	9.666.000	USD	7.301.813	22 apr 2021	(116.905)	
SGD	4.151.000	USD	3.136.120	18 mei 2021	(51.024)	
TRY	380.000	USD	49.599	15 apr 2021	(3.926)	
TRY	421.000	USD	57.056	10 mei 2021	(7.384)	
USD	1.361.146	AUD	1.748.000	1 apr 2021	33.453	
USD	4.122.727	AUD	5.295.000	22 apr 2021	100.517	
USD	3.121.475	BRL	16.887.895	22 apr 2021	124.208	
USD	421.980	BRL	2.300.000	2 jun 2021	14.960	
USD	1.989.101	CAD	2.507.000	22 apr 2021	(5.894)	
USD	482.544	CHF	441.000	22 apr 2021	15.735	
USD	10.275	CZK	224.000	22 apr 2021	210	
USD	958.625	DKK	5.947.000	22 apr 2021	20.837	
USD	30.059.787	EUR	24.806.767	22 apr 2021	958.651	
USD	1.378.725	GBP	990.000	8 apr 2021	13.898	
USD	23.542.738	GBP	16.838.074	22 apr 2021	328.470	
USD	25.843.685	HKD	200.569.000	22 apr 2021	42.739	
USD	4.282.770	JPY	464.792.016	22 apr 2021	84.279	
USD	9.655.903	NOK	82.070.029	22 apr 2021	60.483	
USD	6.974	NZD	10.000	22 apr 2021	(10)	
USD	276.760	NZD	378.000	18 mei 2021	12.790	
USD	75.961	RUB	5.610.000	22 apr 2021	1.927	
USD	16.006.988	SEK	132.244.576	22 apr 2021	862.247	
USD	195.200	SGD	262.000	22 apr 2021	451	
USD	45.618	TRY	380.000	15 apr 2021	(55)	
USD	49.703	TRY	421.000	10 mei 2021	31	
					USD	(1.719.440)
Afdekking van aandelencategorieën						
CHF	699.627	USD	749.200	30 apr 2021	(8.468)	
EUR	156.543.387	USD	185.339.502	30 apr 2021	(1.665.863)	
GBP	11.600.426	USD	15.933.052	30 apr 2021	60.629	
JPY	1.327.439	USD	12.225	30 apr 2021	(234)	

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Valutatermijncontracten (vervolg)

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Helix (vervolg)					
SGD	48.970	USD	36.404	30 apr 2021	(6)
USD	94	CHF	88	30 apr 2021	1
USD	43.830	EUR	37.047	30 apr 2021	362
USD	711.376	GBP	517.887	30 apr 2021	(2.643)
USD	94	JPY	10.249	30 apr 2021	2
					USD (1.616.220)
					USD (3.335.660)
Schroder GAIA M&A*					
Portefeuilleafdekking					
BRL	1.178.996	USD	205.111	22 apr 2021	4.138
USD	217.924	BRL	1.178.996	22 apr 2021	8.675
					USD 12.813
Afdekking van aandelencategorieën					
CHF	30.012	USD	32.138	30 apr 2021	(364)
EUR	30.030	USD	35.561	30 apr 2021	(327)
GBP	20.035	USD	27.516	30 apr 2021	106
USD	260	CHF	244	30 apr 2021	3
USD	281	EUR	238	30 apr 2021	3
USD	201	GBP	146	30 apr 2021	(1)
					USD (580)
					USD 12.233
Schroder GAIA Sirios US Equity					
Portefeuilleafdekking					
CAD	7.042.000	USD	5.614.493	16 jun 2021	(10.424)
EUR	4.013.000	USD	4.791.031	16 jun 2021	(87.962)
GBP	1.128.000	USD	1.557.388	16 jun 2021	(2.049)
SEK	3.639.000	USD	428.850	16 jun 2021	(15.191)
USD	34.264.233	EUR	28.721.000	16 jun 2021	530.819
USD	14.031.624	GBP	10.134.000	16 jun 2021	57.759
USD	4.875.266	SEK	41.604.000	16 jun 2021	108.281
					USD 581.233
Afdekking van aandelencategorieën					
CHF	4.044.232	USD	4.330.557	30 apr 2021	(48.715)
EUR	115.351.618	USD	136.581.591	30 apr 2021	(1.238.592)
GBP	9.718.327	USD	13.348.843	30 apr 2021	49.962
USD	66.123	CHF	62.105	30 apr 2021	367
USD	3.456.951	EUR	2.928.129	30 apr 2021	21.351
USD	19.563	GBP	14.263	30 apr 2021	(102)
					USD (1.215.729)
					USD (634.496)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Portefeuilleafdekking					
AUD	7.000.000	USD	5.351.417	16 jun 2021	(32.894)
BRL	2.217.906	USD	398.128	16 apr 2021	(4.356)
CAD	22.804.001	USD	18.120.650	16 jun 2021	26.920
CHF	5.100.992	USD	5.475.214	16 jun 2021	(67.376)
CZK	38.291.821	USD	1.736.302	16 jun 2021	(15.628)
EUR	21.000.000	USD	24.944.323	16 jun 2021	(279.385)
GBP	23.562.210	USD	32.774.763	16 jun 2021	(284.617)

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Valutatermijncontracten (vervolg)

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (vervolg)						
HUF	308.110.000	USD	998.759	16 jun 2021	(2.141)	
ILS	6.982.324	USD	2.101.850	16 jun 2021	(11.172)	
INR	371.869.571	USD	5.105.994	19 apr 2021	(30.395)	
JPY	4.948.542.867	USD	45.496.571	16 jun 2021	(773.667)	
MXN	433.070.136	USD	20.196.957	16 jun 2021	821.131	
NOK	253.580	USD	29.881	16 jun 2021	(235)	
NZD	7.056.231	USD	5.044.537	16 jun 2021	(117.342)	
PLN	37.793.906	USD	9.768.325	16 jun 2021	(201.406)	
RUB	11.273.749	USD	154.806	19 apr 2021	(5.968)	
SEK	6.161.951	USD	721.878	16 jun 2021	(15.842)	
SGD	11.321.297	USD	8.395.416	16 jun 2021	17.777	
TWD	15.347.233	USD	559.000	16 jun 2021	(20.916)	
USD	24.041.129	AUD	31.276.340	16 jun 2021	277.712	
USD	51.627.888	CAD	65.224.426	16 jun 2021	(278.128)	
USD	32.243.866	CHF	29.955.463	16 jun 2021	486.455	
USD	5.435.209	CNH	35.741.730	16 jun 2021	20.772	
USD	273.414	CZK	6.097.861	16 jun 2021	(598)	
USD	82.179.175	EUR	69.000.000	16 jun 2021	1.137.234	
USD	55.163.776	GBP	39.757.469	16 jun 2021	341.842	
USD	6.561.835	HUF	2.026.649.747	16 jun 2021	6.397	
USD	574.059	ILS	1.908.000	16 jun 2021	2.757	
USD	46.032.156	JPY	5.012.864.421	16 jun 2021	727.939	
USD	7.239.191	KRW	8.124.326.699	16 jun 2021	61.019	
USD	1.962.539	MXN	42.249.325	16 jun 2021	(87.938)	
USD	6.721.330	NOK	57.154.672	16 jun 2021	39.300	
USD	1.528.280	NZD	2.182.740	16 jun 2021	4.125	
USD	9.884.558	PLN	38.447.326	16 jun 2021	152.236	
USD	5.857.179	SEK	50.049.303	16 jun 2021	122.532	
USD	121.067	TWD	3.409.000	19 apr 2021	1.582	
USD	1.259.050	TWD	34.636.452	16 jun 2021	44.673	
USD	511.608	ZAR	7.959.511	17 jun 2021	(22.357)	
ZAR	27.635.984	USD	1.778.260	17 jun 2021	75.703	
					USD	2.115.745
Afdekking van aandelencategorieën						
CHF	8.391.970	USD	8.986.563	30 apr 2021	(101.546)	
EUR	216.976.026	USD	256.937.188	30 apr 2021	(2.357.441)	
GBP	210.986.139	USD	289.775.384	30 apr 2021	1.114.398	
USD	29.892	CHF	27.934	30 apr 2021	318	
USD	434.530	EUR	367.585	30 apr 2021	3.240	
USD	279.796	GBP	204.425	30 apr 2021	(2.049)	
					USD	(1.343.080)
					USD	772.665
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund						
Afdekking van aandelencategorieën						
CHF	144.821	GBP	112.950	30 apr 2021	(1.738)	
EUR	17.975.794	GBP	15.498.554	30 apr 2021	(200.879)	
USD	4.237.151	GBP	3.086.128	30 apr 2021	(12.869)	
					GBP	(215.486)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Valutatermijncontracten (vervolg)

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Portefeuilleafdekking					
AUD	1.373.736	EUR	888.000	6 apr 2021	2.049
AUD	1.384.851	GBP	766.000	6 apr 2021	(4.140)
AUD	51.300.000	USD	39.295.716	7 apr 2021	(330.300)
AUD	10.553.000	USD	8.035.636	6 mei 2021	(18.759)
AUD	940.000	USD	724.056	16 jun 2021	(9.855)
BRL	46.665.000	USD	8.292.167	5 apr 2021	(1.547)
BRL	8.070.000	USD	1.487.421	28 apr 2021	(55.656)
BRL	13.613.000	USD	2.380.852	4 mei 2021	33.497
BRL	18.177.000	USD	3.203.772	2 jun 2021	12.923
BRL	8.663.000	USD	1.474.051	11 jun 2021	57.823
BRL	9.132.000	USD	1.647.691	13 jul 2021	(37.713)
BRL	4.217.000	USD	730.596	12 aug 2021	10.437
BRL	5.871.000	USD	1.029.639	17 sep 2021	(1.984)
CAD	36.617.000	USD	28.969.646	7 apr 2021	168.011
CAD	300.000	USD	236.034	19 apr 2021	2.696
CAD	250.000	USD	195.442	27 apr 2021	3.502
CAD	12.317.000	USD	9.799.890	6 mei 2021	1.801
CAD	2.000.000	USD	1.587.858	16 jun 2021	3.756
CHF	6.406.000	USD	6.914.024	7 apr 2021	(135.897)
CHF	832.000	USD	886.841	30 apr 2021	(5.959)
CHF	140.000	USD	148.667	6 mei 2021	(418)
CHF	768.000	USD	823.954	16 jun 2021	(9.755)
CLP	11.328.200.000	USD	15.513.477	7 apr 2021	211.009
CLP	1.981.058.000	USD	2.702.483	6 mei 2021	47.912
CLP	2.687.500.000	USD	3.739.195	16 jun 2021	(7.121)
CLP	753.267.000	USD	1.028.491	21 jul 2021	17.729
CNH	240.503.710	USD	37.065.573	7 apr 2021	(437.003)
CNH	36.031.000	USD	5.466.373	6 mei 2021	9.042
CNH	37.222.000	USD	5.677.435	16 jun 2021	(38.755)
COP	46.954.097.000	USD	12.977.954	7 apr 2021	(155.271)
COP	4.736.900.000	USD	1.271.317	6 mei 2021	21.741
COP	5.927.084.000	USD	1.647.582	16 jun 2021	(32.172)
CZK	69.320.000	USD	3.142.346	7 apr 2021	(27.720)
CZK	115.961.000	USD	5.263.714	16 jun 2021	(52.912)
EGP	5.356.000	USD	333.396	13 apr 2021	6.496
EGP	2.490.000	USD	154.419	16 jun 2021	575
EUR	888.000	AUD	1.368.941	6 apr 2021	1.593
EUR	888.000	MXN	22.232.856	6 apr 2021	(46.239)
EUR	2.177.000	USD	2.557.540	6 apr 2021	(4.518)
EUR	41.143.000	USD	49.616.983	7 apr 2021	(1.366.606)
EUR	3.068.000	USD	3.620.484	30 apr 2021	(20.775)
EUR	30.554.000	USD	35.902.170	6 mei 2021	(48.410)
EUR	4.424.000	USD	5.252.761	16 jun 2021	(56.681)
EUR	883.000	ZAR	15.942.388	6 apr 2021	(44.428)
GBP	766.000	AUD	1.372.289	6 apr 2021	13.682
GBP	14.688.000	USD	20.361.656	7 apr 2021	(112.652)
GBP	931.000	USD	1.276.935	6 mei 2021	6.676

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Valutatermijncontracten (vervolg)

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
GBP	4.929.000	USD	6.837.075	16 jun 2021	(40.432)
HKD	2.174.000	USD	280.230	7 apr 2021	(582)
HKD	4.630.000	USD	596.447	16 jun 2021	(775)
HUF	1.497.944.400	USD	4.854.000	6 apr 2021	(3.466)
HUF	4.455.420.601	USD	14.715.967	7 apr 2021	(288.899)
HUF	1.222.107.000	USD	3.951.126	6 mei 2021	4.578
HUF	829.232.000	USD	2.687.916	16 jun 2021	(5.667)
IDR	68.957.000.000	USD	4.750.554	7 apr 2021	(3.784)
IDR	29.665.000.000	USD	2.030.289	16 jun 2021	767
ILS	30.917.000	USD	9.298.090	7 apr 2021	(50.039)
ILS	1.003.000	USD	302.509	16 jun 2021	(2.186)
INR	2.206.737.000	USD	30.069.262	7 apr 2021	102.370
INR	778.647.000	USD	10.569.749	6 mei 2021	35.775
INR	260.820.000	USD	3.530.932	16 jun 2021	1.720
JPY	2.020.875.000	USD	18.612.932	7 apr 2021	(361.235)
JPY	461.151.000	USD	4.182.429	6 mei 2021	(16.210)
JPY	196.100.000	USD	1.802.187	16 jun 2021	(29.915)
KRW	17.083.170.000	USD	15.096.380	7 apr 2021	(2.211)
KRW	6.522.340.000	USD	5.771.347	16 jun 2021	(8.597)
KZT	145.100.000	USD	338.347	4 mei 2021	(163)
KZT	211.350.000	USD	494.386	16 jun 2021	(6.929)
MXN	21.321.127	EUR	888.000	6 apr 2021	1.638
MXN	20.306.364	USD	969.000	5 apr 2021	24.486
MXN	636.040.000	USD	30.374.894	7 apr 2021	736.369
MXN	94.259.000	USD	4.577.815	6 mei 2021	18.277
MXN	12.553.000	USD	612.880	10 mei 2021	(1.080)
MXN	128.344.000	USD	6.164.905	16 jun 2021	63.984
NOK	8.126.844	USD	968.000	6 apr 2021	(17.841)
NOK	128.059.000	USD	15.013.049	7 apr 2021	(40.868)
NOK	33.624.217	USD	3.927.194	6 mei 2021	4.077
NZD	24.649.000	USD	17.649.224	7 apr 2021	(434.357)
NZD	6.450.000	USD	4.502.895	6 mei 2021	1.516
NZD	560.000	USD	402.268	16 jun 2021	(11.233)
PEN	10.965.000	USD	2.940.228	7 apr 2021	(11.150)
PEN	14.200.000	USD	3.834.276	16 jun 2021	(42.309)
PHP	212.290.000	USD	4.374.567	7 apr 2021	(1.093)
PHP	101.190.000	USD	2.084.672	6 mei 2021	(1.839)
PHP	58.570.000	USD	1.195.127	16 jun 2021	8.989
PLN	27.890.000	USD	7.426.382	7 apr 2021	(368.953)
PLN	5.440.000	USD	1.374.953	6 mei 2021	1.791
PLN	5.140.000	USD	1.310.868	16 jun 2021	(9.759)
PLN	1.247.000	USD	332.303	19 jul 2021	(16.577)
RON	2.645.000	USD	640.812	16 jun 2021	(12.714)
RUB	1.797.933.000	USD	24.002.138	7 apr 2021	(228.762)
RUB	176.180.000	USD	2.298.964	6 mei 2021	21.667
RUB	225.516.000	USD	3.000.053	16 jun 2021	(44.767)
SEK	130.379.000	USD	15.104.964	7 apr 2021	(175.977)
SEK	8.333.000	USD	955.099	6 mei 2021	(674)
SGD	36.789.000	USD	27.604.603	7 apr 2021	(256.540)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Valutatermijncontracten (vervolg)

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
SGD	10.850.000	USD	8.056.922	16 jun 2021	6.037
THB	505.630.000	USD	16.502.912	7 apr 2021	(322.938)
THB	66.060.000	USD	2.132.419	16 jun 2021	(19.073)
TRY	244.367.000	USD	31.293.303	7 apr 2021	(1.743.296)
TRY	1.915.000	USD	225.931	6 mei 2021	562
TRY	3.234.000	USD	440.810	11 mrt 2021	(59.477)
TRY	34.570.000	USD	4.226.306	16 jun 2021	(241.794)
TWD	439.535.000	USD	15.568.578	7 apr 2021	(163.941)
TWD	17.205.000	USD	606.002	6 mei 2021	(2.918)
TWD	88.435.000	USD	3.155.414	16 jun 2021	(54.825)
USD	39.696.087	AUD	51.300.000	7 apr 2021	730.667
USD	701.243	AUD	925.000	30 apr 2021	(1.438)
USD	21.147.330	AUD	27.828.000	6 mei 2021	7.024
USD	2.759.507	AUD	3.575.000	16 jun 2021	43.262
USD	8.376.426	BRL	46.665.000	5 apr 2021	85.804
USD	776.587	BRL	4.491.000	28 apr 2021	(20.198)
USD	779.179	BRL	4.420.000	4 mei 2021	(4.734)
USD	4.748.553	BRL	26.550.000	2 jun 2021	50.130
USD	1.140.857	BRL	6.520.000	13 jul 2021	(8.624)
USD	29.865.887	CAD	37.567.000	7 apr 2021	(27.722)
USD	160.409	CAD	200.000	8 apr 2021	1.260
USD	159.882	CAD	200.000	12 apr 2021	731
USD	272.504	CAD	345.000	14 apr 2021	(2.033)
USD	360.882	CAD	450.000	16 apr 2021	2.789
USD	586.200	CAD	800.000	19 apr 2021	(50.414)
USD	160.242	CAD	200.000	20 apr 2021	1.088
USD	197.816	CAD	250.000	21 apr 2021	(1.126)
USD	373.582	CAD	500.000	27 apr 2021	(24.306)
USD	163.381	CAD	205.000	28 apr 2021	247
USD	27.830	CAD	35.000	5 mei 2021	(22)
USD	1.252.258	CAD	1.575.000	6 mei 2021	(1.104)
USD	196.820	CAD	250.000	10 mei 2021	(2.127)
USD	790.420	CAD	990.000	14 mei 2021	2.591
USD	151.688	CAD	200.000	27 mei 2021	(7.470)
USD	638.674	CAD	850.000	1 jun 2021	(37.744)
USD	520.839	CAD	700.000	4 jun 2021	(36.213)
USD	74.329	CAD	100.000	7 jun 2021	(5.250)
USD	5.243.157	CAD	6.625.000	16 jun 2021	(29.060)
USD	197.302	CAD	250.000	17 jun 2021	(1.650)
USD	927.071	CAD	1.250.000	30 jun 2021	(67.714)
USD	697.983	CAD	900.000	1 dec 2021	(18.386)
USD	750.689	CAD	960.000	2 dec 2021	(13.439)
USD	157.845	CAD	200.000	6 dec 2021	(1.350)
USD	273.069	CAD	346.000	7 mrt 2022	(2.341)
USD	7.004.048	CHF	6.406.000	7 apr 2021	225.923
USD	642.863	CHF	602.000	30 apr 2021	5.494
USD	1.479.667	CHF	1.391.000	6 mei 2021	6.701
USD	216.739	CHF	200.000	17 jun 2021	4.702
USD	15.734.078	CLP	11.328.200.000	7 apr 2021	9.593

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Valutatermijncontracten (vervolg)

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
USD	5.351.328	CLP	3.890.696.000	16 jun 2021	(51.600)
USD	36.003.758	CNH	235.454.000	7 apr 2021	144.253
USD	14.320.645	CNH	94.316.000	6 mei 2021	(11.994)
USD	438.836	CNH	2.834.000	20 mei 2021	8.632
USD	2.574.469	CNH	16.916.000	16 jun 2021	11.901
USD	107.087	CNY	704.000	7 apr 2021	(296)
USD	12.959.254	COP	46.954.097.000	7 apr 2021	136.572
USD	1.360.083	COP	5.025.507.000	6 mei 2021	(11.757)
USD	2.371.950	COP	8.549.027.000	16 jun 2021	41.936
USD	3.196.134	CZK	69.320.000	7 apr 2021	81.508
USD	2.259.897	CZK	50.280.000	6 mei 2021	672
USD	2.819.870	CZK	62.530.000	16 jun 2021	10.035
USD	1.694.023	DKK	10.585.000	16 jun 2021	23.181
USD	2.651.062	EUR	2.177.000	6 apr 2021	98.040
USD	48.631.112	EUR	41.143.000	7 apr 2021	380.734
USD	33.129.411	EUR	28.040.000	30 apr 2021	229.850
USD	17.278.136	EUR	14.726.000	6 mei 2021	(2.170)
USD	15.316.836	EUR	12.851.000	16 jun 2021	223.068
USD	20.424.924	GBP	14.688.000	7 apr 2021	175.919
USD	6.693.621	GBP	4.858.000	30 apr 2021	(4.179)
USD	8.450.077	GBP	6.135.000	6 mei 2021	(8.516)
USD	523.914	GBP	379.000	16 jun 2021	1.308
USD	280.254	HKD	2.174.000	7 apr 2021	607
USD	20.969	HKD	163.000	6 mei 2021	-
USD	183.701	HKD	1.426.000	16 jun 2021	239
USD	4.854.000	HUF	1.468.407.750	6 apr 2021	99.109
USD	14.661.851	HUF	4.455.545.918	7 apr 2021	234.379
USD	873.155	HUF	269.699.733	6 mei 2021	193
USD	4.120.969	HUF	1.272.600.000	16 jun 2021	4.594
USD	4.774.824	IDR	68.957.000.000	7 apr 2021	28.055
USD	2.504.374	IDR	36.644.000.000	6 mei 2021	(12.687)
USD	483.560	IDR	7.056.000.000	16 jun 2021	461
USD	9.377.044	ILS	30.917.000	7 apr 2021	128.994
USD	7.636.186	ILS	25.422.000	6 mei 2021	29.862
USD	2.135.612	ILS	7.088.000	16 jun 2021	13.290
USD	29.938.235	INR	2.206.737.000	7 apr 2021	(233.397)
USD	2.987.896	INR	220.940.000	6 mei 2021	(21.406)
USD	3.027.399	INR	223.539.000	16 jun 2021	(304)
USD	18.479.841	JPY	1.992.575.000	7 apr 2021	483.738
USD	2.014.399	JPY	215.250.000	12 apr 2021	70.245
USD	1.328.625	JPY	137.750.000	19 apr 2021	84.362
USD	268.739	JPY	27.800.000	26 apr 2021	17.609
USD	1.623.591	JPY	177.200.000	30 apr 2021	22.796
USD	3.931.264	JPY	432.631.000	6 mei 2021	22.705
USD	1.635.995	JPY	170.800.000	10 mei 2021	92.872
USD	1.511.001	JPY	159.300.000	17 mei 2021	71.698
USD	606.428	JPY	63.500.000	24 mei 2021	32.663
USD	2.038.410	JPY	215.200.000	1 jun 2021	93.813
USD	2.120.998	JPY	224.900.000	7 jun 2021	88.637

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Valutatermijncontracten (vervolg)

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
USD	1.504.729	JPY	162.400.000	14 jun 2021	37.056
USD	1.373.616	JPY	146.501.000	16 jun 2021	49.600
USD	2.161.000	JPY	234.700.000	21 jun 2021	39.765
USD	1.816.874	JPY	197.850.000	28 jun 2021	28.559
USD	78.327	JPY	8.550.000	6 jul 2021	1.039
USD	15.073.848	KRW	17.083.170.000	7 apr 2021	(20.321)
USD	9.500.776	KRW	10.778.630.000	6 mei 2021	(21.431)
USD	4.275.148	KRW	4.802.671.000	16 jun 2021	31.792
USD	171.108	KZT	72.550.000	4 mei 2021	2.016
USD	969.000	MXN	19.987.162	5 apr 2021	(8.869)
USD	30.739.263	MXN	636.040.000	7 apr 2021	(372.000)
USD	3.554.813	MXN	73.500.000	6 mei 2021	(29.064)
USD	6.706.825	MXN	141.761.000	16 jun 2021	(173.227)
USD	968.000	NOK	8.285.393	6 apr 2021	(696)
USD	15.103.352	NOK	129.339.000	7 apr 2021	(18.485)
USD	4.343.778	NOK	37.188.000	6 mei 2021	(4.162)
USD	7.593.810	NZD	10.502.000	7 apr 2021	259.211
USD	2.008.965	NZD	2.795.000	16 jun 2021	57.284
USD	2.992.641	PEN	10.965.000	7 apr 2021	63.564
USD	1.221.536	PEN	4.600.000	6 mei 2021	(7.248)
USD	3.274.261	PEN	12.134.000	16 jun 2021	33.999
USD	4.341.598	PHP	212.290.000	7 apr 2021	(31.877)
USD	2.078.385	PHP	101.155.000	6 mei 2021	(3.728)
USD	3.546.061	PHP	173.630.000	16 jun 2021	(23.524)
USD	7.225.372	PLN	27.890.000	7 apr 2021	167.944
USD	394.253	PLN	1.565.000	6 mei 2021	(1.814)
USD	4.945.207	PLN	19.030.000	16 jun 2021	128.069
USD	1.468.955	RON	6.065.000	16 jun 2021	28.721
USD	24.082.416	RUB	1.797.933.000	7 apr 2021	309.040
USD	7.260.635	RUB	552.803.000	6 mei 2021	(20.848)
USD	6.256.256	RUB	471.093.000	16 jun 2021	82.791
USD	15.499.507	SEK	130.379.000	7 apr 2021	570.519
USD	10.462.080	SEK	91.330.000	6 mei 2021	1.555
USD	901.000	SEK	7.694.000	16 jun 2021	19.422
USD	27.501.400	SGD	36.789.000	7 apr 2021	153.335
USD	5.790.846	SGD	7.806.000	6 mei 2021	(11.073)
USD	3.607.309	SGD	4.855.000	16 jun 2021	(587)
USD	17.506.548	THB	534.536.020	7 apr 2021	401.591
USD	5.974.137	THB	186.871.000	6 mei 2021	(4.947)
USD	3.195.527	THB	98.640.000	16 jun 2021	39.905
USD	31.694.951	TRY	244.367.000	7 apr 2021	2.144.944
USD	5.208.322	TRY	45.046.000	6 mei 2021	(119.401)
USD	314.502	TRY	2.327.000	11 mrt 2021	40.117
USD	6.370.327	TRY	53.003.000	16 jun 2021	261.242
USD	15.628.685	TWD	439.535.000	7 apr 2021	224.048
USD	10.084.482	TWD	286.843.000	6 mei 2021	29.817
USD	1.620.642	TWD	45.605.000	16 jun 2021	21.700
USD	25.251.739	ZAR	376.893.000	7 apr 2021	(275.284)
USD	13.016.492	ZAR	195.403.000	6 mei 2021	(166.237)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Valutatermijncontracten (vervolg)

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
USD	6.779.967	ZAR	104.649.000	17 jun 2021	(240.422)
ZAR	15.293.560	EUR	780	6 apr 2021	476
ZAR	376.893.000	USD	25.067.162	7 apr 2021	459.861
ZAR	51.320.000	USD	3.439.123	6 mei 2021	23.146
ZAR	24.160.000	USD	1.602.047	17 jun 2021	18.729
ZAR	9.198.000	USD	600.627	8 jul 2021	14.812
					USD 1.332.651
Afdekking van aandelencategorieën					
BRL	80.553.869	USD	14.585.615	30 apr 2021	(295.562)
CHF	9.024.789	USD	9.664.243	30 apr 2021	(109.227)
EUR	113.404.668	USD	134.290.858	30 apr 2021	(1.232.233)
GBP	43.077.200	USD	59.163.871	30 apr 2021	227.314
SGD	2.557.696	USD	1.901.394	30 apr 2021	(293)
USD	541.358	BRL	3.091.832	30 apr 2021	(7.125)
USD	16.557	CHF	15.469	30 apr 2021	179
USD	520.127	EUR	439.616	30 apr 2021	4.322
USD	79.150	GBP	57.707	30 apr 2021	(411)
USD	8.260	SGD	11.121	30 apr 2021	(6)
					USD (1.413.042)
					USD (80.391)

De valutatermijncontracten werden gesloten met de volgende tegenpartijen:

Tegenpartijen bij de valutatermijncontracten

Compartiment	Tegenpartij	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA BlueTrend	HSBC	(300.982)
	UBS	(1.281.769)
		USD (1.582.751)
Schroder GAIA Cat Bond	Brown Brothers Harriman & Co	2.142.430
	HSBC	(13.965.422)
		USD (11.822.992)
Schroder GAIA Contour Tech Equity	HSBC	(1.519.172)
	Morgan Stanley	(104.892)
		USD (1.624.064)
Schroder GAIA Egerton Equity	Brown Brothers Harriman & Co	(21.335.736)
	HSBC	3.132.932
		EUR (18.202.804)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Tegenpartijen bij de valutatermijncontracten (vervolg)

Compartiment	Tegenpartij	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Helix	Australia and New Zealand Bank	(144.288)
	Goldman Sachs	113.157
	HSBC	(1.616.220)
	J.P. Morgan	(1.398.721)
	Morgan Stanley	(274.148)
	State Street	(11.514)
	UBS	(3.926)
	USD	(3.335.660)
Schroder GAIA M&A*	HSBC	(580)
	J.P. Morgan	12.813
	USD	12.233
Schroder GAIA Sirios US Equity	HSBC	(1.215.729)
	Morgan Stanley	581.233
	USD	(634.496)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	596.265
	Deutsche Bank	933.810
	HSBC	(1.343.080)
	Morgan Stanley	84.776
	Newedge Group	500.894
	USD	772.665
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	HSBC	(215.486)
	GBP	(215.486)
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Bank of America	97.410
	Barclays Bank	(841.720)
	BNP Paribas	(337.596)
	Citi Bank	(3.819)
	Credit Suisse	(2.711)
	Deutsche Bank	(202.393)
	Goldman Sachs	1.069.581
	HSBC	(1.413.042)
	J.P. Morgan	435.233
	Morgan Stanley	810.673
	Standard Chartered Bank	307.993
USD	(80.391)	

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Spottransacties

Uitstaande spottransacties zijn gewaardeerd tegen de laatste beschikbare prijs op de Berekeningsdag van de IW, op basis van de contante wisselkoers die van toepassing is op de looptijd van het betreffende contract. De niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering) wordt in het Overzicht van het nettovermogen weergegeven onder 'Netto niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering) op spottransacties'.

Op 31 maart 2021 bestonden er voor het volgende subfonds spottransacties:

Gekochte valuta	Gekocht bedrag	Verkochte valuta	Verkocht bedrag	Vereffeningdatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified						
Portefeuilleafdekking						
AUD	1.000.000	JPY	84.168.278	1 apr 2021	(609)	
AUD	1.000.000	JPY	84.228.000	6 apr 2021	(1.145)	
AUD	1.000.000	NZD	1.088.460	6 apr 2021	(630)	
CAD	1.736.510	GBP	1.000.000	6 apr 2021	3.202	
CAD	1.000.000	JPY	87.634.143	1 apr 2021	4.278	
CAD	3.000.000	JPY	263.354.000	5 apr 2021	8.754	
CAD	1.260.460	USD	1.000.000	1 apr 2021	2.992	
EUR	4.000.000	JPY	519.086.000	6 apr 2021	2.735	
GBP	1.356.000	USD	1.863.239	1 apr 2021	6.143	
JPY	171.802.421	USD	1.549.499	1 apr 2021	2.114	
SGD	389.517	USD	289.000	1 apr 2021	561	
USD	760.125	AUD	1.000.000	1 apr 2021	576	
USD	2.000.000	JPY	221.293.000	2 apr 2021	1.417	
USD	2.049.358	THB	64.024.000	1 apr 2021	590	
USD	2.044.973	THB	64.024.000	2 apr 2021	(3.795)	
					USD	27.183

Tegenpartijen bij spottransacties

Compartiment	Tegenpartij	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
	Citi Bank	6.652
	Deutsche Bank	12.057
	Morgan Stanley	6.704
	Newedge Group	1.770
		USD
		27.183

Futurescontracten

Futurescontracten zijn gewaardeerd tegen de laatste beschikbare koers op de Berekeningsdag van de IW. De niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering) wordt weergegeven in het Overzicht van het nettovermogen onder 'Netto niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering) van futurescontracten'. Op 31 maart 2021 hadden de volgende subfondsen openstaande futurescontracten op vastrentende effecten en valuta's:

Vervaldatum	Hoeveelheid	Contract	Tegenpartij	Valuta	(Short-)/Longpositie	Marktprijs	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA BlueTrend							
Dec 21	24	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(7.074.914)	100,55	366
Mrt 22	21	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(6.189.950)	100,54	337
Jun 22	18	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(5.305.632)	100,53	513
Sep 23	57	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(16.779.343)	100,42	(982)
Sep 21	75	3 Months Euroswiss ICE Future	Morgan Stanley	CHF	(19.978.945)	100,73	(3.994)
Jun 21	45	90 Days Bank Bill Future	Credit Suisse	AUD	(34.174.487)	10,00	(1.048)
Sep 21	53	90 Days Bank Bill Future	Credit Suisse	AUD	(40.246.693)	10,00	(1.517)
Dec 21	35	90 Days Bank Bill Future	Credit Suisse	AUD	(26.575.655)	10,00	(730)
Mrt 22	7	90 Days Bank Bill Future	Credit Suisse	AUD	5.315.577	10,00	(692)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Futurescontracten (vervolg)

Vervaldatum	Hoeveelheid	Contract	Tegenpartij	Valuta	(Short-)/ Long- positie	Marktprijs	Niet-gerealiseerde waardevermeerde- ring/(-vermindering)
Schroder GAIA BlueTrend (vervolg)							
Dec 21	24	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(5.985.925)	99,74	1.825
Mrt 22	20	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(4.987.938)	99,77	(313)
Jun 22	16	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(3.991.788)	99,71	3.388
Sep 23	8	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(1.982.138)	98,97	2.738
Dec 23	4	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	988.588	98,80	(638)
Mrt 24	7	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	1.726.813	98,62	(963)
Jun 24	6	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	1.477.350	98,45	(675)
Sep 24	5	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	1.228.975	98,28	(475)
Dec 24	5	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	1.227.175	98,13	(550)
Mrt 25	6	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(1.472.850)	98,00	2.850
Dec 21	19	90 Days Sterling Future	Morgan Stanley	GBP	3.271.263	99,87	(1.344)
Mrt 22	15	90 Days Sterling Future	Morgan Stanley	GBP	2.580.438	99,80	(862)
Jun 22	14	90 Days Sterling Future	Morgan Stanley	GBP	2.407.423	99,76	(784)
Sep 23	114	90 Days Sterling Future	Morgan Stanley	GBP	(19.538.932)	99,39	13.717
Apr 21	5	Amsterdam Index Future	Credit Suisse	EUR	(801.716)	699,14	(18.165)
Jun 21	8	Australian 10 Year Bond Future	Credit Suisse	AUD	843.610	138,11	(4.372)
Jun 21	152	Australian 3 Year Bond Future	Credit Suisse	AUD	13.505.271	117,04	7.576
Sep 21	199	Bankers' Acceptance Future	Credit Suisse	CAD	(39.391.303)	99,53	(8.465)
Dec 21	15	Bankers' Acceptance Future	Credit Suisse	CAD	2.969.295	99,49	(656)
Mrt 22	13	Bankers' Acceptance Future	Credit Suisse	CAD	2.572.869	99,47	(567)
Jun 22	10	Bankers' Acceptance Future	Credit Suisse	CAD	1.977.292	99,36	(686)
Apr 21	402	BIST 30 Index Futures	Morgan Stanley	TRY	777.193	1.442,25	(75.041)
Apr 21	80	Bovespa Index Future	Credit Suisse	BRL	1.684.076	116.549,00	(27.565)
Apr 21	63	CAC 40 Index Future	Credit Suisse	EUR	4.437.543	6.066,00	44.024
Jun 21	39	Canada 10 Year Bond Future	Credit Suisse	CAD	(4.318.381)	138,77	11.841
Apr 21	4	CBOE VIX Future	Credit Suisse	USD	(106.170)	20,73	23.234
Mei 21	3	CBOE VIX Future	Credit Suisse	USD	(80.540)	22,68	12.513
Jun 21	7	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Credit Suisse	USD	1.142.945	32.898,00	8.485
Jun 21	6	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	1.179.100	3.967,50	11.150
Jun 21	3	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Credit Suisse	EUR	(728.106)	206,04	3.237
Jun 21	64	Euro Stoxx 50 Future	Credit Suisse	EUR	2.838.831	3.866,00	62.710
Jun 21	24	Euro-BOBL Future	Credit Suisse	EUR	(3.799.466)	135,08	(2.334)
Jun 21	27	Euro-BTP Future	Credit Suisse	EUR	4.708.578	149,31	19.009
Jun 21	24	Euro-Bund Future	Credit Suisse	EUR	(4.823.960)	171,28	3.319
Jun 21	75	Euro-OAT Future	Credit Suisse	EUR	(14.255.587)	161,95	11.680
Jun 21	34	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	3.145.607	6.679,50	(14.765)
Apr 21	86	FTSE China A50 Future	Credit Suisse	USD	1.475.753	17.182,00	1.899
Jun 21	12	FTSE MIB Index Future	Credit Suisse	EUR	1.687.984	24.394,00	28.426
Jun 21	31	FTSE/JSE Top 40 Future	Credit Suisse	ZAR	1.296.787	61.180,00	(11.841)
Apr 21	15	Hang Seng Index Future	Credit Suisse	HKD	2.723.833	28.316,00	7.930
Apr 21	11	HSCEI Index Future	Credit Suisse	HKD	769.935	10.943,00	4.258
Apr 21	17	IBEX 35 Index Future	Morgan Stanley	EUR	1.717.302	8.586,70	(5.466)
Jun 21	20	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Credit Suisse	JPY	(27.272.748)	151,16	(30.932)
Jun 21	20	KOSPI2 Index Future	Credit Suisse	KRW	1.825.160	414,65	6.737
Jun 21	7	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(1.240.933)	127,59	9.664
Jun 21	35	MSCI EAFE Index Future	Credit Suisse	USD	3.857.500	2.192,00	(21.500)
Jun 21	22	MSCI Emerging Market Index Future	Credit Suisse	USD	1.465.690	1.322,50	(10.940)
Apr 21	72	MSCI Singapore Index ETS Future	Credit Suisse	SGD	1.909.197	357,95	6.682
Jun 21	2	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	519.636	13.089,75	3.954
Jun 21	3	Nikkei 225 (OSE) Future	Credit Suisse	JPY	792.260	29.180,00	(1.653)
Jun 21	8	Nikkei 225 (SGX) Future	Credit Suisse	JPY	1.059.901	29.220,00	(4.312)
Apr 21	32	OMXS30 Index Future	Credit Suisse	SEK	(787.730)	2.187,25	(13.694)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Futurescontracten (vervolg)

Vervaldatum	Hoeveelheid	Contract	Tegenpartij	Valuta	(Short-)/ Longpositie	Marktprijs	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/ (-vermindering)	
Schroder GAIA BlueTrend (vervolg)								
Jun 21	3	Russell 2000 E-mini Future	Credit Suisse	USD	352.365	2.222,50	(18.990)	
Jun 21	2	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	528.070	2.605,30	(7.010)	
Jun 21	27	S&P/TSX 60 Index Future	Credit Suisse	CAD	4.782.828	1.111,10	(8.467)	
Jun 21	401	SET 50 Index Future	Credit Suisse	THB	2.469.654	965,10	7.178	
Apr 21	42	SGX Nifty 50 Future	Credit Suisse	USD	1.249.466	14.746,00	(10.802)	
Jun 21	85	Short-Term Euro-BTP Future	Credit Suisse	EUR	11.271.242	113,16	8.490	
Jun 21	167	South Korea 10 Year Bond Future	Credit Suisse	KRW	(18.620.384)	126,10	13.183	
Jun 21	73	South Korea 3 Year Bond Future	Credit Suisse	KRW	(7.139.041)	110,79	(7.122)	
Jun 21	46	SPI 200 Future	Credit Suisse	AUD	5.901.950	6.766,00	8.032	
Jun 21	46	Swiss Market Index Future	Credit Suisse	CHF	5.229.054	10.928,00	89.552	
Jun 21	14	Topix Index Future	Credit Suisse	JPY	2.412.433	1.954,00	58.192	
Jun 21	22	WIG20 Index Future	Credit Suisse	PLN	215.982	1.941,00	127	
							USD	177.904
Schroder GAIA Helix								
Jun 21	6	Dax Index Future	Goldman Sachs	EUR	(2.549.127)	15.029,00	(94.549)	
Jun 21	20	E-mini S&P 500 Future	J.P. Morgan	USD	(4.080.533)	3.967,50	113.033	
Jun 21	89	Euro Stoxx 50 Future	Goldman Sachs	EUR	(3.934.303)	3.866,00	(100.653)	
Jun 21	552	Euro Stoxx Future	J.P. Morgan	EUR	(13.563.571)	426,50	(240.749)	
Jun 21	139	FTSE 100 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(12.811.771)	6.679,50	12.153	
Jun 21	233	FTSE 250 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(13.827.981)	21.431,50	59.794	
Jun 21	25	MSCI AC AXJ NTR Future	J.P. Morgan	USD	(1.667.550)	653,98	32.600	
Jun 21	48	MSCI Asia Future	J.P. Morgan	USD	(3.258.240)	668,10	51.360	
Jun 21	158	MSCI China Future	J.P. Morgan	USD	(9.632.312)	1.189,60	234.472	
Jun 21	22	MSCI EAFE Index Future	J.P. Morgan	USD	(2.432.320)	2.192,00	21.120	
Jun 21	64	MSCI Emerging Market Index Future	J.P. Morgan	USD	(4.294.705)	1.322,50	62.705	
Jun 21	230	MSCI Europe Future	J.P. Morgan	EUR	(6.784.157)	255,45	(105.866)	
Jun 21	107	MSCI Poland Future	Goldman Sachs	USD	(1.819.000)	170,90	(9.630)	
Jun 21	103	MSCI Saudi Arabia Future	Goldman Sachs	USD	(1.407.495)	1.422,25	(57.423)	
Jun 21	30	MSCI World Index Future	J.P. Morgan	USD	2.540.663	8.415,00	(16.163)	
Jun 21	3	Nikkei 225 (OSE) Future	J.P. Morgan	JPY	(787.085)	29.180,00	(3.522)	
Jun 21	5	Russell 2000 E-mini Future	J.P. Morgan	USD	(588.900)	2.222,50	33.275	
Jun 21	350	Stoxx Europe 600 Future	J.P. Morgan	EUR	(8.604.886)	425,30	(123.227)	
Jun 21	150	Topix Index Future	J.P. Morgan	JPY	(26.324.656)	1.954,00	(146.331)	
							USD	(277.601)
Schroder GAIA M&A*								
Jun 21	1	E-mini S&P 500 Future	Goldman Sachs	USD	(197.905)	3.967,50	(470)	
							USD	(470)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified								
Jun 22	1.031	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(257.096.238)	99,71	93.713	
Dec 22	8	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(1.990.900)	99,50	900	
Jun 23	11	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	2.731.213	99,22	(2.662)	
Dec 23	24	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	5.968.613	98,80	(40.912)	
Mrt 24	40	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	9.907.988	98,62	(45.987)	
Jun 24	19	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	4.684.175	98,45	(8.038)	
Apr 21	30	Amsterdam Index Future	Newedge Group	EUR	(4.797.633)	699,14	(121.656)	
Jun 21	293	Australian 10 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	30.991.217	138,11	(254.123)	
Jun 21	9	Australian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	701.199	76,02	(17.064)	
Dec 21	25	Bankers' Acceptance Future	Newedge Group	CAD	(4.948.228)	99,49	497	
Jun 21	7	British Pound Future	Morgan Stanley	USD	611.297	137,81	(8.378)	
Apr 21	232	CAC 40 Index Future	Newedge Group	EUR	(16.368.347)	6.066,00	(135.201)	
Jun 21	327	Canada 10 Year Bond Future	Newedge Group	CAD	36.989.942	138,77	(881.252)	

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Futurescontracten (vervolg)

Vervaldatum	Hoeveelheid	Contract	Tegenpartij	Valuta	(Short-)/ Long- positie	Marktprijs	Niet-gerealiseerde waardevermeerde- ring/(-vermindering)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (vervolg)							
Jun 21	8	Canadian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	641.679	79,57	(5.119)
Apr 21	255	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(6.897.802)	20,73	1.610.632
Mei 21	65	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(1.832.666)	22,68	358.739
Jun 21	172	Dax Index Future	Newedge Group	EUR	73.395.129	15.029,00	2.390.256
Jun 21	16	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Morgan Stanley	USD	(2.639.775)	32.898,00	7.935
Apr 21	22	Dubai IRD FX Future	Newedge Group	USD	601.600	136,14	(2.584)
Jun 21	313	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	61.439.073	3.967,50	652.303
Jun 21	110	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Newedge Group	EUR	(26.983.710)	206,04	405.168
Jun 21	5	Euro FX Future	Morgan Stanley	USD	(737.269)	1,17	3.394
Jun 21	448	Euro Stoxx 50 Future	Newedge Group	EUR	20.002.791	3.866,00	307.998
Jun 21	110	Euro Stoxx Bank Future	Credit Suisse	EUR	(562.298)	87,10	516
Jun 21	31	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	4.908.113	135,08	2.545
Jun 21	355	Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	(61.867.934)	149,31	(291.088)
Jun 21	713	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	143.492.017	171,28	(278.798)
Jun 21	42	Euro-OAT Future	Credit Suisse	EUR	(7.979.191)	161,95	2.603
Jun 21	11	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(1.445.992)	112,10	(65)
Jun 21	415	FTSE 100 Index Future	Newedge Group	GBP	(38.482.670)	6.679,50	267.982
Apr 21	49	FTSE China A50 Future	Newedge Group	USD	(846.778)	17.182,00	4.860
Jun 21	69	FTSE MIB Index Future	Newedge Group	EUR	(9.711.891)	24.394,00	(157.470)
Jun 21	45	FTSE/JSE Top 40 Future	Newedge Group	ZAR	1.903.415	61.180,00	(38.171)
Apr 21	97	IBEX 35 Index Future	Newedge Group	EUR	(9.775.621)	8.586,70	8.087
Jun 21	3	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Credit Suisse	JPY	(4.100.248)	151,16	4.696
Jun 21	6	Japanese Yen Future	Morgan Stanley	USD	(684.688)	90,36	7.025
Jun 21	250	KOSDAQ150 Index Future	Newedge Group	KRW	2.965.721	1.405,70	139.426
Jun 21	344	KOSPI2 Index Future	Newedge Group	KRW	30.658.217	414,65	671.184
Jun 21	722	Long Gilt Future	Newedge Group	GBP	128.202.091	127,59	(1.205.489)
Jun 21	29	Mexican Peso Future	Morgan Stanley	USD	670.041	4,85	33.789
Jun 21	28	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	3.080.000	2.192,00	(11.200)
Jun 21	226	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	15.106.825	1.322,50	(162.575)
Apr 21	259	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	(6.876.384)	357,95	(15.457)
Jun 21	222	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	57.821.472	13.089,75	297.018
Jun 21	9	New Zealand Dollar Future	Morgan Stanley	USD	649.575	69,83	(21.105)
Jun 21	205	Nikkei 225 (OSE) Future	Credit Suisse	JPY	53.491.845	29.180,00	532.992
Jun 21	31	Nikkei 225 (YEN) Future	Morgan Stanley	JPY	4.065.907	29.345,00	41.996
Apr 21	49	OMXS30 Index Future	Newedge Group	SEK	(1.205.159)	2.187,25	(22.022)
Jun 21	2.157	RTS Index Future	Credit Suisse	USD	6.556.810	145.790,00	(267.430)
Jun 21	173	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(20.066.750)	2.222,50	842.125
Jun 21	38	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	9.940.990	2.605,30	(40.850)
Jun 21	78	S&P/TSX 60 Index Future	Newedge Group	CAD	13.892.888	1.111,10	(100.288)
Jun 21	645	SET 50 Index Future	Credit Suisse	THB	(3.954.755)	965,10	(29.178)
Apr 21	95	SGX Nifty 50 Future	Newedge Group	USD	(2.822.891)	14.746,00	21.151
Jun 21	400	Short-Term Euro-BTP Future	Credit Suisse	EUR	53.013.111	113,16	67.981
Jun 21	38	South Korea 10 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	(4.208.120)	126,10	(25.854)
Jun 21	20	South Korea 3 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	1.952.728	110,79	5.125
Jun 21	154	SPI 200 Future	Newedge Group	AUD	(19.765.579)	6.766,00	(20.014)
Jun 21	5	Stoxx 600 Bank Future	Credit Suisse	EUR	(37.280)	128,20	(305)
Jun 21	50	Stoxx Europe 600 Future	Credit Suisse	EUR	1.231.581	425,30	15.292
Jun 21	4	Swiss Franc Future	Morgan Stanley	USD	(533.375)	105,95	3.625
Apr 21	145	TAIEX Future	Newedge Group	TWD	16.421.414	16.423,00	270.382
Jun 21	102	Topix Index Future	Credit Suisse	JPY	(17.456.762)	1.954,00	(543.509)
Jun 21	7	US Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	(642.761)	93,24	(9.891)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Futurescontracten (vervolg)

Vervaldatum	Hoeveelheid	Contract	Tegenpartij	Valuta	(Short-)/ Long- positie	Marktprijs	Niet-gerealiseerde waardevermeerde- ring/(-vermindering)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (vervolg)							
Jun 21	228	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	29.974.906	130,94	(121.156)
Jun 21	1.005	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(222.017.711)	110,36	187.516
Jun 21	51	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(6.308.531)	123,40	15.211
Apr 21	64	US Dollar Index Future	Newedge Group	KRW	(644.100)	1.131,90	4.015
Jun 21	433	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(69.146.047)	154,59	2.206.953
Jun 21	156	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(29.664.047)	181,22	1.393.922
Apr 21	35	VSTOXX Mini Future	Credit Suisse	EUR	(88.832)	18,35	13.515
Jun 21	15	WIG20 Index Future	Credit Suisse	PLN	(146.780)	1.941,00	(567)
						USD	8.007.609
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund							
Jun 21	36	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	(2.413.050)	6.679,50	8.430
						GBP	8.430
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Jun 21	137	Australian 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(14.325.464)	138,11	(46.487)
Jun 21	29	Australian 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	2.574.791	117,04	3.318
Jun 21	66	Canada 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	(7.307.313)	138,77	19.320
Jun 21	16	Canada 5 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	1.614.642	125,87	(12.095)
Apr 21	17	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	396.100	20,73	(43.622)
Jun 21	9	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(1.772.568)	3.967,50	(12.808)
Jun 21	-	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	3.951	206,04	(3.951)
Jun 21	51	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	(2.263.071)	3.866,00	(49.095)
Jun 21	6	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(939.450)	135,08	(11.000)
Jun 21	40	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(6.974.481)	149,31	(29.353)
Jun 21	46	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(9.240.511)	171,28	948
Jun 21	8	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(1.514.952)	161,95	(4.398)
Jun 21	93	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(12.224.700)	112,10	(1.050)
Jun 21	21	KOSPI2 Index Future	Morgan Stanley	KRW	(1.899.304)	414,65	(24.188)
Jun 21	468	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(82.701.482)	127,59	382.355
Jun 21	32	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(3.501.300)	2.192,00	(5.900)
Jun 21	14	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(931.700)	1.322,50	5.950
Jun 21	3	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(339.300)	2.222,50	5.925
Jun 21	76	S&P500 Micro E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1.487.797)	3.967,50	(19.853)
Jun 21	43	SET 50 Index Future	Morgan Stanley	THB	(262.527)	965,10	(3.068)
Apr 21	29	SGX Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	(860.764)	14.746,00	5.496
Jun 21	27	Stoxx 600 Oil Future	Morgan Stanley	EUR	406.833	259,00	3.201
Jun 21	46	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(6.101.938)	130,94	78.813
Jun 21	69	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(9.934.805)	143,69	20.367
Jun 21	279	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	61.615.828	110,36	(33.117)
Jun 21	246	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(30.376.680)	123,40	20.664
Jun 21	72	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(11.169.344)	154,59	38.594
Jun 21	55	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(10.153.711)	181,22	186.680
						USD	471.646

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Optiecontracten

Optiecontracten zijn gewaardeerd tegen de laatste beschikbare koers op de Berekeningsdag van de IW en de marktwaarde, als deze niet 0 is, is opgenomen in het Overzicht van het nettovermogen onder 'Opties en swaptions tegen marktwaarde'.

Op 31 maart 2021 hadden de volgende subfondsen optiecontracten op financiële indices en internationaal genoteerde aandelen uitstaan:

Nominale waarde onderhevig aan call of put	Contract	Tegenpartij	Valuta	Betaalde/ (ontvangen) premie	Marktwaarde	Niet-gereali-seerde waarde-vermeerdering/ (-vermindering)
Schroder GAIA BlueTrend						
(700.087)	Put op UBS ETC Linked to a Systematic Strategy Delta-1 Basket on Commodity Future Uitoefenprijs 68,87 Vervalt op 1 april 2021	UBS	USD	(2.757)	-	2.757
				USD	-	2.757
Schroder GAIA Contour Tech Equity						
3.100	Call op Hitachi, Ltd. Uitoefenprijs 6.000,00 Vervalt op 12 november 2021	Morgan Stanley	JPY	621.838	466.321	(155.517)
				USD	466.321	(155.517)
Schroder GAIA Egerton Equity						
(542.700)	Put op boohoo Group PLC Uitoefenprijs 1,11 Vervalt op 18 juni 2021	Goldman Sachs	GBP	(121.064)	(45)	121.019
542.700	Put op boohoo Group PLC Uitoefenprijs 1,67 Vervalt op 18 juni 2021	Goldman Sachs	GBP	254.919	618	(254.301)
				EUR	573	(133.282)
Schroder GAIA Helix						
80	Put op Deutsche Boerse AG German Stock Index DAX Uitoefenprijs 13.800,00 Vervalt op 16 apr 2021	Goldman Sachs	EUR	43.341	9.804	(33.537)
203	Put op Deutsche Boerse AG German Stock Index DAX Uitoefenprijs 14.000,00 Vervalt op 16 apr 2021	Goldman Sachs	EUR	100.631	31.543	(69.088)
81	Put op FTSE 100 Index Uitoefenprijs 6.400,00 Vervalt op 18 juni 2021	Goldman Sachs	GBP	144.078	110.829	(33.249)
14	Put op MSCI Emerging Markets Index Uitoefenprijs 1.270,00 Vervalt op 16 april 2021	Goldman Sachs	USD	16.432	7.770	(8.662)
19	Put op S&P 500 Index Uitoefenprijs 3.530,00 Vervalt op 16 april 2021	J.P. Morgan	USD	67.310	5.225	(62.085)
77	Put op S&P 500 Index Uitoefenprijs 3.800,00 Vervalt op 16 april 2021	Goldman Sachs	USD	218.316	97.020	(121.296)
30	Put op S&P 500 Index Uitoefenprijs 3.900,00 Vervalt op 16 april 2021	Goldman Sachs	USD	74.212	75.600	1.388
				USD	337.791	(326.529)
Schroder GAIA M&A*						
2	Put op S&P 500 Index Uitoefenprijs 3.530,00 Vervalt op 16 april 2021	Goldman Sachs	USD	7.085	550	(6.535)
				USD	550	(6.535)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund						
79	Put op FTSE 100 Index Uitoefenprijs 6.400,00 Vervalt op 18 juni 2021	Morgan Stanley	GBP	101.250	78.407	(22.843)
				GBP	78.407	(22.843)

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Optiecontracten (vervolg)

Nominale waarde onderhevig aan call of put	Contract	Tegenpartij	Valuta	Betaalde/ (ontvangen) premie	Marktw waarde	Niet-gereali-seerde waarde- vermeerdering/ (-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
12	Call op Amazon.Com, Inc. Uitoefenprijs 3.550,00 Vervalt op 18 juni 2021	Morgan Stanley	USD	55.008	35.550	(19.458)
3.761	Call op ASML Holding NV Uitoefenprijs 560,00 Vervalt op 16 april 2021	Morgan Stanley	EUR	25.922	11.546	(14.376)
3.385	Call op ASML Holding NV Uitoefenprijs 590,00 Vervalt op 21 mei 2021	Morgan Stanley	EUR	26.029	21.697	(4.332)
32.451	Call op Bayerische Motoren Werke Aktiengesellschaft Uitoefenprijs 96,00 Vervalt op 18 jun 2021	Goldman Sachs	EUR	50.576	73.406	22.830
194.212	Call op BP PLC Uitoefenprijs 3,20 Vervalt op 17 september 2021	Goldman Sachs	GBP	58.362	39.099	(19.263)
(194.212)	Call op BP PLC Uitoefenprijs 4,00 Vervalt op 17 september 2021	Goldman Sachs	GBP	(15.957)	(8.580)	7.377
2	Call op CBOE Mini Index Uitoefenprijs 404,00 Vervalt op 16 april 2021	Morgan Stanley	USD	1.015	340	(675)
52.464	Call op Covestro AG Uitoefenprijs 63,00 Vervalt op 18 juni 2021	Goldman Sachs	EUR	101.253	91.872	(9.381)
234	Call op DISH Network Corp. Uitoefenprijs 40,00 Vervalt op 16 april 2021	Morgan Stanley	USD	38.940	6.084	(32.856)
112.558	Call op Engie S.A. Uitoefenprijs 15,00 Vervalt op 18 juni 2021	J.P. Morgan	EUR	51.413	1.813	(49.600)
122.971	Call op Engie S.A. Uitoefenprijs 15,50 Vervalt op 16 april 2021	J.P. Morgan	EUR	21.992	15	(21.977)
19.487.029	Call op Euro Stoxx 50 Index versus S&P 500 Index Uitoefenprijs 2,50% Vervalt op 16 december 2022	Goldman Sachs	USD	216.902	183.451	(33.451)
17.905.507	Call op Euro Stoxx 50 Index versus S&P 500 Index Uitoefenprijs 2,50% Vervalt op 17 december 2021	Goldman Sachs	USD	176.846	126.091	(50.755)
16.865	Call op Euro Stoxx Banks Index Uitoefenprijs 114,85 Vervalt op 18 jun 2021	Goldman Sachs	EUR	45.203	2.194	(43.009)
228.465	Call op Euro Stoxx Banks Index Uitoefenprijs 120,00 Vervalt op 17 dec 2021	J.P. Morgan	EUR	345.695	220.948	(124.747)
61.046	Call op Euro Stoxx Banks Index Uitoefenprijs 120,64 Vervalt op 18 jun 2021	Goldman Sachs	EUR	71.265	4.210	(67.055)
(1.385.000)	Call op wisselkoers AUD/USD Uitoefenprijs 0,78 Vervalt op 1 april 2021	Barclays Bank	AUD	(13.574)	-	13.574
980.000	Call op wisselkoers EUR/AUD Uitoefenprijs 1,54 Vervalt op 22 april 2021	Citi Bank	EUR	10.612	8.849	(1.763)
1.014.000	Call op wisselkoers EUR/AUD Uitoefenprijs 1,54 Vervalt op 28 april 2021	J.P. Morgan	EUR	10.670	10.000	(670)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Optiecontracten (vervolg)

Nominale waarde onderhevig aan call of put	Contract	Tegenpartij	Valuta	Betaalde/ (ontvangen) premie	Marktw waarde	Niet-gereali-seerde waarde- vermeerdering/ (-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)						
844.000	Call op wisselkoers EUR/AUD Uitoefenprijs 1,55 Vervalt op 15 april 2021	J.P. Morgan	EUR	9.419	5.109	(4.310)
888.000	Call op wisselkoers EUR/AUD Uitoefenprijs 1,55 Vervalt op 31 maart 2021	Citi Bank	EUR	9.520	-	(9.520)
(851.000)	Call op wisselkoers EUR/BRL Uitoefenprijs 6,74 Vervalt op 15 april 2021	BNP Paribas	EUR	(23.527)	(7.119)	16.408
(892.000)	Call op wisselkoers EUR/BRL Uitoefenprijs 6,78 Vervalt op 6 april 2021	Bank of America	EUR	(24.869)	(1.620)	23.249
892.000	Call op wisselkoers EUR/CAD Uitoefenprijs 1,52 Vervalt op 6 april 2021	Bank of America	EUR	7.735	2	(7.733)
856.000	Call op wisselkoers EUR/CNH Uitoefenprijs 7,75 Vervalt op 22 april 2021	Bank of America	EUR	6.222	3.063	(3.159)
911.000	Call op wisselkoers EUR/CNH Uitoefenprijs 7,79 Vervalt op 8 april 2021	Bank of America	EUR	7.466	344	(7.122)
1.051.000	Call op wisselkoers EUR/JPY Uitoefenprijs 128,92 Vervalt op 8 april 2021	Citi Bank	EUR	10.223	10.022	(201)
1.136.000	Call op wisselkoers EUR/JPY Uitoefenprijs 130,12 Vervalt op 15 april 2021	Citi Bank	EUR	10.397	5.121	(5.276)
(856.000)	Call op wisselkoers EUR/MXN Uitoefenprijs 24,59 Vervalt op 22 april 2021	J.P. Morgan	EUR	(17.995)	(6.033)	11.962
(888.000)	Call op wisselkoers EUR/MXN Uitoefenprijs 25,04 Vervalt op 31 maart 2021	J.P. Morgan	EUR	(17.894)	-	17.894
852.000	Call op wisselkoers EUR/NZD Uitoefenprijs 1,66 Vervalt op 15 april 2021	Citi Bank	EUR	9.450	13.975	4.525
980.000	Call op wisselkoers EUR/NZD Uitoefenprijs 1,66 Vervalt op 22 april 2021	Citi Bank	EUR	10.679	15.229	4.550
(891.000)	Call op wisselkoers EUR/RUB Uitoefenprijs 88,98 Vervalt op 7 april 2021	Citi Bank	EUR	(17.832)	(5.445)	12.387
891.000	Call op wisselkoers EUR/SEK Uitoefenprijs 10,18 Vervalt op 7 april 2021	Bank of America	EUR	6.939	7.619	680
1.145.000	Call op wisselkoers EUR/USD Uitoefenprijs 1,18 Vervalt op 2 juli 2021	Citi Bank	EUR	16.559	15.984	(575)
1.202.000	Call op wisselkoers EUR/USD Uitoefenprijs 1,19 Vervalt op 8 april 2021	Citi Bank	EUR	11.274	268	(11.006)
1.177.000	Call op wisselkoers EUR/USD Uitoefenprijs 1,21 Vervalt op 31 maart 2021	Morgan Stanley	EUR	10.961	-	(10.961)
1.232.000	Call op wisselkoers EUR/USD Uitoefenprijs 1,22 Vervalt op 14 mei 2021	Bank of America	EUR	17.260	704	(16.556)
1.000.000	Call op wisselkoers EUR/USD Uitoefenprijs 1,23 Vervalt op 31 maart 2021	Morgan Stanley	EUR	15.951	-	(15.951)
(883.000)	Call op wisselkoers EUR/ZAR Uitoefenprijs 18,05 Vervalt op 31 maart 2021	Citi Bank	EUR	(19.604)	-	19.604
(911.000)	Call op wisselkoers EUR/ZAR Uitoefenprijs 18,37 Vervalt op 8 april 2021	Bank of America	EUR	(20.380)	(332)	20.048

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Optiecontracten (vervolg)

Nominale waarde onderhevig aan call of put	Contract	Tegenpartij	Valuta	Betaalde/ (ontvangen) premie	Marktw waarde	Niet-gereali-seerde waarde- vermeerdering/ (-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)						
777.000	Call op wisselkoers GBP/AUD Uitoefenprijs 1,81 Vervalt op 8 april 2021	Citi Bank	GBP	10.483	6.190	(4.293)
721.000	Call op wisselkoers GBP/JPY Uitoefenprijs 150,50 Vervalt op 22 april 2021	Citi Bank	GBP	9.642	17.101	7.459
732.000	Call op wisselkoers GBP/JPY Uitoefenprijs 151,85 Vervalt op 15 april 2021	Citi Bank	GBP	10.029	9.503	(526)
735.000	Call op wisselkoers GBP/USD Uitoefenprijs 1,39 Vervalt op 10 mei 2021	Citi Bank	GBP	14.030	7.195	(6.835)
1.080.000	Call op wisselkoers USD/BRL Uitoefenprijs 5,82 Vervalt op 8 april 2021	Morgan Stanley	USD	25.866	2.034	(23.832)
2.211.000	Call op wisselkoers USD/BRL Uitoefenprijs 6,27 Vervalt op 15 september 2021	J.P. Morgan	USD	48.730	45.819	(2.911)
3.130.000	Call op wisselkoers USD/BRL Uitoefenprijs 6,31 Vervalt op 9 juni 2021	Bank of America	USD	50.794	19.009	(31.785)
(1.066.000)	Call op wisselkoers USD/CAD Uitoefenprijs 1,26 Vervalt op 6 april 2021	Bank of America	USD	(8.929)	(1.366)	7.563
1.236.000	Call op wisselkoers USD/CHF Uitoefenprijs 0,88 Vervalt op 8 april 2021	J.P. Morgan	USD	15.747	82.795	67.048
1.206.000	Call op wisselkoers USD/CHF Uitoefenprijs 0,90 Vervalt op 26 mei 2021	Bank of America	USD	16.814	51.732	34.918
(1.011.000)	Call op wisselkoers USD/CLP Uitoefenprijs 720,40 Vervalt op 4 mei 2021	Bank of America	USD	(15.570)	(16.012)	(442)
(628.000)	Call op wisselkoers USD/CLP Uitoefenprijs 737,70 Vervalt op 13 april 2021	J.P. Morgan	USD	(17.144)	(1.769)	15.375
1.066.000	Call op wisselkoers USD/CNH Uitoefenprijs 6,48 Vervalt op 6 april 2021	Bank of America	USD	5.970	13.906	7.936
1.016.000	Call op wisselkoers USD/CNH Uitoefenprijs 6,52 Vervalt op 15 april 2021	Deutsche Bank	USD	5.596	8.596	3.000
1.347.000	Call op wisselkoers USD/CNH Uitoefenprijs 6,55 Vervalt op 15 juli 2021	Goldman Sachs	USD	21.939	22.312	373
(1.347.000)	Call op wisselkoers USD/CNH Uitoefenprijs 6,76 Vervalt op 15 juli 2021	Goldman Sachs	USD	(9.461)	(6.805)	2.656
1.073.000	Call op wisselkoers USD/HUF Uitoefenprijs 310,18 Vervalt op 8 april 2021	Citi Bank	USD	13.158	3.192	(9.966)
2.339.000	Call op wisselkoers USD/HUF Uitoefenprijs 310,22 Vervalt op 4 mei 2021	Morgan Stanley	USD	27.050	21.502	(5.548)
751.000	Call op wisselkoers USD/IDR Uitoefenprijs 14.177,00 Vervalt op 6 mei 2021	Barclays Bank	USD	12.789	24.657	11.868
802.000	Call op wisselkoers USD/IDR Uitoefenprijs 14.610,00 Vervalt op 21 juni 2021	Barclays Bank	USD	13.722	15.911	2.189
942.000	Call op wisselkoers USD/IDR Uitoefenprijs 14.843,00 Vervalt op 12 april 2021	J.P. Morgan	USD	8.436	1.161	(7.275)
761.000	Call op wisselkoers USD/ILS Uitoefenprijs 3,18 Vervalt op 8 april 2021	J.P. Morgan	USD	9.923	37.684	27.761

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Optiecontracten (vervolg)

Nominale waarde onderhevig aan call of put	Contract	Tegenpartij	Valuta	Betaalde/ (ontvangen) premie	Marktw waarde	Niet-gereali-seerde waarde- vermeerdering/ (-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)						
1.072.000	Call op wisselkoers USD/ILS Uitoefenprijs 3,30 Vervalt op 6 april 2021	Barclays Bank	USD	9.316	14.931	5.615
(1.073.000)	Call op wisselkoers USD/INR Uitoefenprijs 73,85 Vervalt op 8 april 2021	Bank of America	USD	(8.046)	(1.489)	6.557
(1.072.000)	Call op wisselkoers USD/INR Uitoefenprijs 73,93 Vervalt op 6 april 2021	Morgan Stanley	USD	(8.930)	(733)	8.197
741.000	Call op wisselkoers USD/INR Uitoefenprijs 74,12 Vervalt op 19 april 2021	Bank of America	USD	8.147	1.870	(6.277)
859.000	Call op wisselkoers USD/INR Uitoefenprijs 74,17 Vervalt op 7 juni 2021	Citi Bank	USD	11.040	7.872	(3.168)
1.643.000	Call op wisselkoers USD/INR Uitoefenprijs 75,20 Vervalt op 14 mei 2021	Barclays Bank	USD	7.854	4.842	(3.012)
1.568.000	Call op wisselkoers USD/INR Uitoefenprijs 75,48 Vervalt op 31 maart 2021	Deutsche Bank	USD	8.210	-	(8.210)
1.236.000	Call op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 103,59 Vervalt op 8 april 2021	Deutsche Bank	USD	15.316	79.558	64.242
1.206.000	Call op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 105,68 Vervalt op 26 mei 2021	Morgan Stanley	USD	15.494	55.364	39.870
1.429.000	Call op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 106,68 Vervalt op 1 april 2021	Citi Bank	USD	11.046	52.204	41.158
(1.080.000)	Call op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 108,60 Vervalt op 8 april 2021	Bank of America	USD	(8.273)	(20.861)	(12.588)
(1.016.000)	Call op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 108,65 Vervalt op 23 april 2021	J.P. Morgan	USD	(6.878)	(20.108)	(13.230)
1.537.000	Call op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 109,61 Vervalt op 27 april 2021	Citi Bank	USD	10.502	20.075	9.573
800.000	Call op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 95,99 Vervalt op 17 jun 2024	BNP Paribas	USD	55.269	99.627	44.358
2.692.000	Call op wisselkoers USD/MXN Uitoefenprijs 20,48 Vervalt op 6 mei 2021	Barclays Bank	USD	78.283	52.388	(25.895)
(2.692.000)	Call op wisselkoers USD/MXN Uitoefenprijs 21,66 Vervalt op 6 mei 2021	Barclays Bank	USD	(34.108)	(13.169)	20.939
992.000	Call op wisselkoers USD/PHP Uitoefenprijs 48,21 Vervalt op 20 april 2021	Morgan Stanley	USD	8.154	9.238	1.084
628.000	Call op wisselkoers USD/PHP Uitoefenprijs 48,23 Vervalt op 13 april 2021	J.P. Morgan	USD	5.458	4.878	(580)
1.002.000	Call op wisselkoers USD/PHP Uitoefenprijs 49,06 Vervalt op 8 juni 2021	Deutsche Bank	USD	10.327	6.303	(4.024)
1.072.000	Call op wisselkoers USD/PLN Uitoefenprijs 3,76 Vervalt op 1 april 2021	Bank of America	USD	11.529	51.222	39.693
2.425.000	Call op wisselkoers USD/PLN Uitoefenprijs 3,77 Vervalt op 1 april 2021	Barclays Bank	USD	26.505	110.410	83.905
2.417.000	Call op wisselkoers USD/PLN Uitoefenprijs 3,79 Vervalt op 6 april 2021	Citi Bank	USD	26.527	102.167	75.640

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Optiecontracten (vervolg)

Nominale waarde onderhevig aan call of put	Contract	Tegenpartij	Valuta	Betaalde/ (ontvangen) premie	Marktwaarde	Niet-gereali-seerde waarde- vermeerdering/ (-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)						
1.073.000	Call op wisselkoers USD/PLN Uitoefenprijs 3,87 Vervalt op 8 april 2021	Citi Bank	USD	12.600	21.818	9.218
1.022.000	Call op wisselkoers USD/RUB Uitoefenprijs 76,37 Vervalt op 23 april 2021	Barclays Bank	USD	18.713	11.877	(6.836)
805.000	Call op wisselkoers USD/SEK Uitoefenprijs 8,39 Vervalt op 6 mei 2021	Citi Bank	USD	13.870	32.348	18.478
1.016.000	Call op wisselkoers USD/SEK Uitoefenprijs 8,52 Vervalt op 15 april 2021	Barclays Bank	USD	10.718	25.697	14.979
1.031.000	Call op wisselkoers USD/SEK Uitoefenprijs 8,71 Vervalt op 4 mei 2021	Deutsche Bank	USD	10.605	12.041	1.436
866.000	Call op wisselkoers USD/SGD Uitoefenprijs 1,32 Vervalt op 26 mei 2021	J.P. Morgan	USD	7.816	16.947	9.131
761.000	Call op wisselkoers USD/SGD Uitoefenprijs 1,32 Vervalt op 8 april 2021	J.P. Morgan	USD	7.610	11.981	4.371
761.000	Call op wisselkoers USD/THB Uitoefenprijs 30,03 Vervalt op 8 april 2021	J.P. Morgan	USD	9.242	31.188	21.946
743.000	Call op wisselkoers USD/THB Uitoefenprijs 30,09 Vervalt op 25 mei 2021	Bank of America	USD	7.547	29.526	21.979
630.000	Call op wisselkoers USD/TRY Uitoefenprijs 7,64 Vervalt op 6 april 2021	Citi Bank	USD	22.702	49.210	26.508
(630.000)	Call op wisselkoers USD/TWD Uitoefenprijs 27,43 Vervalt op 6 april 2021	Morgan Stanley	USD	(6.712)	(23.011)	(16.299)
(1.073.000)	Call op wisselkoers USD/TWD Uitoefenprijs 28,16 Vervalt op 8 april 2021	Bank of America	USD	(6.549)	(11.725)	(5.176)
(1.016.000)	Call op wisselkoers USD/TWD Uitoefenprijs 28,20 Vervalt op 15 april 2021	J.P. Morgan	USD	(6.553)	(9.900)	(3.347)
(1.016.000)	Call op wisselkoers USD/ZAR Uitoefenprijs 14,96 Vervalt op 15 april 2021	Morgan Stanley	USD	(20.229)	(8.974)	11.255
2.568.000	Call op wisselkoers USD/ZAR Uitoefenprijs 15,31 Vervalt op 6 juli 2021	Citi Bank	USD	119.258	67.097	(52.161)
785.000	Call op wisselkoers USD/ZAR Uitoefenprijs 16,70 Vervalt op 12 april 2021	Bank of America	USD	11.618	78	(11.540)
(2.568.000)	Call op wisselkoers USD/ZAR Uitoefenprijs 16,74 Vervalt op 6 juli 2021	Citi Bank	USD	(51.180)	(21.847)	29.333
188	Call op FTSE 100 Index Uitoefenprijs 6.850,00 Vervalt op 18 juni 2021	J.P. Morgan	GBP	37.438	24.699	(12.739)
261	Call op FTSE 100 Index Uitoefenprijs 7.100,00 Vervalt op 18 juni 2021	Goldman Sachs	GBP	25.407	11.212	(14.195)
395	Call op FTSE 100 Index Uitoefenprijs 7.200,00 Vervalt op 17 september 2021	J.P. Morgan	GBP	53.177	34.174	(19.003)
396	Call op FTSE 100 Index Uitoefenprijs 7.300,00 Vervalt op 17 september 2021	Goldman Sachs	GBP	43.812	25.430	(18.382)
3.072	Call op Panasonic Corp. Uitoefenprijs 1.721,39 Vervalt op 9 april 2021	Morgan Stanley	JPY	480	-	(480)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Optiecontracten (vervolg)

Nominale waarde onderhevig aan call of put	Contract	Tegenpartij	Valuta	Betaalde/ (ontvangen) premie	Marktwaarde	Niet-gereali-seerde waarde- vermeerdering/ (-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)						
2.523	Call op Panasonic Corp. Uitoefenprijs 1.796,24 Vervalt op 14 mei 2021	Morgan Stanley	JPY	448	17	(431)
513	Call op Pfizer, Inc. Uitoefenprijs 42,00 Vervalt op 18 jun 2021	Morgan Stanley	USD	51.515	6.925	(44.590)
30.764	Call op Philadelphia Gold and Silver Index Uitoefenprijs 160,00 Vervalt op 18 jun 2021	Morgan Stanley	USD	184.109	50.951	(133.158)
(19.305)	Call op Philadelphia Gold and Silver Index Uitoefenprijs 200,00 Vervalt op 18 jun 2021	Morgan Stanley	USD	(33.784)	(3.844)	29.940
6.414	Call op Panasonic Corp. Uitoefenprijs 5.660,18 Vervalt op 9 april 2021	J.P. Morgan	JPY	3.901	-	(3.901)
1.154	Call op Panasonic Corp. Uitoefenprijs 5.731,38 Vervalt op 9 april 2021	J.P. Morgan	JPY	711	-	(711)
596	Call op Rohm Co., Ltd. Uitoefenprijs 13.582,27 Vervalt op 9 april 2021	J.P. Morgan	JPY	1.002	-	(1.002)
4.184.064	Call op Russell 2000 Index versus NASDAQ-100 Index Uitoefenprijs 5,00% Vervalt op 16 december 2022	Morgan Stanley	USD	103.765	160.359	56.594
23	Call op S&P 500 Index Uitoefenprijs 4.050,00 Vervalt op 31 maart 2021	Morgan Stanley	USD	34.116	115	(34.001)
(141)	Call op S&P Biotechnology Select Industry Index Uitoefenprijs 12.424,00 Vervalt op 17 september 2021	Barclays Bank	USD	(80.511)	(26.965)	53.546
17.668	Call op Skylark Holdings Co., Ltd. Uitoefenprijs 2.059,21 Vervalt op 9 april 2021	J.P. Morgan	JPY	4.054	-	(4.054)
3.067	Call op Skylark Holdings Co., Ltd. Uitoefenprijs 2.077,33 Vervalt op 9 april 2021	J.P. Morgan	JPY	710	-	(710)
3.770.872	Call op TOPIX Banks Index Uitoefenprijs 159,94 Vervalt op 11 juni 2021	J.P. Morgan	JPY	187.901	101.198	(86.703)
108.708	Call op UniCredit SpA Uitoefenprijs 10,00 Vervalt op 18 jun 2021	Morgan Stanley	EUR	25.952	24.136	(1.816)
73.551	Call op UniCredit SpA Uitoefenprijs 10,50 Vervalt op 18 jun 2021	Morgan Stanley	EUR	22.698	9.698	(13.000)
(23.933)	Put op Bloomberg Commodity Index Uitoefenprijs 65,00 Vervalt op 21 juni 2021	J.P. Morgan	USD	(5.500)	-	5.500
23.933	Put op Bloomberg Commodity Index Uitoefenprijs 73,00 Vervalt op 21 juni 2021	J.P. Morgan	USD	48.582	7	(48.575)
(1.385.000)	Put op wisselkoers AUD/USD Uitoefenprijs 0,78 Vervalt op 1 april 2021	Barclays Bank	AUD	(13.617)	(24.957)	(11.340)
980.000	Put op wisselkoers EUR/AUD Uitoefenprijs 1,54 Vervalt op 22 april 2021	Citi Bank	EUR	10.612	7.108	(3.504)
1.014.000	Put op wisselkoers EUR/AUD Uitoefenprijs 1,54 Vervalt op 28 april 2021	J.P. Morgan	EUR	10.670	8.857	(1.813)
844.000	Put op wisselkoers EUR/AUD Uitoefenprijs 1,55 Vervalt op 15 april 2021	J.P. Morgan	EUR	9.419	6.087	(3.332)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Optiecontracten (vervolg)

Nominale waarde onderhevig aan call of put	Contract	Tegenpartij	Valuta	Betaalde/ (ontvangen) premie	Marktwaaarde	Niet-gereali-seerde waarde- vermeerdering/ (-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)						
(851.000)	Put op wisselkoers EUR/BRL Uitoefenprijs 6,74 Vervalt op 15 april 2021	BNP Paribas	EUR	(23.527)	(27.811)	(4.284)
(892.000)	Put op wisselkoers EUR/BRL Uitoefenprijs 6,78 Vervalt op 6 april 2021	Bank of America	EUR	(24.758)	(29.154)	(4.396)
892.000	Put op wisselkoers EUR/CAD Uitoefenprijs 1,52 Vervalt op 6 april 2021	Bank of America	EUR	7.735	33.015	25.280
856.000	Put op wisselkoers EUR/CNH Uitoefenprijs 7,75 Vervalt op 22 april 2021	Bank of America	EUR	6.222	8.325	2.103
911.000	Put op wisselkoers EUR/CNH Uitoefenprijs 7,79 Vervalt op 8 april 2021	Bank of America	EUR	7.465	12.015	4.550
1.051.000	Put op wisselkoers EUR/JPY Uitoefenprijs 128,92 Vervalt op 8 april 2021	Citi Bank	EUR	10.223	1.498	(8.725)
1.136.000	Put op wisselkoers EUR/JPY Uitoefenprijs 130,12 Vervalt op 15 april 2021	Citi Bank	EUR	10.397	8.109	(2.288)
(856.000)	Put op wisselkoers EUR/MXN Uitoefenprijs 24,59 Vervalt op 22 april 2021	J.P. Morgan	EUR	(17.995)	(30.222)	(12.227)
852.000	Put op wisselkoers EUR/NZD Uitoefenprijs 1,66 Vervalt op 15 april 2021	Citi Bank	EUR	9.450	1.593	(7.857)
980.000	Put op wisselkoers EUR/NZD Uitoefenprijs 1,66 Vervalt op 22 april 2021	Citi Bank	EUR	10.679	3.543	(7.136)
(891.000)	Put op wisselkoers EUR/RUB Uitoefenprijs 88,98 Vervalt op 7 april 2021	Citi Bank	EUR	(17.832)	(9.156)	8.676
891.000	Put op wisselkoers EUR/SEK Uitoefenprijs 10,18 Vervalt op 7 april 2021	Bank of America	EUR	6.940	591	(6.349)
883.000	Put op wisselkoers EUR/TRY Uitoefenprijs 8,88 Vervalt op 31 maart 2021	Citi Bank	EUR	22.773	-	(22.773)
1.145.000	Put op wisselkoers EUR/USD Uitoefenprijs 1,18 Vervalt op 2 juli 2021	Citi Bank	EUR	16.559	16.499	(60)
3.031.000	Put op wisselkoers EUR/USD Uitoefenprijs 1,19 Vervalt op 7 april 2021	Barclays Bank	EUR	28.732	63.378	34.646
4.266.000	Put op wisselkoers EUR/USD Uitoefenprijs 1,19 Vervalt op 8 april 2021	Citi Bank	EUR	40.250	68.487	28.237
1.232.000	Put op wisselkoers EUR/USD Uitoefenprijs 1,22 Vervalt op 14 mei 2021	Bank of America	EUR	17.260	54.188	36.928
(911.000)	Put op wisselkoers EUR/ZAR Uitoefenprijs 18,37 Vervalt op 8 april 2021	Bank of America	EUR	(20.380)	(64.088)	(43.708)
766.000	Put op wisselkoers GBP/AUD Uitoefenprijs 1,79 Vervalt op 31 maart 2021	Bank of America	GBP	9.929	-	(9.929)
777.000	Put op wisselkoers GBP/AUD Uitoefenprijs 1,81 Vervalt op 8 april 2021	Citi Bank	GBP	10.483	2.412	(8.071)
721.000	Put op wisselkoers GBP/JPY Uitoefenprijs 150,50 Vervalt op 22 april 2021	Citi Bank	GBP	9.641	3.226	(6.415)
732.000	Put op wisselkoers GBP/JPY Uitoefenprijs 151,85 Vervalt op 15 april 2021	Citi Bank	GBP	10.028	4.299	(5.729)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Optiecontracten (vervolg)

Nominale waarde onderhevig aan call of put	Contract	Tegenpartij	Valuta	Betaalde/ (ontvangen) premie	Marktwaarde	Niet-gereali-seerde waarde- vermeerdering/ (-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)						
735.000	Put op wisselkoers GBP/USD Uitoefenprijs 1,39 Vervalt op 10 mei 2021	Citi Bank	GBP	14.030	12.510	(1.520)
(3.130.000)	Put op wisselkoers USD/BRL Uitoefenprijs 5,52 Vervalt op 9 juni 2021	Bank of America	USD	(42.762)	(67.109)	(24.347)
(2.211.000)	Put op wisselkoers USD/BRL Uitoefenprijs 5,24 Vervalt op 15 september 2021	J.P. Morgan	USD	(39.798)	(35.585)	4.213
1.080.000	Put op wisselkoers USD/BRL Uitoefenprijs 5,82 Vervalt op 8 april 2021	Morgan Stanley	USD	25.866	38.362	12.496
(1.066.000)	Put op wisselkoers USD/CAD Uitoefenprijs 1,26 Vervalt op 6 april 2021	Bank of America	USD	(8.982)	(6.650)	2.332
1.236.000	Put op wisselkoers USD/CHF Uitoefenprijs 0,88 Vervalt op 8 april 2021	J.P. Morgan	USD	15.747	-	(15.747)
1.206.000	Put op wisselkoers USD/CHF Uitoefenprijs 0,90 Vervalt op 26 mei 2021	Bank of America	USD	16.814	891	(15.923)
(4.026.000)	Put op wisselkoers USD/CLP Uitoefenprijs 689,00 Vervalt op 19 juli 2021	Goldman Sachs	USD	(49.568)	(43.469)	6.099
(1.011.000)	Put op wisselkoers USD/CLP Uitoefenprijs 720,40 Vervalt op 4 mei 2021	Bank of America	USD	(15.571)	(16.142)	(571)
(628.000)	Put op wisselkoers USD/CLP Uitoefenprijs 737,70 Vervalt op 13 april 2021	J.P. Morgan	USD	(17.144)	(16.864)	280
6.406.000	Put op wisselkoers USD/CNH Uitoefenprijs 6,34 Vervalt op 17 mei 2021	Bank of America	USD	25.240	1.295	(23.945)
(2.135.000)	Put op wisselkoers USD/CNH Uitoefenprijs 6,46 Vervalt op 17 mei 2021	Bank of America	USD	(23.026)	(2.211)	20.815
1.066.000	Put op wisselkoers USD/CNH Uitoefenprijs 6,48 Vervalt op 6 april 2021	Bank of America	USD	5.970	23	(5.947)
1.016.000	Put op wisselkoers USD/CNH Uitoefenprijs 6,52 Vervalt op 15 april 2021	Deutsche Bank	USD	5.596	898	(4.698)
1.073.000	Put op wisselkoers USD/HUF Uitoefenprijs 310,18 Vervalt op 8 april 2021	Citi Bank	USD	13.158	8.387	(4.771)
751.000	Put op wisselkoers USD/IDR Uitoefenprijs 14.177,00 Vervalt op 6 mei 2021	Barclays Bank	USD	12.790	633	(12.157)
802.000	Put op wisselkoers USD/IDR Uitoefenprijs 14.610,00 Vervalt op 21 juni 2021	Barclays Bank	USD	13.722	9.260	(4.462)
761.000	Put op wisselkoers USD/ILS Uitoefenprijs 3,18 Vervalt op 8 april 2021	J.P. Morgan	USD	9.923	1	(9.922)
1.072.000	Put op wisselkoers USD/ILS Uitoefenprijs 3,30 Vervalt op 6 april 2021	Barclays Bank	USD	9.316	162	(9.154)
(1.073.000)	Put op wisselkoers USD/INR Uitoefenprijs 73,85 Vervalt op 8 april 2021	Bank of America	USD	(8.046)	(9.743)	(1.697)
(1.072.000)	Put op wisselkoers USD/INR Uitoefenprijs 73,93 Vervalt op 6 april 2021	Morgan Stanley	USD	(8.930)	(10.879)	(1.949)
741.000	Put op wisselkoers USD/INR Uitoefenprijs 74,12 Vervalt op 19 april 2021	Bank of America	USD	8.147	9.293	1.146

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Optiecontracten (vervolg)

Nominale waarde onderhevig aan call of put	Contract	Tegenpartij	Valuta	Betaalde/ (ontvangen) premie	Marktw waarde	Niet-gereali-seerde waarde- vermeerdering/ (-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)						
859.000	Put op wisselkoers USD/INR Uitoefenprijs 74,17 Vervalt op 7 juni 2021	Citi Bank	USD	11.040	11.323	283
1.236.000	Put op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 103,59 Vervalt op 8 april 2021	Deutsche Bank	USD	15.317	2	(15.315)
1.206.000	Put op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 105,68 Vervalt op 26 mei 2021	Morgan Stanley	USD	15.494	1.003	(14.491)
1.429.000	Put op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 106,68 Vervalt op 1 april 2021	Citi Bank	USD	11.046	-	(11.046)
(1.080.000)	Put op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 108,60 Vervalt op 8 april 2021	Bank of America	USD	(8.154)	(216)	7.938
(1.016.000)	Put op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 108,65 Vervalt op 23 april 2021	J.P. Morgan	USD	(6.878)	(1.279)	5.599
1.537.000	Put op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 109,61 Vervalt op 27 april 2021	Citi Bank	USD	10.502	4.979	(5.523)
800.000	Put op wisselkoers USD/JPY Uitoefenprijs 95,99 Vervalt op 17 jun 2024	BNP Paribas	USD	55.269	15.364	(39.905)
992.000	Put op wisselkoers USD/PHP Uitoefenprijs 48,21 Vervalt op 20 april 2021	Morgan Stanley	USD	8.154	1.048	(7.106)
628.000	Put op wisselkoers USD/PHP Uitoefenprijs 48,23 Vervalt op 13 april 2021	J.P. Morgan	USD	5.458	420	(5.038)
1.002.000	Put op wisselkoers USD/PHP Uitoefenprijs 49,06 Vervalt op 8 juni 2021	Deutsche Bank	USD	10.328	11.174	846
(1.347.000)	Put op wisselkoers USD/PLN Uitoefenprijs 3,59 Vervalt op 15 juli 2021	Citi Bank	USD	(12.446)	(1.384)	11.062
1.072.000	Put op wisselkoers USD/PLN Uitoefenprijs 3,76 Vervalt op 1 april 2021	Bank of America	USD	11.529	-	(11.529)
1.073.000	Put op wisselkoers USD/PLN Uitoefenprijs 3,87 Vervalt op 8 april 2021	Citi Bank	USD	12.600	416	(12.184)
1.022.000	Put op wisselkoers USD/RUB Uitoefenprijs 76,37 Vervalt op 23 april 2021	Barclays Bank	USD	18.713	19.773	1.060
805.000	Put op wisselkoers USD/SEK Uitoefenprijs 8,39 Vervalt op 6 mei 2021	Citi Bank	USD	13.870	620	(13.250)
1.016.000	Put op wisselkoers USD/SEK Uitoefenprijs 8,52 Vervalt op 15 april 2021	Barclays Bank	USD	10.719	495	(10.224)
1.031.000	Put op wisselkoers USD/SEK Uitoefenprijs 8,71 Vervalt op 4 mei 2021	Deutsche Bank	USD	10.605	9.361	(1.244)
866.000	Put op wisselkoers USD/SGD Uitoefenprijs 1,32 Vervalt op 26 mei 2021	J.P. Morgan	USD	7.816	1.189	(6.627)
761.000	Put op wisselkoers USD/SGD Uitoefenprijs 1,32 Vervalt op 8 april 2021	J.P. Morgan	USD	7.610	26	(7.584)
761.000	Put op wisselkoers USD/THB Uitoefenprijs 30,03 Vervalt op 8 april 2021	J.P. Morgan	USD	9.242	2	(9.240)
743.000	Put op wisselkoers USD/THB Uitoefenprijs 30,09 Vervalt op 25 mei 2021	Bank of America	USD	7.547	378	(7.169)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Optiecontracten (vervolg)

Nominale waarde onderhevig aan call of put	Contract	Tegenpartij	Valuta	Betaalde/ (ontvangen) premie	Marktwaaarde	Niet-gereali-seerde waarde- vermeerdering/ (-vermindering)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)							
630.000	Put op wisselkoers USD/TRY Uitoefenprijs 7,64 Vervalt op 6 april 2021	Citi Bank	USD	22.702	71	(22.631)	
(630.000)	Put op wisselkoers USD/TWD Uitoefenprijs 27,43 Vervalt op 6 april 2021	Morgan Stanley	USD	(6.712)	-	6.712	
(1.073.000)	Put op wisselkoers USD/TWD Uitoefenprijs 28,16 Vervalt op 8 april 2021	Bank of America	USD	(6.549)	(262)	6.287	
(1.016.000)	Put op wisselkoers USD/TWD Uitoefenprijs 28,20 Vervalt op 15 april 2021	J.P. Morgan	USD	(6.553)	(1.080)	5.473	
(1.016.000)	Put op wisselkoers USD/ZAR Uitoefenprijs 14,96 Vervalt op 15 april 2021	Morgan Stanley	USD	(20.229)	(19.964)	265	
(39)	Put op Russell 2000 Index Uitoefenprijs 1.910,00 Vervalt op 16 april 2021	Morgan Stanley	USD	(32.302)	(10.725)	21.577	
39	Put op Russell 2000 Index Uitoefenprijs 2.065,00 Vervalt op 16 april 2021	Morgan Stanley	USD	119.549	53.235	(66.314)	
(6)	Put op S&P 500 Index Uitoefenprijs 3.275,00 Vervalt op 16 april 2021	Morgan Stanley	USD	(24.610)	(690)	23.920	
(29)	Put op S&P 500 Index Uitoefenprijs 3.300,00 Vervalt op 18 juni 2021	Morgan Stanley	USD	(155.120)	(57.565)	97.555	
6	Put op S&P 500 Index Uitoefenprijs 3.675,00 Vervalt op 16 april 2021	Morgan Stanley	USD	61.250	3.390	(57.860)	
18	Put op S&P 500 Index Uitoefenprijs 3.700,00 Vervalt op 18 juni 2021	Morgan Stanley	USD	215.936	101.790	(114.146)	
11	Put op S&P 500 Index Uitoefenprijs 3.775,00 Vervalt op 18 juni 2021	Morgan Stanley	USD	152.014	76.560	(75.454)	
141	Put op S&P Biotechnology Select Industry Index Uitoefenprijs 10.094,00 Vervalt op 17 september 2021	Barclays Bank	USD	104.340	84.772	(19.568)	
14	Put op Tesla, Inc. Uitoefenprijs 625,00 Vervalt op 21 mei 2021	Morgan Stanley	USD	77.338	63.000	(14.338)	
					USD	2.877.006	(648.820)

Swaptions

Swaptions zijn gewaardeerd tegen de laatste beschikbare koers op de Berekeningsdag van de IW. De marktwaarde wordt vermeld in het Overzicht van het nettovermogen onder 'Opties en swaptions tegen marktwaarde'.

Op 31 maart 2021 hadden de volgende subfondsen swaptions op financiële indices en internationaal genoteerde aandelen uitstaan:

Beschermingspositie	Beschrijving	Tegenpartij	Valuta	Premie	Nominaal Bedrag	Marktwaaarde	Niet-gereali-seerde waarde- vermeerdering/ (-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kopen	IRS "Betaling vaste rente 1,20% Ontvangst vlottende rente USD LIBOR Apr 2021", Put 1,20%, 23 apr 2021	BNP Paribas	USD	13.153	1.725.000	95.533	82.380
Kopen	IRS "Betaling vaste rente 2,00% Ontvangst vlottende rente USD LIBOR Mar 2023", Put 2,00%, 3 mrt 2023	Bank of America	USD	226.931	6.125.000	314.487	87.556

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Swaptions (vervolg)

Beschermingspositie	Beschrijving	Tegenpartij	Valuta	Premie	Nominaal Bedrag	Marktw waarde	Niet-gereali-seerde waarde-vermeerdering/(-vermindering)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)								
Kopen	IRS "Betaling vaste rente 2,10% Ontvangst vlottende rente USD LIBOR Mar 2023", Put 2,10%, 24 mrt 2023	Goldman Sachs	USD	125.469	3.065.000	145.064	19.595	
Kopen	IRS "Betaling vaste rente 7,69% Ontvangst vlottende rente MXN TIIE Mar 2026", Put 7,69%, 13 mrt 2026	J.P. Morgan	MXN	384.124	157.510.000	210.392	(173.732)	
Kopen	IRS "Betaling vaste rente 8,50% Ontvangst vlottende rente MXN TIIE Apr 2028", Put 8,50%, 6 apr 2028	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	41.971	(53.954)	
Kopen	IRS "Ontvangst vaste rente 2,00% Betaling vlottende rente USD LIBOR Mar 2023", Call 2,00%, 3 mrt 2023	Bank of America	USD	226.931	6.125.000	172.910	(54.021)	
Kopen	IRS "Ontvangst vaste rente 2,10% Betaling vlottende rente USD LIBOR Mar 2023", Call 2,10%, 24 mrt 2023	Goldman Sachs	USD	117.279	3.065.000	98.568	(18.711)	
Verkopen	IRS "Ontvangst vaste rente 4,86% Betaling vlottende rente MXN TIIE Mar 2022", Call 4,86%, 23 mrt 2022	J.P. Morgan	MXN	(27.657)	(547.915.000)	(3.059)	24.598	
Kopen	IRS "Ontvangst vaste rente 5,36% Betaling vlottende rente MXN TIIE Mar 2022", Call 5,36%, 23 mrt 2022	J.P. Morgan	MXN	86.920	547.915.000	26.508	(60.412)	
Kopen	IRS "Ontvangst vaste rente 5,93% Betaling vlottende rente MXN TIIE Sep 2021", Call 5,93%, 29 sep 2021	J.P. Morgan	MXN	78.917	63.190.000	1.305	(77.612)	
Kopen	IRS "Ontvangst vaste rente 5,97% Betaling vlottende rente MXN TIIE Mar 2023", Call 5,97%, 30 mrt 2023	J.P. Morgan	MXN	69.383	46.495.000	4.528	(64.855)	
Kopen	IRS "Ontvangst vaste rente 6,25% Betaling vlottende rente MXN TIIE Feb 2022", Call, 6,25%, 21 feb 2022	J.P. Morgan	MXN	67.565	67.710.000	5.847	(61.718)	
Kopen	IRS "Ontvangst vaste rente 6,80% Betaling vlottende rente MXN TIIE Feb 2025", Call, 6,80%, 7 feb 2025	J.P. Morgan	MXN	541.676	228.495.000	94.568	(447.108)	
Kopen	IRS "Ontvangst vaste rente 7,08% Betaling vlottende rente ZAR JIBAR Nov 2021", Call 7,08%, 8 nov 2021	J.P. Morgan	ZAR	156.324	84.425.000	53.568	(102.756)	
Kopen	IRS "Ontvangst vaste rente 7,29% Betaling vlottende rente MXN TIIE Mar 2026", Call 7,29%, 5 mrt 2026	J.P. Morgan	MXN	396.524	157.510.000	99.585	(296.939)	
Kopen	IRS "Ontvangst vaste rente 7,33% Betaling vlottende rente ZAR JIBAR Nov 2021", Call 7,33%, 8 nov 2021	J.P. Morgan	ZAR	199.448	84.425.000	80.073	(119.375)	
Kopen	IRS "Ontvangst vaste rente 8,50% Betaling vlottende rente MXN TIIE apr 2028", Call, 8,50%, 6 apr 2028	J.P. Morgan	MXN	95.924	17.150.000	34.452	(61.472)	
						USD	1.476.300	(1.378.536)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Total Return Swaps

Het Fonds kan gebruikmaken van total return swaps. Een total return swap is een bilateraal financieel contract dat het Fonds de mogelijkheid biedt om te profiteren van alle kasstroomvoordelen van een actief zonder dat de Portefeuille dit actief (het 'Referentieactief') werkelijk in eigendom heeft. De subfondsen moeten een periodieke (vaste of variabele) vergoeding betalen in ruil voor hun recht om het totaalrendement van de Referentieactiva (coupons en/of vermogenswinsten en/of -verliezen) te ontvangen. Het Referentieactief kan bijna elk actief zijn dat voor de subfondsen een toegestane belegging vertegenwoordigt. De subfondsen kunnen van dergelijke instrumenten gebruikmaken om een positie in te nemen in een geschikte markt of voor afdekkingsdoeleinden.

De total return swaps zijn gewaardeerd tegen de laatste beschikbare koers op de Berekeningsdag van de IW. De niet-gerealiseerde winst of het niet-gerealiseerde verlies op total return swaps per einde van de periode wordt vertegenwoordigd door de waarden van de te ontvangen (of betaalde) rente, op basis van de rente van de betrokken swapovereenkomst min (dan wel plus), de waarde van het te betalen (dan wel te ontvangen) rendement, op basis van de totale rendementswaarde van de onderliggende activa, die bestaat uit de huidige marktwaarde van de aandelen plus het dividend dat is uitgekeerd voor deze aandelen voor het betrokken swapjaar. De niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering) wordt weergegeven in het Overzicht van het nettovermogen onder 'Netto niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering) op total return swaps'.

Per 31 maart 2021 waren de volgende subfondsen gebonden door uitstaande total return swaps:

Bescher- mingspositie	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal Bedrag	Marktwaarde	Verval- datum	Niet-gerealiseerde waardevermeer- dering/ (-vermindering)
Schroder GAIA Egerton Equity							
Long kopen	Luchtvaart/defensie	Morgan Stanley	EUR	13.346.693	7.124.292	3 dec 2021	8.595.305
Long kopen	Luchtvaartmaatschappijen	J.P. Morgan	EUR	14.066.108	349.944	21 jan 2022	4.027.090
Long kopen	Luchtvaartmaatschappijen	Morgan Stanley	EUR	14.634.357	6.581.391	3 dec 2021	6.880.199
Long kopen	Kleding	J.P. Morgan	EUR	8.038.183	3.201.196	6 mei 2022	3.524.925
Long kopen	Kleding	Morgan Stanley	EUR	15.013.068	2.255.089	3 dec 2021	2.356.518
Long kopen	Autofabrikanten	J.P. Morgan	EUR	18.153.526	9.617.711	27 dec 2021	9.634.349
Long kopen	Autofabrikanten	J.P. Morgan	EUR	11.448.470	4.592.302	16 mrt 2022	4.605.731
Long kopen	Dranken	Morgan Stanley	USD	7.894.504	1.067.493	3 aug 2021	2.426.310
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	Morgan Stanley	EUR	14.024.948	3.801.765	3 dec 2021	4.151.905
Long kopen	Woningbouw	Morgan Stanley	GBP	29.867.327	3.372.102	8 dec 2021	3.605.712
Long kopen	Verzekeringen	Morgan Stanley	GBP	18.609.209	1.241.100	8 dec 2021	1.296.862
Long kopen	Halfgeleiders	Morgan Stanley	USD	15.668.392	(1.165.838)	23 sep 2021	(1.016.805)
Short verkopen	Luchtvaart/defensie	J.P. Morgan	USD	9.759.290	(888.254)	25 feb 2022	(2.891.383)
Short verkopen	Autofabrikanten	Goldman Sachs	USD	6.271.359	(159.706)	28 feb 2024	(155.199)
Short verkopen	Autofabrikanten	Merrill Lynch	USD	1.870.303	332.753	29 apr 2022	332.579
Short verkopen	Banken	Merrill Lynch	CAD	474.409	(119.826)	31 dec 2021	(144.687)
Short verkopen	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	1.529.888	(1.857.019)	26 apr 2023	(1.791.174)
Short verkopen	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	4.516.064	(784.317)	18 okt 2021	(709.627)
Short verkopen	Chemische producten	Goldman Sachs	CHF	1.903.901	(105.016)	6 mrt 2024	(105.016)
Short verkopen	Chemische producten	Goldman Sachs	DKK	3.957.336	(89.860)	13 feb 2024	(89.936)
Short verkopen	Chemische producten	J.P. Morgan	USD	5.699.703	(679.681)	9 mrt 2022	(681.333)
Short verkopen	Commerciële diensten	Merrill Lynch	USD	2.407.777	289.567	29 apr 2022	290.964
Short verkopen	Computers	Goldman Sachs	USD	12.012.342	(822.924)	14 jun 2023	(854.411)
Short verkopen	Computers	Goldman Sachs	USD	8.292.447	2.062.163	22 feb 2024	2.114.487
Short verkopen	Computers	Goldman Sachs	USD	2.984.721	425.616	28 feb 2024	439.248
Short verkopen	Computers	Morgan Stanley	EUR	3.431.357	122.398	3 dec 2021	199.549
Short verkopen	Cosmetica/persoonlijke verzorging	Morgan Stanley	JPY	8.970.364	(1.194.023)	24 okt 2022	(1.113.389)
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	Goldman Sachs	USD	1.856.926	(391.791)	27 sep 2023	(392.893)
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	Morgan Stanley	ZAR	1.900.126	(63.400)	27 jan 2022	(62.412)
Short verkopen	Elektrisch	Goldman Sachs	DKK	3.506.921	(60.804)	4 apr 2024	(60.804)
Short verkopen	Elektrisch	Goldman Sachs	USD	3.372.577	217.988	5 mrt 2024	219.588
Short verkopen	Elektrisch	Morgan Stanley	GBP	3.173.355	(536.379)	8 dec 2021	(544.406)
Short verkopen	Elektrische onderdelen en uitrusting	Goldman Sachs	USD	919.979	(58.595)	28 feb 2024	(58.595)
Short verkopen	Elektronica	J.P. Morgan	USD	1.489.402	(77.079)	11 apr 2022	(77.298)
Short verkopen	Energie - Alternatieve bronnen	Merrill Lynch	USD	4.737.964	(740.459)	29 apr 2022	(732.906)
Short verkopen	Energie - Alternatieve bronnen	Morgan Stanley	USD	2.468.236	104.342	13 jul 2021	104.713
Short verkopen	Bouw en techniek	Goldman Sachs	SEK	1.918.764	(73.356)	12 feb 2024	(73.152)
Short verkopen	Bouw en techniek	J.P. Morgan	CAD	3.142.891	(917.928)	5 mei 2022	(761.876)
Short verkopen	Bouw en techniek	J.P. Morgan	USD	1.581.249	(2.143.019)	23 mrt 2022	(561.770)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Total Return Swaps (vervolg)

Beschermingspositie	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal Bedrag	Marktwaaarde	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)	
Schroder GAIA Egerton Equity (vervolg)								
Short verkopen	Voeding	Goldman Sachs	USD	4.539.190	(200.608)	16 jan 2024	(206.883)	
Short verkopen	Voeding	Goldman Sachs	USD	2.004.485	55.570	21 mrt 2024	57.003	
Short verkopen	Voedseldiensten	Morgan Stanley	EUR	3.223.180	(286.110)	3 dec 2021	(286.245)	
Short verkopen	Gas	Morgan Stanley	HKD	5.612.531	(1.786.019)	23 dec 2022	(1.799.452)	
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	Goldman Sachs	SEK	1.842.116	(539.193)	26 apr 2023	(550.242)	
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	J.P. Morgan	USD	2.474.168	(18.925)	25 apr 2022	(18.925)	
Short verkopen	Holdingmaatschappijen - Gediversifieerd	Merrill Lynch	USD	1.481.353	(109.952)	29 apr 2022	(109.952)	
Short verkopen	Woninginrichting	Morgan Stanley	JPY	2.794.403	(602.426)	24 okt 2022	(691.356)	
Short verkopen	Index	Goldman Sachs	USD	86.789.526	(3.557.648)	31 jan 2024	(3.612.788)	
Short verkopen	Verzekeringen	Merrill Lynch	USD	1.019.425	(12.018)	29 apr 2022	(29.386)	
Short verkopen	Internet	Goldman Sachs	USD	1.884.829	661.271	7 feb 2024	663.671	
Short verkopen	Internet	Goldman Sachs	USD	2.849.832	1.010.185	7 mrt 2024	1.026.239	
Short verkopen	Internet	Merrill Lynch	USD	4.355.858	122.001	29 apr 2022	122.001	
Short verkopen	Vrije tijd	Goldman Sachs	EUR	1.445.553	(42.259)	28 mrt 2024	(42.224)	
Short verkopen	Vrije tijd	Merrill Lynch	USD	996.159	(123.963)	29 apr 2022	(123.963)	
Short verkopen	Media	Morgan Stanley	GBP	1.434.005	(661.606)	8 dec 2021	(848.759)	
Short verkopen	Gemengde productie	J.P. Morgan	USD	4.935.949	(287.682)	18 apr 2022	(287.355)	
Short verkopen	Kantoor-/bedrijfsuitrusting	Morgan Stanley	JPY	6.349.358	(2.876.803)	24 okt 2022	(2.842.282)	
Short verkopen	Olie en gas	Morgan Stanley	GBP	308.487	121.856	8 dec 2021	120.792	
Short verkopen	Olie- en gasdiensten	J.P. Morgan	USD	4.277.478	701.489	20 sep 2021	487.945	
Short verkopen	Olie- en gasdiensten	Morgan Stanley	GBP	2.164.783	(946.040)	8 dec 2021	(985.770)	
Short verkopen	Farmaceutische producten	Merrill Lynch	USD	4.604.625	160.505	31 dec 2021	157.013	
Short verkopen	Farmaceutische producten	Morgan Stanley	USD	1.877.132	(1.181.252)	23 sep 2021	(1.178.811)	
Short verkopen	Onroerend goed	Morgan Stanley	HKD	1.888.300	89.890	23 dec 2022	90.237	
Short verkopen	REIT's	Morgan Stanley	EUR	1.365.788	(898.504)	3 dec 2021	(627.895)	
Short verkopen	Detailhandel	Goldman Sachs	USD	752.368	(30.086)	20 dec 2023	(122.882)	
Short verkopen	Detailhandel	Goldman Sachs	USD	817.903	(16.668)	31 jan 2024	(16.668)	
Short verkopen	Detailhandel	Merrill Lynch	USD	2.379.775	(256.746)	31 mrt 2022	(254.370)	
Short verkopen	Software	Goldman Sachs	EUR	4.778.047	(63.151)	27 dec 2023	(66.310)	
Short verkopen	Software	Goldman Sachs	SEK	2.867.133	(153.035)	28 feb 2024	(151.044)	
Short verkopen	Software	Goldman Sachs	USD	2.391.766	(134.916)	22 feb 2024	(131.589)	
Short verkopen	Software	J.P. Morgan	USD	754.251	(366.966)	29 jun 2021	(428.952)	
Short verkopen	Software	J.P. Morgan	USD	4.706.056	(41.120)	11 apr 2022	(39.449)	
Short verkopen	Software	Merrill Lynch	USD	4.685.877	10.766	29 apr 2022	3.666	
Short verkopen	Software	Morgan Stanley	PLN	4.279.295	773.473	13 jul 2022	786.726	
Short verkopen	Telecommunicatie	Goldman Sachs	USD	9.948.203	(499.626)	26 apr 2023	(382.179)	
Short verkopen	Telecommunicatie	Goldman Sachs	USD	6.724.916	128.697	2 okt 2023	134.744	
Short verkopen	Diversen*	Morgan Stanley	USD	11.405.558	50.733	17 mei 2021	(15.787)	
							EUR	29.725.481
Schroder GAIA Helix								
Short verkopen	Index	Goldman Sachs	EUR	3.010.961	(127.539)	4 jun 2021	(127.539)	
Short verkopen	Index	Goldman Sachs	EUR	94.123.744	(4.275.917)	30 sep 2021	(4.275.917)	
Short verkopen	Index	Goldman Sachs	JPY	3.335.936	(112.906)	4 jun 2021	(112.906)	
Short verkopen	Index	Goldman Sachs	JPY	5.914.351	(200.173)	30 sep 2021	(200.173)	
Short verkopen	Index	Goldman Sachs	USD	9.504.945	(120.440)	4 jun 2021	(120.440)	
Short verkopen	Index	Goldman Sachs	USD	298.337.557	10.094.268	30 sep 2021	10.094.268	
Short verkopen	Index	J.P. Morgan	JPY	149.469.423	2.747.326	30 sep 2021	2.747.326	
Short verkopen	Index	J.P. Morgan	USD	1.879.968	12.540	4 jun 2021	12.540	
Short verkopen	Index	J.P. Morgan	USD	149.869.251	2.964.773	30 sep 2021	2.964.773	
							USD	10.981.932

* Contract wordt gehouden op een korf van verschillende Amerikaanse aandelen.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Total Return Swaps (vervolg)

Beschermingspositie	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal Bedrag	Marktw waarde	Verval-datum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Sirios US Equity							
Long kopen	Luchtvaart/defensie	Goldman Sachs	USD	7.815.817	517.675	14 feb 2022	517.675
Long kopen	Banken	Goldman Sachs	USD	5.341.436	480.752	12 mei 2022	480.752
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	Goldman Sachs	USD	33.644.706	(1.816.331)	12 mei 2022	(1.828.884)
Long kopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	USD	11.487.406	492.695	12 aug 2022	492.695
Long kopen	Software	Goldman Sachs	USD	8.627.593	264.727	15 nov 2022	264.727
Short verkopen	Luchtvaart/defensie	Credit Suisse	USD	1.682.362	(12.455)	12 mei 2021	(14.438)
Short verkopen	Landbouw	Morgan Stanley	USD	970.005	(103.290)	26 mei 2021	(103.290)
Short verkopen	Kleding	Credit Suisse	USD	1.777.471	14.818	12 mei 2021	12.139
Short verkopen	Autofabrikanten	Merrill Lynch	USD	1.582.323	441.869	18 apr 2022	443.596
Short verkopen	Banken	Credit Suisse	USD	4.276.940	(301.181)	12 mei 2021	(301.181)
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	USD	2.283.389	(128.447)	12 aug 2022	(128.447)
Short verkopen	Banken	Merrill Lynch	USD	2.459.791	258.495	24 jan 2022	258.495
Short verkopen	Banken	Merrill Lynch	USD	1.805.636	62.977	23 mrt 2022	53.401
Short verkopen	Biotechnologie	Merrill Lynch	USD	1.471.016	(120.373)	24 mei 2021	(120.373)
Short verkopen	Commerciële diensten	Morgan Stanley	USD	3.272.520	10.899	26 mei 2021	10.899
Short verkopen	Computers	Credit Suisse	USD	2.642.660	(184.404)	12 mei 2021	(180.722)
Short verkopen	Computers	Merrill Lynch	USD	1.791.183	(86.345)	4 feb 2022	(86.345)
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	Credit Suisse	USD	962.720	(78.658)	12 mei 2021	(78.658)
Short verkopen	Elektronica	Credit Suisse	USD	1.954.290	(80.738)	12 mei 2021	(95.557)
Short verkopen	Voeding	Goldman Sachs	USD	1.242.406	(82.392)	12 aug 2021	(83.285)
Short verkopen	Voeding	Goldman Sachs	USD	1.994.259	(68.099)	15 nov 2021	(68.099)
Short verkopen	Voeding	Merrill Lynch	USD	1.880.453	(139.167)	30 apr 2021	(139.167)
Short verkopen	Voeding	Merrill Lynch	USD	4.097.353	(980.465)	24 mrt 2022	(980.465)
Short verkopen	Voeding	Merrill Lynch	USD	978.371	(34.515)	29 apr 2022	(34.515)
Short verkopen	Bosproducten en papier	Merrill Lynch	USD	1.213.280	(91.483)	25 mrt 2022	(91.483)
Short verkopen	Hand-/machinegereedschap	Credit Suisse	USD	1.089.154	(236.678)	12 mei 2021	(236.678)
Short verkopen	Woninginrichting	Merrill Lynch	USD	1.238.175	91.218	28 jun 2021	91.218
Short verkopen	Index	Morgan Stanley	USD	97.728.524	(1.731.102)	26 mei 2021	(1.731.102)
Short verkopen	Index	Morgan Stanley	USD	11.998.714	(225.935)	29 nov 2021	(225.935)
Short verkopen	Index	Morgan Stanley	USD	17.427.257	1.243.323	28 feb 2022	1.243.323
Short verkopen	Index	Morgan Stanley	USD	7.883.749	(266.489)	6 apr 2022	(266.489)
Short verkopen	Index	Morgan Stanley	USD	15.553.486	(802.320)	7 apr 2022	(847.512)
Short verkopen	Verzekeringen	Merrill Lynch	USD	984.394	1.738	26 apr 2022	1.738
Short verkopen	Internet	Merrill Lynch	USD	1.591.948	(59.293)	19 apr 2022	(59.293)
Short verkopen	Vrije tijd	Morgan Stanley	USD	1.517.855	(30.497)	26 mei 2021	(6.494)
Short verkopen	Machines - gediversifieerd	Goldman Sachs	USD	934.542	3.769	15 nov 2021	3.769
Short verkopen	Media	Credit Suisse	USD	795.510	211.600	12 mei 2021	211.600
Short verkopen	Olie en gas	Merrill Lynch	USD	1.268.750	(18.176)	18 jan 2022	(18.176)
Short verkopen	Verpakking en containers	Credit Suisse	USD	2.210.849	(87.010)	12 mei 2021	(101.054)
Short verkopen	Verpakking en containers	Goldman Sachs	USD	1.325.651	(28.995)	12 mei 2022	(28.995)
Short verkopen	Verpakking en containers	Merrill Lynch	USD	1.312.769	(57.359)	24 mei 2021	(57.359)
Short verkopen	Farmaceutische producten	Merrill Lynch	USD	1.033.263	68.775	25 okt 2021	68.775
Short verkopen	Farmaceutische producten	Merrill Lynch	USD	1.446.107	164.881	7 feb 2022	164.881
Short verkopen	REIT's	Credit Suisse	USD	4.562.614	(326.107)	12 mei 2021	(326.107)
Short verkopen	REIT's	Merrill Lynch	USD	841.924	10.424	27 dec 2021	10.424
Short verkopen	REIT's	Morgan Stanley	USD	819.864	(95.784)	28 mrt 2022	(95.784)
Short verkopen	Detailhandel	Barclays Bank	USD	17.800.953	39.338	15 apr 2021	(118.301)
Short verkopen	Detailhandel	Credit Suisse	USD	1.081.368	(109.160)	12 mei 2021	(109.160)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Total Return Swaps (vervolg)

Beschermingspositie	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal Bedrag	Marktwaaarde	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Sirios US Equity (vervolg)							
Short verkopen	Detailhandel	Goldman Sachs	USD	1.674.935	96.454	12 mei 2022	96.454
Short verkopen	Detailhandel	Merrill Lynch	USD	631.094	(74.988)	25 mrt 2022	(74.988)
Short verkopen	Detailhandel	Merrill Lynch	USD	987.356	(21.455)	29 apr 2022	(21.455)
Short verkopen	Detailhandel	Morgan Stanley	USD	7.246.445	(1.162.564)	26 mei 2021	(1.162.564)
Short verkopen	Halfgeleiders	Credit Suisse	USD	675.301	(58.971)	12 mei 2021	(58.971)
Short verkopen	Halfgeleiders	Morgan Stanley	USD	601.234	51.501	26 mei 2021	51.501
Short verkopen	Software	Credit Suisse	USD	1.241.657	(64.909)	12 mei 2021	(61.131)
Short verkopen	Software	Merrill Lynch	USD	3.022.166	214.282	14 feb 2022	265.012
Short verkopen	Software	Merrill Lynch	USD	2.562.480	24.679	19 apr 2022	24.679
Short verkopen	Telecommunicatie	Credit Suisse	USD	3.053.880	(61.121)	12 mei 2021	(35.957)
Short verkopen	Transport	Morgan Stanley	USD	5.086.238	(348.949)	27 apr 2022	(348.949)
USD							(5.559.610)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Long kopen	Diversen*	Morgan Stanley	USD	903.550.364	18.587.592	21 okt 2021	18.587.592
USD							18.587.592
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Long kopen	Luchtvaart/defensie	Goldman Sachs	EUR	115.428	(926)	24 mei 2023	(926)
Long kopen	Luchtvaart/defensie	J.P. Morgan	EUR	225.542	(5.712)	9 mei 2023	(5.712)
Long kopen	Landbouw	Goldman Sachs	GBP	583.155	(21.606)	24 mei 2023	(21.606)
Long kopen	Landbouw	J.P. Morgan	GBP	16.368	(329)	9 mei 2023	(329)
Long kopen	Autofabrikanten	Goldman Sachs	EUR	197.575	7.088	24 mei 2023	7.088
Long kopen	Autofabrikanten	Goldman Sachs	USD	79.207	(2.865)	24 mei 2023	(2.865)
Long kopen	Autofabrikanten	Morgan Stanley	USD	30.807	993	15 mei 2023	993
Long kopen	Auto-onderdelen en -uitrusting	Goldman Sachs	USD	615.839	(31.614)	25 mei 2023	(31.614)
Long kopen	Auto-onderdelen en -uitrusting	Morgan Stanley	USD	191.874	(10.506)	15 mei 2023	(10.506)
Long kopen	Banken	Goldman Sachs	CZK	287.562	5.929	24 mei 2023	5.929
Long kopen	Banken	Goldman Sachs	EUR	171.328	(1.354)	6 jan 2023	(1.354)
Long kopen	Banken	Goldman Sachs	EUR	1.917.160	31.044	24 mei 2023	31.044
Long kopen	Banken	Goldman Sachs	GBP	265.176	7.265	20 dec 2022	7.265
Long kopen	Banken	Goldman Sachs	GBP	630.362	16.704	24 mei 2023	16.704
Long kopen	Banken	Goldman Sachs	JPY	887.679	(82.836)	19 okt 2022	(82.836)
Long kopen	Banken	Goldman Sachs	SEK	10.057	(460)	9 jan 2023	(460)
Long kopen	Banken	Goldman Sachs	USD	679.667	5.673	12 mei 2022	5.673
Long kopen	Banken	Goldman Sachs	USD	4.442.761	31.642	24 mei 2023	31.642
Long kopen	Banken	J.P. Morgan	CZK	778.880	31.969	9 mei 2023	31.969
Long kopen	Banken	J.P. Morgan	EUR	206.494	9.898	9 mei 2023	9.898
Long kopen	Banken	J.P. Morgan	GBP	139.938	(633)	22 jun 2022	(633)
Long kopen	Banken	J.P. Morgan	GBP	359.899	3.793	20 jan 2023	3.793
Long kopen	Banken	J.P. Morgan	GBP	517.499	31.705	9 mei 2023	31.705
Long kopen	Banken	J.P. Morgan	ILS	259.151	11.886	9 mei 2023	11.886
Long kopen	Banken	J.P. Morgan	USD	566.506	26.998	22 jun 2021	26.998
Long kopen	Banken	J.P. Morgan	USD	1.437.555	(70.364)	9 mei 2023	(70.364)
Long kopen	Banken	Morgan Stanley	EUR	208.089	3.025	15 mei 2023	3.025
Long kopen	Banken	Morgan Stanley	JPY	491.868	(18.423)	15 mei 2023	(18.423)
Long kopen	Banken	Morgan Stanley	USD	2.402.197	(50.888)	15 mei 2023	(50.888)
Long kopen	Dranken	Goldman Sachs	USD	815.299	63.912	24 mei 2023	63.912
Long kopen	Biotechnologie	Goldman Sachs	CHF	51.192	(1.502)	24 mei 2023	(1.502)

*Contract wordt gehouden op een mandje van verschillende Amerikaanse aandelen.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Total Return Swaps (vervolg)

Beschermingspositie	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal Bedrag	Marktwaaarde	Verval-datum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)							
Long kopen	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	233.480	(880)	24 mei 2023	(880)
Long kopen	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	227.726	(5.987)	24 mei 2023	(5.987)
Long kopen	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	116.998	1.002	6 jan 2023	1.002
Long kopen	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	6.249.506	(328.083)	24 mei 2023	(328.083)
Long kopen	Biotechnologie	J.P. Morgan	CHF	470.490	53.395	9 mei 2023	53.395
Long kopen	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	343.010	11.129	22 jun 2021	11.129
Long kopen	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1.694.693	(41.694)	9 mei 2023	(41.694)
Long kopen	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	285.548	540	15 mei 2023	540
Long kopen	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	5.031.925	(346.926)	15 mei 2023	(346.926)
Long kopen	Chemische producten	J.P. Morgan	EUR	339.604	44.397	22 jun 2022	44.397
Long kopen	Chemische producten	J.P. Morgan	EUR	522.079	(33.039)	9 mei 2023	(33.039)
Long kopen	Commerciële diensten	Goldman Sachs	USD	1.872.352	(78.406)	24 mei 2023	(78.406)
Long kopen	Commerciële diensten	J.P. Morgan	EUR	484.145	4.601	22 jun 2022	4.601
Long kopen	Commerciële diensten	J.P. Morgan	USD	1.059.348	(28.213)	9 mei 2023	(28.213)
Long kopen	Commerciële diensten	Morgan Stanley	EUR	137.340	(6.221)	15 mei 2023	(6.221)
Long kopen	Commerciële diensten	Morgan Stanley	USD	141.179	(1.458)	27 dec 2021	(1.458)
Long kopen	Commerciële diensten	Morgan Stanley	USD	1.704.636	(108.560)	15 mei 2023	(108.560)
Long kopen	Computers	Goldman Sachs	USD	27.495	233	24 mei 2023	233
Long kopen	Computers	Goldman Sachs	USD	10.003	487	25 mei 2023	487
Long kopen	Computers	J.P. Morgan	USD	706.718	(3.341)	9 mei 2023	(3.341)
Long kopen	Computers	Morgan Stanley	GBP	198.560	1.124	15 mei 2023	1.124
Long kopen	Computers	Morgan Stanley	USD	52.976	556	15 mei 2023	556
Long kopen	Gediversifieerde financiële diensten	Goldman Sachs	AUD	2.724	(204)	24 mei 2023	(204)
Long kopen	Gediversifieerde financiële diensten	Goldman Sachs	GBP	278.517	946	23 jan 2023	946
Long kopen	Gediversifieerde financiële diensten	Goldman Sachs	USD	2.968.163	(77.664)	24 mei 2023	3.612
Long kopen	Gediversifieerde financiële diensten	J.P. Morgan	USD	1.200.500	29.354	9 mei 2023	29.354
Long kopen	Gediversifieerde financiële diensten	Morgan Stanley	EUR	1.101.830	(16.571)	15 mei 2023	(16.571)
Long kopen	Gediversifieerde financiële diensten	Morgan Stanley	USD	180.066	3.621	15 mei 2023	3.621
Long kopen	Elektrisch	Goldman Sachs	EUR	12.676	42	24 mei 2023	42
Long kopen	Elektrisch	Goldman Sachs	USD	495.006	4.980	24 mei 2023	4.980
Long kopen	Elektrisch	J.P. Morgan	EUR	24.082	1.395	22 feb 2023	1.395
Long kopen	Elektrisch	J.P. Morgan	USD	582.784	60.900	9 mei 2023	60.900
Long kopen	Elektrisch	Morgan Stanley	USD	453.610	13.341	15 mei 2023	13.341
Long kopen	Elektrische onderdelen en uitrusting	Goldman Sachs	USD	288.683	11.124	25 mei 2023	11.124
Long kopen	Elektrische onderdelen en uitrusting	J.P. Morgan	EUR	287.588	17.870	22 jun 2022	17.870
Long kopen	Elektrische onderdelen en uitrusting	Morgan Stanley	USD	93.238	(4.770)	15 mei 2023	(4.770)
Long kopen	Elektronica	Goldman Sachs	USD	567.077	16.615	24 mei 2023	16.615
Long kopen	Elektronica	Goldman Sachs	USD	8.749	38	25 mei 2023	38
Long kopen	Elektronica	J.P. Morgan	USD	596.495	56.496	22 jun 2021	56.496
Long kopen	Elektronica	J.P. Morgan	USD	8.804	(736)	9 mei 2023	(736)
Long kopen	Elektronica	Morgan Stanley	USD	486.748	13.454	15 mei 2023	13.454
Long kopen	Energie - Alternatieve bronnen	Goldman Sachs	USD	165.103	4.096	25 mei 2023	4.096
Long kopen	Energie - Alternatieve bronnen	J.P. Morgan	NOK	167.237	10.795	9 mei 2023	10.795
Long kopen	Energie - Alternatieve bronnen	Morgan Stanley	NOK	57.951	1.364	15 mei 2023	1.364
Long kopen	Bouw en techniek	Goldman Sachs	EUR	46.714	1.952	24 mei 2023	1.952
Long kopen	Bouw en techniek	Goldman Sachs	JPY	5.156	(221)	1 jul 2021	(221)
Long kopen	Bouw en techniek	Goldman Sachs	USD	602.125	52.753	24 mei 2023	52.753

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Total Return Swaps (vervolg)

Bescher- mingspositie	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal Bedrag	Marktwaaarde	Verval- datum	Niet-gerealiseerde waardevermeer- dering/ (-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)							
Long kopen	Bouw en techniek	J.P. Morgan	EUR	22.412	2.973	9 mei 2023	2.973
Long kopen	Bouw en techniek	Morgan Stanley	EUR	91.200	9.006	15 mei 2023	9.006
Long kopen	Amusement	Goldman Sachs	USD	242.270	(35.097)	24 mei 2023	(35.097)
Long kopen	Amusement	Morgan Stanley	USD	5.304	(268)	15 mei 2023	(268)
Long kopen	Gas	Morgan Stanley	EUR	274.338	(2.652)	15 mei 2023	(2.652)
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	Goldman Sachs	EUR	675.321	6.714	24 mei 2023	6.714
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	Goldman Sachs	GBP	82.229	844	7 feb 2023	844
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	Goldman Sachs	GBP	22.557	232	24 mei 2023	232
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	Goldman Sachs	HKD	3.928	78	24 mei 2023	78
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	Goldman Sachs	USD	7.712.521	(28.898)	24 mei 2023	7.714
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	Goldman Sachs	USD	183.311	5.063	25 mei 2023	5.063
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	J.P. Morgan	EUR	6.413	507	9 mei 2023	507
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	J.P. Morgan	GBP	86.789	1.698	22 feb 2023	1.698
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	J.P. Morgan	USD	2.431.811	115.846	22 jun 2021	65.241
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	J.P. Morgan	USD	2.311.759	(32.015)	9 mei 2023	(32.015)
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	Morgan Stanley	CHF	136.292	14.699	15 mei 2023	14.699
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	Morgan Stanley	EUR	32.424	1.083	15 mei 2023	1.083
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	Morgan Stanley	GBP	672.527	(7.797)	15 mei 2023	(7.797)
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	Morgan Stanley	HKD	210.246	13.126	15 mei 2023	13.126
Long kopen	Gezondheidszorg - producten	Morgan Stanley	USD	1.174.962	(18.887)	15 mei 2023	(18.887)
Long kopen	Gezondheidszorg - Diensten	Goldman Sachs	USD	6.558.561	108.195	24 mei 2023	108.195
Long kopen	Gezondheidszorg - Diensten	J.P. Morgan	USD	620.268	44.621	22 jun 2021	44.621
Long kopen	Gezondheidszorg - Diensten	J.P. Morgan	USD	2.530.166	163.629	9 mei 2023	163.629
Long kopen	Gezondheidszorg - Diensten	Morgan Stanley	USD	2.402.087	59.063	15 mei 2023	59.063
Long kopen	Holdingmaatschappijen – Gediversifieerd	Goldman Sachs	USD	441.952	1.633	24 mei 2023	1.633
Long kopen	Holdingmaatschappijen – Gediversifieerd	J.P. Morgan	USD	107.302	(2.824)	9 mei 2023	(2.824)
Long kopen	Holdingmaatschappijen – Gediversifieerd	Morgan Stanley	USD	995.159	4.448	15 mei 2023	4.448
Long kopen	Woningbouw	Goldman Sachs	JPY	4.745	(264)	1 mrt 2023	(264)
Long kopen	Woningbouw	Goldman Sachs	USD	588.217	(12.266)	24 mei 2023	(12.266)
Long kopen	Woningbouw	J.P. Morgan	JPY	655	29	9 mei 2023	29
Long kopen	Woningbouw	J.P. Morgan	USD	224.997	15.245	9 mei 2023	15.245
Long kopen	Woningbouw	Morgan Stanley	USD	227.466	28.241	15 mei 2023	28.241
Long kopen	Verzekeringen	Goldman Sachs	CAD	399.183	7.114	25 mei 2023	7.114
Long kopen	Verzekeringen	Goldman Sachs	GBP	183.725	3.295	24 mei 2023	3.295
Long kopen	Verzekeringen	Goldman Sachs	GBP	313.421	2.770	9 mrt 2026	2.770
Long kopen	Verzekeringen	Goldman Sachs	USD	4.969.944	(107.016)	24 mei 2023	(107.016)
Long kopen	Verzekeringen	J.P. Morgan	USD	326.930	17.978	9 mei 2023	17.978
Long kopen	Verzekeringen	Morgan Stanley	GBP	148.745	(1.165)	15 mei 2023	(1.165)
Long kopen	Verzekeringen	Morgan Stanley	USD	360.122	8.836	15 mei 2023	8.836
Long kopen	Internet	Goldman Sachs	USD	281.299	(51.349)	24 mei 2023	(51.349)
Long kopen	Internet	J.P. Morgan	USD	111.145	(1.831)	22 jun 2021	(1.831)
Long kopen	Internet	J.P. Morgan	USD	421.806	(16.671)	9 mei 2023	(16.671)
Long kopen	Internet	Morgan Stanley	HKD	113.220	(3.242)	15 mei 2023	(3.242)
Long kopen	Internet	Morgan Stanley	USD	1.612.847	(24.304)	15 mei 2023	(24.304)
Long kopen	Ijzer/staal	Goldman Sachs	JPY	601.512	(22.488)	17 jan 2023	(22.488)
Long kopen	Ijzer/staal	Goldman Sachs	JPY	12.874	(294)	9 mrt 2026	(294)
Long kopen	Ijzer/staal	Goldman Sachs	USD	566.838	(37.337)	25 mei 2023	(37.337)
Long kopen	Ijzer/staal	J.P. Morgan	HKD	121.168	(929)	9 mei 2023	(929)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Total Return Swaps (vervolg)

Beschermingspositie	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal Bedrag	Marktwaaarde	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)							
Long kopen	Ijzer/staal	J.P. Morgan	JPY	5.156	620	23 mrt 2023	620
Long kopen	Ijzer/staal	J.P. Morgan	USD	18.587	154	9 mei 2023	154
Long kopen	Ijzer/staal	Morgan Stanley	JPY	712.941	3.177	15 mei 2023	3.177
Long kopen	Ijzer/staal	Morgan Stanley	USD	610.635	(56.612)	15 mei 2023	(56.612)
Long kopen	Vrije tijd	Goldman Sachs	USD	349.005	(3.088)	24 mei 2023	(3.088)
Long kopen	Logies	Goldman Sachs	GBP	320.844	9.345	31 mrt 2023	9.345
Long kopen	Logies	Goldman Sachs	USD	358.044	(26.119)	6 jan 2023	(26.119)
Long kopen	Machines - Bouw & Mijnbouw	Goldman Sachs	EUR	119.003	4.694	24 mei 2023	4.694
Long kopen	Machines - Bouw & Mijnbouw	J.P. Morgan	USD	251.189	26.023	9 mei 2023	26.023
Long kopen	Machines - gediversifieerd	Goldman Sachs	USD	958.900	6.525	24 mei 2023	6.525
Long kopen	Machines - gediversifieerd	Goldman Sachs	USD	724.466	525	22 aug 2023	525
Long kopen	Machines - gediversifieerd	J.P. Morgan	USD	91.754	(519)	9 mei 2023	(519)
Long kopen	Machines - gediversifieerd	Morgan Stanley	USD	444.639	(14.383)	15 mei 2023	(14.383)
Long kopen	Media	J.P. Morgan	USD	517.327	36.569	22 jun 2021	36.569
Long kopen	Media	Morgan Stanley	USD	283.668	(18.539)	27 dec 2021	(18.539)
Long kopen	Metaalfabrikaten/hardware	Goldman Sachs	USD	230.252	(5.256)	24 mei 2023	(5.256)
Long kopen	Mijnbouw	Goldman Sachs	GBP	317.569	5.452	24 mei 2023	5.452
Long kopen	Mijnbouw	Goldman Sachs	USD	90.573	(2.506)	24 mei 2023	(2.506)
Long kopen	Mijnbouw	J.P. Morgan	GBP	546.519	(5.630)	22 feb 2023	(5.630)
Long kopen	Mijnbouw	J.P. Morgan	NOK	486.633	57.033	9 mei 2023	57.033
Long kopen	Mijnbouw	J.P. Morgan	ZAR	101.933	(11.753)	9 mei 2023	(11.753)
Long kopen	Mijnbouw	Morgan Stanley	USD	328.090	(15.376)	15 mei 2023	(15.376)
Long kopen	Gemengde productie	Goldman Sachs	USD	166.092	4.909	24 mei 2023	4.909
Long kopen	Gemengde productie	J.P. Morgan	SEK	660.809	(14.416)	22 mrt 2023	(14.416)
Long kopen	Olie en gas	Goldman Sachs	CAD	351.373	(686)	25 mei 2023	(686)
Long kopen	Olie en gas	Goldman Sachs	EUR	510.694	139.035	16 dec 2022	139.035
Long kopen	Olie en gas	Goldman Sachs	GBP	376.836	(15.447)	24 mei 2023	(15.447)
Long kopen	Olie en gas	Goldman Sachs	USD	600.108	(18.998)	24 mei 2023	(18.998)
Long kopen	Olie en gas	J.P. Morgan	CAD	537.055	(57.939)	9 mei 2023	(57.939)
Long kopen	Olie en gas	J.P. Morgan	EUR	154.597	(7.824)	22 feb 2023	(7.824)
Long kopen	Olie en gas	J.P. Morgan	GBP	131.109	(11.375)	9 mei 2023	(11.375)
Long kopen	Olie en gas	J.P. Morgan	JPY	7.679	152	9 mei 2023	152
Long kopen	Olie en gas	J.P. Morgan	USD	2.187.848	(178.046)	9 mei 2023	(178.046)
Long kopen	Olie en gas	Morgan Stanley	USD	2.021.066	(237.153)	15 mei 2023	(237.153)
Long kopen	Olie- en gasdiensten	Morgan Stanley	USD	129.117	(13.914)	15 mei 2023	(13.914)
Long kopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	CHF	1.520.596	14.447	24 mei 2023	14.447
Long kopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	EUR	974.476	(12.274)	24 mei 2023	(12.274)
Long kopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	GBP	2.406.244	(26.400)	24 mei 2023	(26.400)
Long kopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	JPY	4.167.822	(42.773)	24 mei 2023	(42.773)
Long kopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	USD	344.124	2.199	12 aug 2022	2.199
Long kopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	USD	3.456.410	(48.580)	24 mei 2023	(48.580)
Long kopen	Farmaceutische producten	J.P. Morgan	CHF	11.258	562	9 mei 2023	562
Long kopen	Farmaceutische producten	J.P. Morgan	EUR	130.906	(4.715)	9 mei 2023	(4.715)
Long kopen	Farmaceutische producten	J.P. Morgan	GBP	8.815	333	9 mei 2023	333
Long kopen	Farmaceutische producten	J.P. Morgan	HUF	447.931	44.814	9 mei 2023	44.814
Long kopen	Farmaceutische producten	J.P. Morgan	USD	1.017.240	(77.653)	22 jun 2021	(77.653)
Long kopen	Farmaceutische producten	J.P. Morgan	USD	5.459.505	160.603	9 mei 2023	160.603
Long kopen	Farmaceutische producten	Morgan Stanley	CHF	696.778	20.189	15 mei 2023	20.189

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Total Return Swaps (vervolg)

Beschermingspositie	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal Bedrag	Marktwaaarde	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)							
Long kopen	Farmaceutische producten	Morgan Stanley	EUR	172.460	3.395	15 mei 2023	3.395
Long kopen	Farmaceutische producten	Morgan Stanley	GBP	693.036	20.298	15 mei 2023	20.298
Long kopen	Farmaceutische producten	Morgan Stanley	HKD	341.340	(5.904)	15 mei 2023	(5.904)
Long kopen	Farmaceutische producten	Morgan Stanley	JPY	873.243	4.049	15 mei 2023	4.049
Long kopen	Farmaceutische producten	Morgan Stanley	USD	2.697.656	(31.449)	15 mei 2023	(31.449)
Long kopen	Pijpleidingen	J.P. Morgan	USD	2.032.317	(65.173)	9 mei 2023	(65.173)
Long kopen	Pijpleidingen	Morgan Stanley	USD	1.445.438	(97.483)	15 mei 2023	(97.483)
Long kopen	Private equity	Goldman Sachs	GBP	1.044.937	(21.112)	24 jan 2023	(21.112)
Long kopen	Private equity	J.P. Morgan	USD	450.275	26.568	9 mei 2023	26.568
Long kopen	Private equity	Morgan Stanley	GBP	120.126	(3.760)	15 mei 2023	(3.760)
Long kopen	Onroerend goed	Morgan Stanley	USD	2.807	(100)	15 mei 2023	(100)
Long kopen	REIT's	Goldman Sachs	USD	596.418	(3.344)	24 mei 2023	(3.344)
Long kopen	REIT's	J.P. Morgan	USD	429.367	809	9 mei 2023	809
Long kopen	Detailhandel	Goldman Sachs	JPY	383.640	4.281	17 jan 2023	4.281
Long kopen	Detailhandel	Goldman Sachs	USD	1.157.280	(21.570)	24 mei 2023	(21.570)
Long kopen	Detailhandel	J.P. Morgan	USD	49.549	2.710	9 mei 2023	2.710
Long kopen	Detailhandel	Morgan Stanley	USD	168.199	(12.815)	15 mei 2023	(12.815)
Long kopen	Spaar- en leenbanken	Goldman Sachs	USD	309.084	(23.094)	24 mei 2023	(23.094)
Long kopen	Halfgeleiders	Goldman Sachs	EUR	851.402	12.078	14 feb 2023	12.078
Long kopen	Halfgeleiders	Goldman Sachs	HKD	360.693	(3.780)	7 sep 2022	(3.780)
Long kopen	Halfgeleiders	Goldman Sachs	USD	293.275	3.341	24 mei 2023	3.341
Long kopen	Halfgeleiders	J.P. Morgan	USD	1.287.739	34.702	9 mei 2023	34.702
Long kopen	Halfgeleiders	Morgan Stanley	USD	170.651	9.750	15 mei 2023	9.750
Long kopen	Software	Goldman Sachs	USD	839.174	(3.388)	24 mei 2023	(3.388)
Long kopen	Software	J.P. Morgan	USD	1.000.293	24.269	9 mei 2023	24.269
Long kopen	Software	Morgan Stanley	USD	2.859.460	(126.056)	15 mei 2023	(126.056)
Long kopen	Telecommunicatie	J.P. Morgan	USD	279.655	14.530	9 mei 2023	14.530
Long kopen	Speelgoed, games en hobby's	Goldman Sachs	JPY	3.219	(21)	14 feb 2023	(21)
Long kopen	Transport	Goldman Sachs	GBP	85.497	672	24 mei 2023	672
Long kopen	Transport	Goldman Sachs	USD	407.742	14.910	24 mei 2023	14.910
Long kopen	Transport	Goldman Sachs	USD	96.924	474	25 mei 2023	474
Long kopen	Transport	J.P. Morgan	DKK	27.312	3.409	9 mei 2023	3.409
Long kopen	Transport	Morgan Stanley	DKK	538.333	39.385	15 mei 2023	39.385
Long kopen	Transport	Morgan Stanley	EUR	397.583	22.975	15 mei 2023	22.975
Long kopen	Diversen*	Morgan Stanley	USD	28.169.884	130.507	27 mrt 2023	130.507
Short verkopen	Autofabrikanten	Goldman Sachs	HKD	37.804	347	13 jan 2023	347
Short verkopen	Autofabrikanten	Goldman Sachs	USD	431.419	42.291	24 mei 2023	42.291
Short verkopen	Autofabrikanten	Goldman Sachs	USD	689.546	(49.853)	28 feb 2024	(49.853)
Short verkopen	Autofabrikanten	J.P. Morgan	HKD	144.430	2.952	9 mei 2023	2.952
Short verkopen	Autofabrikanten	J.P. Morgan	USD	322.619	41.337	9 mei 2023	41.337
Short verkopen	Autofabrikanten	Morgan Stanley	USD	343.966	43.755	15 mei 2023	43.755
Short verkopen	Auto-onderdelen en -uitrusting	J.P. Morgan	USD	100.159	5.683	9 mei 2023	5.683
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	AUD	923.980	(6.681)	24 mei 2023	(6.681)
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	CHF	675.418	102.728	24 mei 2023	102.728
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	DKK	1.048.460	(10.400)	24 mei 2023	(10.400)
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	EUR	3.490.372	(83.921)	24 mei 2023	(83.921)
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	EUR	727.650	(763)	31 jan 2024	(763)
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	HKD	432.631	18.391	30 jan 2023	18.391

* Contract wordt gehouden op een korf van verschillende Amerikaanse aandelen.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Total Return Swaps (vervolg)

Beschermingspositie	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal Bedrag	Marktwaaarde	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)							
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	HKD	325.818	(216)	24 mei 2023	(216)
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	JPY	729.150	41.217	1 mrt 2023	41.217
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	NOK	291.398	1.988	6 jan 2023	1.988
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	PLN	290.611	(2.120)	19 jan 2023	(2.120)
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	PLN	256.723	3.465	24 mei 2023	3.465
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	SEK	1.514.405	29.396	24 mei 2023	29.396
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	USD	801.322	6.243	6 jan 2023	6.243
Short verkopen	Banken	Goldman Sachs	USD	8.958.984	40.445	24 mei 2023	40.445
Short verkopen	Banken	J.P. Morgan	AUD	131.792	(3.999)	9 mei 2023	(3.999)
Short verkopen	Banken	J.P. Morgan	EUR	835.068	(40.545)	9 mei 2023	(40.545)
Short verkopen	Banken	J.P. Morgan	HKD	33.615	331	9 mei 2023	331
Short verkopen	Banken	J.P. Morgan	JPY	221.481	9.688	9 mei 2023	9.688
Short verkopen	Banken	J.P. Morgan	NOK	4.784	(32)	22 jun 2022	(32)
Short verkopen	Banken	J.P. Morgan	USD	2.832.953	(4.009)	22 jun 2021	(4.009)
Short verkopen	Banken	J.P. Morgan	USD	1.797.833	(1.462)	9 mei 2023	(1.462)
Short verkopen	Banken	Morgan Stanley	AUD	8.581	(95)	15 mei 2023	(95)
Short verkopen	Banken	Morgan Stanley	EUR	288.547	(10.853)	15 mei 2023	(10.853)
Short verkopen	Banken	Morgan Stanley	HKD	83.808	1.041	15 mei 2023	1.041
Short verkopen	Banken	Morgan Stanley	JPY	287.654	10.889	15 mei 2023	10.889
Short verkopen	Banken	Morgan Stanley	MXN	529.542	20.774	17 sep 2030	20.774
Short verkopen	Banken	Morgan Stanley	NOK	105.787	1.840	15 mei 2023	1.840
Short verkopen	Banken	Morgan Stanley	USD	1.783.551	2.315	15 mei 2023	2.315
Short verkopen	Dranken	Goldman Sachs	GBP	274.187	2.914	18 jan 2023	2.914
Short verkopen	Dranken	J.P. Morgan	GBP	149.331	12.622	7 mei 2023	12.622
Short verkopen	Dranken	J.P. Morgan	HKD	3.396	(127)	22 jun 2022	(127)
Short verkopen	Dranken	Morgan Stanley	HKD	3.987	(314)	15 mei 2023	(314)
Short verkopen	Biotechnologie	Goldman Sachs	CHF	236.220	11.045	24 mei 2023	11.045
Short verkopen	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	352.845	(10.474)	24 mei 2023	(10.474)
Short verkopen	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	4.061.268	61.282	24 mei 2023	61.282
Short verkopen	Biotechnologie	J.P. Morgan	CHF	23.306	(333)	22 feb 2023	(333)
Short verkopen	Biotechnologie	J.P. Morgan	HKD	207.677	(18.574)	9 mei 2023	(18.574)
Short verkopen	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1.060.307	(6.068)	22 jun 2021	(6.068)
Short verkopen	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	5.735.283	(17.801)	9 mei 2023	(17.801)
Short verkopen	Biotechnologie	Morgan Stanley	CHF	413.111	15.071	15 mei 2023	15.071
Short verkopen	Biotechnologie	Morgan Stanley	HKD	234.531	(5.085)	15 mei 2023	(5.085)
Short verkopen	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	1.417.286	22.236	15 mei 2023	22.236
Short verkopen	Chemische producten	Goldman Sachs	EUR	57.840	(523)	27 mrt 2023	(523)
Short verkopen	Chemische producten	Goldman Sachs	EUR	64.581	(1.322)	24 mei 2023	(1.322)
Short verkopen	Chemische producten	Goldman Sachs	USD	-	(970)	19 apr 2021	(970)
Short verkopen	Chemische producten	Goldman Sachs	USD	90.962	1.699	24 mei 2023	1.699
Short verkopen	Chemische producten	Morgan Stanley	EUR	305.318	(3.766)	15 mei 2023	(3.766)
Short verkopen	Commerciële diensten	Goldman Sachs	EUR	107.756	(2.556)	24 mei 2023	(2.556)
Short verkopen	Commerciële diensten	Goldman Sachs	GBP	99.053	(2.023)	14 dec 2022	(2.023)
Short verkopen	Commerciële diensten	Goldman Sachs	USD	633.612	29.200	24 mei 2023	31.737
Short verkopen	Commerciële diensten	J.P. Morgan	EUR	180.687	(8.816)	22 feb 2023	(8.816)
Short verkopen	Commerciële diensten	J.P. Morgan	GBP	190.004	(10.162)	22 jun 2022	(10.162)
Short verkopen	Commerciële diensten	Morgan Stanley	EUR	216.091	(502)	15 mei 2023	(502)
Short verkopen	Computers	Goldman Sachs	USD	328.072	(6.810)	14 jun 2023	(6.810)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Total Return Swaps (vervolg)

Beschermingspositie	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal Bedrag	Marktwaaarde	Verval-datum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)							
Short verkopen	Computers	J.P. Morgan	USD	94.529	(5.374)	9 mei 2023	(5.374)
Short verkopen	Computers	Morgan Stanley	USD	1.191.643	31.141	15 mei 2023	31.141
Short verkopen	Financieringsfonds	Goldman Sachs	USD	379.939	(1.110)	5 mei 2022	(1.110)
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	Goldman Sachs	EUR	366.412	6.149	24 mei 2023	6.149
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	Goldman Sachs	GBP	1.782.035	(922)	18 jan 2023	(922)
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	Goldman Sachs	GBP	349.258	5.103	24 jan 2023	5.103
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	Goldman Sachs	GBP	657.312	24.250	24 mei 2023	24.250
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	Goldman Sachs	USD	1.439.327	12.514	24 mei 2023	12.514
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	Goldman Sachs	USD	357.891	3.425	27 sep 2023	3.425
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	J.P. Morgan	EUR	239.177	(24.672)	9 mei 2023	(24.672)
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	J.P. Morgan	GBP	270.064	29.870	9 mei 2023	29.870
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	J.P. Morgan	USD	918.987	20.488	9 mei 2023	20.488
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	Morgan Stanley	EUR	159.503	(6.397)	15 mei 2023	(6.397)
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	Morgan Stanley	GBP	663.195	31.666	15 mei 2023	31.666
Short verkopen	Gediversifieerde financiële diensten	Morgan Stanley	USD	72.682	58	15 mei 2023	58
Short verkopen	Elektrisch	Goldman Sachs	DKK	93.494	(3.624)	4 apr 2024	(3.624)
Short verkopen	Elektrisch	Goldman Sachs	HKD	3.281	71	24 mei 2023	71
Short verkopen	Elektrisch	J.P. Morgan	HKD	40.116	(2.304)	9 mei 2023	(2.304)
Short verkopen	Elektrisch	J.P. Morgan	USD	1.128.229	(94.803)	9 mei 2023	(94.803)
Short verkopen	Elektrisch	Morgan Stanley	HKD	104.524	(674)	15 mei 2023	(674)
Short verkopen	Elektrisch	Morgan Stanley	USD	3.942	94	15 mei 2023	94
Short verkopen	Elektrische onderdelen en uitrusting	Goldman Sachs	USD	244.448	(33.018)	28 feb 2024	(33.018)
Short verkopen	Elektrische onderdelen en uitrusting	J.P. Morgan	USD	157.312	(44.571)	9 mei 2023	(44.571)
Short verkopen	Elektronica	Goldman Sachs	HKD	219.905	18.266	24 mei 2023	18.266
Short verkopen	Elektronica	Goldman Sachs	JPY	746.617	(17.796)	24 mei 2023	(17.796)
Short verkopen	Elektronica	J.P. Morgan	JPY	329.424	(11.297)	22 aug 2022	(11.297)
Short verkopen	Elektronica	J.P. Morgan	USD	1.359.377	(90.458)	22 jun 2021	(90.458)
Short verkopen	Elektronica	Morgan Stanley	JPY	283.434	(13.515)	15 mei 2023	(13.515)
Short verkopen	Energie - Alternatieve bronnen	Goldman Sachs	USD	705.179	12.031	24 mei 2023	12.031
Short verkopen	Energie - Alternatieve bronnen	J.P. Morgan	NOK	97.758	(5.113)	22 feb 2023	(5.113)
Short verkopen	Energie - Alternatieve bronnen	J.P. Morgan	SEK	162.111	4.906	9 mei 2023	4.906
Short verkopen	Energie - Alternatieve bronnen	J.P. Morgan	USD	105.125	(13.586)	9 mei 2023	(14.637)
Short verkopen	Energie - Alternatieve bronnen	Morgan Stanley	SEK	4.568	324	15 mei 2023	324
Short verkopen	Energie - Alternatieve bronnen	Morgan Stanley	USD	153.189	(15.393)	15 mei 2023	(15.393)
Short verkopen	Bouw en techniek	Goldman Sachs	CHF	188.062	(2.668)	24 mei 2023	(2.668)
Short verkopen	Bouw en techniek	Goldman Sachs	EUR	375.566	(15.737)	6 jun 2023	(15.737)
Short verkopen	Bouw en techniek	Goldman Sachs	NZD	4.476	(171)	24 mei 2023	(171)
Short verkopen	Bouw en techniek	J.P. Morgan	NZD	168.391	(16.148)	9 mei 2023	(16.148)
Short verkopen	Bouw en techniek	Morgan Stanley	MXN	4.372	142	15 mei 2023	142
Short verkopen	Bouw en techniek	Morgan Stanley	USD	181.968	2.044	15 mei 2023	2.044
Short verkopen	Amusement	J.P. Morgan	EUR	277.319	35.327	22 feb 2023	35.327
Short verkopen	Milieubeheer	Morgan Stanley	NOK	50.080	(131)	15 mei 2023	(131)
Short verkopen	Voeding	Goldman Sachs	EUR	180.041	(2.265)	24 mei 2023	(2.265)
Short verkopen	Voeding	Goldman Sachs	USD	404.487	5.946	24 mei 2023	5.946
Short verkopen	Voeding	J.P. Morgan	EUR	346.163	(2.261)	22 nov 2022	(2.261)
Short verkopen	Voeding	J.P. Morgan	USD	7.796	(477)	22 jun 2021	(477)
Short verkopen	Gas	Morgan Stanley	HKD	46.103	(2.197)	15 mei 2023	(2.197)
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	Goldman Sachs	CHF	669.204	(18.718)	24 mei 2023	(18.718)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Total Return Swaps (vervolg)

Beschermingspositie	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal Bedrag	Marktwaaarde	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)							
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	Goldman Sachs	DKK	416.037	(27.222)	22 feb 2023	(27.222)
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	Goldman Sachs	DKK	93.132	(6.902)	24 mei 2023	(6.902)
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	Goldman Sachs	SEK	853.231	(16.966)	26 apr 2023	(16.966)
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	Goldman Sachs	USD	3.267.118	35.576	24 mei 2023	35.576
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	J.P. Morgan	DKK	530.122	(86.016)	22 feb 2023	(86.016)
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	J.P. Morgan	SEK	396.647	(11.869)	22 feb 2023	(11.869)
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	J.P. Morgan	USD	277.872	(9.498)	22 jun 2021	(9.498)
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	J.P. Morgan	USD	1.498.544	(55.673)	9 mei 2023	(55.673)
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	Morgan Stanley	CHF	266.363	(7.395)	15 mei 2023	(7.395)
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	Morgan Stanley	DKK	318.724	(13.408)	15 mei 2023	(13.408)
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	Morgan Stanley	HKD	226.477	15.734	15 mei 2023	15.734
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	Morgan Stanley	SEK	282.308	13.418	15 mei 2023	13.418
Short verkopen	Gezondheidszorg - producten	Morgan Stanley	USD	726.098	(43.103)	15 mei 2023	(43.103)
Short verkopen	Gezondheidszorg - Diensten	Goldman Sachs	EUR	273.993	(467)	24 mei 2023	(467)
Short verkopen	Gezondheidszorg - Diensten	Goldman Sachs	JPY	282.247	773	24 mei 2023	773
Short verkopen	Gezondheidszorg - Diensten	Goldman Sachs	USD	1.627.554	45.509	24 mei 2023	45.509
Short verkopen	Gezondheidszorg - Diensten	J.P. Morgan	EUR	294.260	2.627	22 jun 2022	2.627
Short verkopen	Gezondheidszorg - Diensten	J.P. Morgan	EUR	126.437	(424)	22 feb 2023	(424)
Short verkopen	Gezondheidszorg - Diensten	J.P. Morgan	JPY	98.508	(1.236)	9 mei 2023	(1.236)
Short verkopen	Gezondheidszorg - Diensten	J.P. Morgan	USD	270.921	(5.724)	22 jun 2021	(5.724)
Short verkopen	Gezondheidszorg - Diensten	J.P. Morgan	USD	1.968.115	135	9 mei 2023	135
Short verkopen	Gezondheidszorg - Diensten	Morgan Stanley	EUR	302.148	8.352	15 mei 2023	8.352
Short verkopen	Gezondheidszorg - Diensten	Morgan Stanley	JPY	274.291	(379)	15 mei 2023	(379)
Short verkopen	Holdingmaatschappijen - Gediversifieerd	Goldman Sachs	USD	184.334	(1.773)	24 mei 2023	(1.773)
Short verkopen	Holdingmaatschappijen - Gediversifieerd	J.P. Morgan	USD	440.782	12.086	9 mei 2023	12.086
Short verkopen	Huishoudelijke producten/waren	Goldman Sachs	USD	94.398	(3.172)	24 mei 2023	(3.172)
Short verkopen	Huishoudelijke producten/waren	J.P. Morgan	USD	175.832	(16.251)	22 jun 2021	(16.251)
Short verkopen	Huishoudelijke producten/waren	Morgan Stanley	USD	1.078	(58)	15 mei 2023	(58)
Short verkopen	Index	Goldman Sachs	EUR	1.133.332	(24.928)	24 mei 2023	(24.928)
Short verkopen	Index	Goldman Sachs	HKD	330.849	(2.406)	24 mei 2023	(2.406)
Short verkopen	Index	Goldman Sachs	USD	240.023	(2.382)	4 feb 2022	(2.382)
Short verkopen	Index	Goldman Sachs	USD	3.961.056	(17.396)	24 mei 2023	(17.396)
Short verkopen	Index	Goldman Sachs	USD	1.022.840	5.453	25 mei 2023	5.453
Short verkopen	Index	J.P. Morgan	HKD	31.118	(831)	9 mei 2023	(831)
Short verkopen	Index	J.P. Morgan	USD	3.650.000	140.778	17 mei 2021	140.778
Short verkopen	Index	J.P. Morgan	USD	6.519.479	274.844	9 mei 2023	274.844
Short verkopen	Index	Morgan Stanley	EUR	2.130.718	(17.991)	15 mei 2023	(17.991)
Short verkopen	Index	Morgan Stanley	USD	28.385.305	551.887	15 mei 2023	590.978
Short verkopen	Verzekeringen	Goldman Sachs	DKK	14.376	(310)	24 mei 2023	(310)
Short verkopen	Verzekeringen	Goldman Sachs	EUR	1.071.670	(11.427)	24 mei 2023	(11.427)
Short verkopen	Verzekeringen	Goldman Sachs	GBP	741.287	(19.062)	6 jan 2023	(19.062)
Short verkopen	Verzekeringen	Goldman Sachs	USD	2.595.251	(34.247)	24 mei 2023	(34.247)
Short verkopen	Verzekeringen	J.P. Morgan	AUD	415.546	4.295	22 jun 2022	4.295
Short verkopen	Verzekeringen	J.P. Morgan	EUR	171.291	998	22 feb 2023	998
Short verkopen	Verzekeringen	J.P. Morgan	USD	384.260	12.813	22 jun 2021	12.813
Short verkopen	Verzekeringen	J.P. Morgan	USD	1.204.691	(33.723)	9 mei 2023	(33.723)
Short verkopen	Verzekeringen	Morgan Stanley	DKK	366.673	(11.207)	15 mei 2023	(11.207)
Short verkopen	Verzekeringen	Morgan Stanley	EUR	617.567	10.200	15 mei 2023	10.200

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Total Return Swaps (vervolg)

Beschermingspositie	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal Bedrag	Marktwaaarde	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)							
Short verkopen	Verzekeringen	Morgan Stanley	USD	1.060.593	(17.141)	15 mei 2023	(17.141)
Short verkopen	Internet	Goldman Sachs	GBP	14.677	676	10 jan 2022	676
Short verkopen	Internet	Goldman Sachs	USD	1.503.686	44.398	24 mei 2023	44.398
Short verkopen	Internet	J.P. Morgan	USD	65.225	7.233	9 mei 2023	7.233
Short verkopen	Internet	Morgan Stanley	GBP	118.030	1.789	15 mei 2023	1.789
Short verkopen	Internet	Morgan Stanley	USD	95.651	10.006	27 dec 2021	10.006
Short verkopen	Internet	Morgan Stanley	USD	1.198.946	42.523	15 mei 2023	42.523
Short verkopen	Beleggingsmaatschappijen	Goldman Sachs	USD	906.828	9.361	24 mei 2023	9.361
Short verkopen	Ijzer/staal	J.P. Morgan	AUD	4.729	447	9 mei 2023	447
Short verkopen	Vrije tijd	Morgan Stanley	USD	268.659	715	26 mei 2021	715
Short verkopen	Machines - Bouw & Mijnbouw	Goldman Sachs	USD	241.838	(4.684)	24 mei 2023	(4.684)
Short verkopen	Machines - Bouw & Mijnbouw	J.P. Morgan	USD	101.672	(5.717)	9 mei 2023	(5.717)
Short verkopen	Media	Goldman Sachs	USD	1.006.645	18.540	24 mei 2023	18.540
Short verkopen	Media	J.P. Morgan	USD	85.162	1.534	9 mei 2023	1.534
Short verkopen	Metaalfabrikaten/hardware	Goldman Sachs	USD	282.615	(8.203)	24 mei 2023	(8.203)
Short verkopen	Mijnbouw	J.P. Morgan	USD	325.164	17.663	23 feb 2023	17.663
Short verkopen	Olie en gas	Goldman Sachs	AUD	216.711	6.440	24 mei 2023	6.440
Short verkopen	Olie en gas	Goldman Sachs	AUD	455.234	13.111	14 nov 2025	13.111
Short verkopen	Olie en gas	Goldman Sachs	EUR	326.971	(11.078)	14 nov 2025	(11.078)
Short verkopen	Olie en gas	Goldman Sachs	JPY	82.464	5.113	17 jan 2023	5.113
Short verkopen	Olie en gas	Goldman Sachs	USD	725.270	552	24 mei 2023	552
Short verkopen	Olie en gas	J.P. Morgan	CAD	1.900.586	90.518	9 mei 2023	90.518
Short verkopen	Olie en gas	J.P. Morgan	USD	5.572.233	521.148	9 mei 2023	521.148
Short verkopen	Olie en gas	Morgan Stanley	AUD	384.649	14.074	15 mei 2023	14.074
Short verkopen	Olie en gas	Morgan Stanley	CAD	108.327	15.575	15 mei 2023	15.575
Short verkopen	Olie en gas	Morgan Stanley	USD	801.747	51.861	15 mei 2023	51.861
Short verkopen	Olie- en gasdiensten	Goldman Sachs	USD	252.932	8.026	24 mei 2023	8.026
Short verkopen	Olie- en gasdiensten	J.P. Morgan	USD	167.666	24.043	22 jun 2021	24.043
Short verkopen	Olie- en gasdiensten	J.P. Morgan	USD	9.302	602	22 mrt 2023	602
Short verkopen	Olie- en gasdiensten	J.P. Morgan	USD	1.029.279	151.152	9 mei 2023	151.152
Short verkopen	Olie- en gasdiensten	Morgan Stanley	USD	306.626	44.827	15 mei 2023	44.827
Short verkopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	CHF	40.422	(662)	24 mei 2023	(662)
Short verkopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	DKK	624.136	18.702	24 mei 2023	18.702
Short verkopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	EUR	126.133	(2.845)	6 jan 2023	(2.845)
Short verkopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	EUR	1.395.017	(8.713)	24 mei 2023	(8.713)
Short verkopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	GBP	49.907	660	24 feb 2031	660
Short verkopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	JPY	1.312.190	(6.548)	24 mei 2023	(6.548)
Short verkopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	JPY	76.882	2.233	9 feb 2026	2.233
Short verkopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	USD	2.362.607	19.958	24 mei 2023	19.958
Short verkopen	Farmaceutische producten	Goldman Sachs	USD	49.677	(1.840)	25 mei 2023	(1.840)
Short verkopen	Farmaceutische producten	J.P. Morgan	CHF	273.596	(27.098)	9 mei 2023	(27.098)
Short verkopen	Farmaceutische producten	J.P. Morgan	EUR	193.433	(23.144)	22 jun 2022	(23.144)
Short verkopen	Farmaceutische producten	J.P. Morgan	GBP	351.480	(9.668)	9 mei 2023	(9.668)
Short verkopen	Farmaceutische producten	J.P. Morgan	HKD	681.165	(13.565)	9 mei 2023	(13.295)
Short verkopen	Farmaceutische producten	J.P. Morgan	JPY	375.597	(25.794)	9 mei 2023	(25.794)
Short verkopen	Farmaceutische producten	J.P. Morgan	USD	3.216.572	(129.538)	9 mei 2023	(129.538)
Short verkopen	Farmaceutische producten	Morgan Stanley	DKK	202.191	7.540	15 mei 2023	7.540
Short verkopen	Farmaceutische producten	Morgan Stanley	EUR	488.591	(10.555)	15 mei 2023	(10.555)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Total Return Swaps (vervolg)

Beschermingspositie	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal Bedrag	Marktwaaarde	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)							
Short verkopen	Farmaceutische producten	Morgan Stanley	JPY	229.506	(2.553)	1 apr 2021	(2.553)
Short verkopen	Farmaceutische producten	Morgan Stanley	JPY	2.082.739	(103.221)	15 mei 2023	(103.221)
Short verkopen	Farmaceutische producten	Morgan Stanley	USD	436.653	(55.652)	23 sep 2021	(55.652)
Short verkopen	Farmaceutische producten	Morgan Stanley	USD	1.044.201	120.391	15 mei 2023	120.391
Short verkopen	Pijpleidingen	Goldman Sachs	USD	218.336	339	24 mei 2023	339
Short verkopen	Pijpleidingen	Goldman Sachs	USD	282.778	(15.590)	6 mrt 2026	(15.590)
Short verkopen	Pijpleidingen	J.P. Morgan	USD	727.282	(6.094)	9 mei 2023	(6.094)
Short verkopen	Pijpleidingen	Morgan Stanley	USD	174.878	(3.427)	15 mei 2023	(3.427)
Short verkopen	Private equity	Goldman Sachs	USD	271.875	1.909	24 mei 2023	1.909
Short verkopen	Onroerend goed	Goldman Sachs	HKD	60.746	181	24 mei 2023	181
Short verkopen	Onroerend goed	J.P. Morgan	HKD	15.239	(905)	9 mei 2023	(905)
Short verkopen	Onroerend goed	J.P. Morgan	USD	7.291	473	9 mei 2023	473
Short verkopen	Onroerend goed	Morgan Stanley	HKD	75.874	227	15 mei 2023	227
Short verkopen	REIT's	Goldman Sachs	EUR	50.770	(340)	24 mei 2023	(340)
Short verkopen	REIT's	J.P. Morgan	USD	3.600	(703)	9 mei 2023	(703)
Short verkopen	Detailhandel	Goldman Sachs	EUR	111.739	740	24 mei 2023	740
Short verkopen	Detailhandel	Goldman Sachs	HKD	265.568	4.020	24 mei 2023	4.020
Short verkopen	Detailhandel	Goldman Sachs	JPY	4.184	295	1 mrt 2023	295
Short verkopen	Detailhandel	Goldman Sachs	USD	169.450	(3.943)	24 mei 2023	(3.943)
Short verkopen	Detailhandel	J.P. Morgan	HKD	56.670	3.590	9 mei 2023	3.590
Short verkopen	Detailhandel	J.P. Morgan	USD	1.447.860	(236.198)	22 jun 2021	(236.198)
Short verkopen	Detailhandel	J.P. Morgan	USD	589.532	(28.934)	9 mei 2023	(28.934)
Short verkopen	Detailhandel	Morgan Stanley	JPY	1.998	101	15 mei 2023	101
Short verkopen	Detailhandel	Morgan Stanley	USD	471.559	16.093	15 mei 2023	16.093
Short verkopen	Spaar- en leenbanken	Goldman Sachs	USD	518.994	6.489	24 mei 2023	6.489
Short verkopen	Halfgeleiders	Goldman Sachs	USD	67.237	3.343	24 mei 2023	3.343
Short verkopen	Halfgeleiders	J.P. Morgan	USD	165.172	(2.429)	9 mei 2023	(2.429)
Short verkopen	Halfgeleiders	Morgan Stanley	USD	402.804	(12.122)	15 mei 2023	(12.122)
Short verkopen	Software	Goldman Sachs	CHF	1.315.806	(14.968)	24 mei 2023	(14.968)
Short verkopen	Software	Goldman Sachs	EUR	3.686	(32)	27 dec 2023	(32)
Short verkopen	Software	Goldman Sachs	GBP	128.636	10.387	24 mei 2023	10.387
Short verkopen	Software	Goldman Sachs	USD	483.226	16.597	24 mei 2023	23.936
Short verkopen	Software	J.P. Morgan	CHF	79.053	(3.642)	9 mei 2023	(3.642)
Short verkopen	Software	J.P. Morgan	USD	1.158.076	(45.977)	9 mei 2023	(45.977)
Short verkopen	Software	Morgan Stanley	CHF	511.066	(21.496)	15 mei 2023	(21.496)
Short verkopen	Software	Morgan Stanley	EUR	424.084	(7.168)	15 mei 2023	(7.168)
Short verkopen	Software	Morgan Stanley	USD	109.934	68.160	31 mrt 2021	68.160
Short verkopen	Software	Morgan Stanley	USD	1.056.063	73.024	15 mei 2023	73.024
Short verkopen	Telecommunicatie	J.P. Morgan	JPY	174.615	(3.000)	22 jun 2022	(3.000)
Short verkopen	Telecommunicatie	J.P. Morgan	USD	379.862	(15.616)	9 mei 2023	(15.616)
Short verkopen	Telecommunicatie	Morgan Stanley	USD	195.589	(8.968)	27 dec 2021	(8.968)
USD							533.487

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Contracts for Differences (CFD's)

Contracts for differences worden gewaardeerd op basis van de slotkoers van het onderliggende effect, omgerekend naar de basisvaluta van het contract for differences, min enige financieringskosten die aan elk contract kunnen worden toegerekend en die afzonderlijk worden geboekt. Bij het aangaan van CFD's kan het Fonds verplicht zijn een bedrag in contanten en/of andere activa, dat gelijk is aan een bepaald percentage van de contractwaarde ('initial margin'), bij de broker in onderpand te geven. Later worden betalingen periodiek door het Fonds gedaan of ontvangen, bekend als 'variation margins', afhankelijk van de schommelingen in de waarde van het onderliggende effect. Gerealiseerde winsten of verliezen bij de sluiting van het contract stemmen overeen met het verschil tussen de waarde van het contract for differences op het tijdstip waarop het werd geopend (inclusief enige financiële wijzigingen) en de waarde op het tijdstip waarop het werd gesloten. Dividenden (na aftrek van bronbelastingen) toe te rekenen aan CFD's worden beschouwd als te ontvangen dividenden aan het einde van de periode. De resultaten van deze herwaarderingen worden weergegeven in het Overzicht van Netto Activa onder 'netto ongerealiseerde winsten/(verliezen) op CFD's'.

Per 31 maart 2021 hadden de volgende subfondsen CFD's op financiële indices en futurescontracten uitstaan:

Contract	Tegenpartij	Hoeveelheid	Marktwarde	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD op Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Credit Suisse	270	206.493	29.883
CFD op Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Credit Suisse	1.411	213.305	1.672
CFD op Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Credit Suisse	167	111.242	(979)
CFD op Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Credit Suisse	315	443.886	40.339
CFD op Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Credit Suisse	688	446.194	40.026
CFD op Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Credit Suisse	432	326.336	3.637
CFD op Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Credit Suisse	897	764.214	24.910
CFD op Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Credit Suisse	419	435.371	4.976
CFD op Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Index	Credit Suisse	438	352.991	19.770
CFD op Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Credit Suisse	1.128	414.620	31.787
CFD op Stoxx Europe 600 Media Price Index	Credit Suisse	824	301.613	18.321
CFD op Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Credit Suisse	1.111	339.137	(504)
CFD op Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Credit Suisse	544	618.772	43.808
CFD op Stoxx Europe 600 Retail Price Index	Credit Suisse	664	327.081	18.237
CFD op Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Credit Suisse	449	355.758	17.908
CFD op Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Credit Suisse	1.312	353.920	20.794
CFD op Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Credit Suisse	559	174.505	11.197
CFD op Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Credit Suisse	311	139.202	4.945
CFD op S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	448	600.730	14.644
CFD op S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	1.707	1.193.982	41.958
CFD op S&P 500 Energy Sector Index	Goldman Sachs	1.200	443.864	(8.167)
CFD op S&P 500 Financials Sector Index	Goldman Sachs	868	491.047	26.111
CFD op S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	743	1.010.736	36.462
CFD op S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	891	741.291	60.077
CFD op S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	244	568.779	6.533
CFD op S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	1.260	623.337	42.338
CFD op S&P 500 Utilities Sector Index	Goldman Sachs	3.502	1.139.045	45.966
			USD 13.137.451	596.649
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
CFD op Argentijnse aandelen	Morgan Stanley	(28.245)	167.068	167.068
CFD op Australische aandelen	Morgan Stanley	(146.764)	298.525	298.525
CFD op Britse aandelen	Goldman Sachs	(997.400)	122.570	122.570
CFD op Britse aandelen	Morgan Stanley	(1.289.220)	(217.167)	(217.167)
CFD op Franse aandelen	Goldman Sachs	163.120	(627.998)	(627.998)
CFD op Duitse aandelen	Morgan Stanley	717.851	1.085.317	1.092.343
CFD op Israëliische aandelen	Goldman Sachs	(79.749)	430.993	430.993
CFD op Japanse aandelen	Goldman Sachs	(471.486)	577.166	577.166
CFD op Japanse aandelen	Morgan Stanley	246.000	(517.197)	(517.197)
CFD op Noorse aandelen	Morgan Stanley	745.708	167.522	167.522
CFD op Zwitserse aandelen	Goldman Sachs	(86.697)	(312.140)	(312.140)
CFD op Amerikaanse aandelen	Goldman Sachs	(1.415.305)	12.989.676	12.990.614
CFD op Amerikaanse aandelen	Morgan Stanley	(2.619.055)	(1.918.129)	(1.799.583)
			USD 12.246.206	12.372.716

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Contracts for Differences (vervolg)

Contract	Tegenpartij	Hoeveelheid	Marktwaaarde	Niet-gerealiseerde waardevermeerde- ring/(-vermindering)
Schroder GAIA Helix				
CFD op Argentijnse aandelen	Goldman Sachs	934	(16.187)	(16.192)
CFD op Argentijnse aandelen	J.P. Morgan	4.613	21.008	21.008
CFD op Australische aandelen	Goldman Sachs	2.049.501	(249.012)	(249.012)
CFD op Australische aandelen	J.P. Morgan	615.551	103.883	103.883
CFD op Oostenrijkse aandelen	Goldman Sachs	36.995	(46.189)	(46.189)
CFD op Oostenrijkse aandelen	J.P. Morgan	552	(1.730)	(1.730)
CFD op Belgische aandelen	Goldman Sachs	75.007	122.359	122.359
CFD op Belgische aandelen	J.P. Morgan	84.408	21.384	21.384
CFD on Braziliaanse aandelen	Goldman Sachs	17.153	34.293	34.293
CFD on Braziliaanse aandelen	J.P. Morgan	38.144	35.231	35.231
CFD op Britse aandelen	Goldman Sachs	18.310.050	237.114	532.139
CFD op Britse aandelen	J.P. Morgan	1.446.091	301.513	301.513
CFD op Canadese aandelen	Goldman Sachs	2.698.050	(309.091)	(309.091)
CFD op Canadese aandelen	J.P. Morgan	284.147	(13.053)	(13.053)
CFD op Chileense aandelen	J.P. Morgan	5.931	(6.132)	(6.132)
CFD op Chinese aandelen	Goldman Sachs	19.755.101	(4.291.033)	(4.323.166)
CFD op Chinese aandelen	J.P. Morgan	6.005.161	(1.528.373)	(1.528.373)
CFD op Deense aandelen	Goldman Sachs	(16.942)	(10.706)	(10.712)
CFD op Deense aandelen	J.P. Morgan	4.354	367.324	367.324
CFD op Nederlandse aandelen	Goldman Sachs	488.104	624.396	624.394
CFD op Nederlandse aandelen	J.P. Morgan	180.871	782.307	782.307
CFD op Finse aandelen	Goldman Sachs	74.867	(142.007)	(142.007)
CFD op Finse aandelen	J.P. Morgan	73.278	(55.789)	(55.789)
CFD op Franse aandelen	Goldman Sachs	253.682	533.482	534.031
CFD op Franse aandelen	J.P. Morgan	249.489	151.055	151.055
CFD op Duitse aandelen	Goldman Sachs	262.138	1.159.623	1.159.943
CFD op Duitse aandelen	J.P. Morgan	173.190	124.472	124.472
CFD op Hongkongse aandelen	Goldman Sachs	3.094.467	(73.241)	(73.241)
CFD op Hongkongse aandelen	J.P. Morgan	2.062.400	(330.408)	(330.408)
CFD op Indiase aandelen	Goldman Sachs	87.582	(51.731)	(51.731)
CFD op Indiase aandelen	J.P. Morgan	68.161	(7.498)	(7.498)
CFD op Ierse aandelen	Goldman Sachs	265.373	136.179	136.179
CFD op Ierse aandelen	J.P. Morgan	27.167	51.644	51.644
CFD op Italiaanse aandelen	Goldman Sachs	82.000	25.842	25.842
CFD op Italiaanse aandelen	J.P. Morgan	192.590	16.057	16.057
CFD op Japanse aandelen	Goldman Sachs	3.362.680	1.329.390	1.334.406
CFD op Japanse aandelen	J.P. Morgan	5.907.291	(2.259.120)	(2.259.120)
CFD op Jersey aandelen	Goldman Sachs	5.515	(1.026)	(1.026)
CFD op Koeweitse aandelen	J.P. Morgan	(477.067)	39.632	39.632
CFD op Luxemburgse aandelen	Goldman Sachs	31.187	141.537	141.537
CFD op Luxemburgse aandelen	J.P. Morgan	71.071	85.599	85.599
CFD op Macause aandelen	Goldman Sachs	670.800	(29.329)	(29.329)
CFD op Macause aandelen	J.P. Morgan	104.000	(85.618)	(85.618)
CFD op Mexicaanse aandelen	J.P. Morgan	48.592	124.881	124.881
CFD op Nieuw-Zeelandse aandelen	Goldman Sachs	55.836	21.058	21.058
CFD op Nieuw-Zeelandse aandelen	J.P. Morgan	(169.616)	53.956	53.956
CFD op Noorse aandelen	Goldman Sachs	157.179	84.161	84.155
CFD op Noorse aandelen	J.P. Morgan	156.620	(15.217)	(15.217)
CFD on Filipijnse aandelen	Goldman Sachs	(165.360)	30.474	30.474

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Contracts for Differences (vervolg)

Contract	Tegenpartij	Hoeveelheid	Marktwaaarde	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Helix (vervolg)				
CFD op Poolse aandelen	Goldman Sachs	(86.354)	291.932	291.932
CFD op Portugese aandelen	Goldman Sachs	(48.811)	(80.137)	(80.137)
CFD op Portugese aandelen	J.P. Morgan	1.031.417	(6.669)	(6.669)
CFD op Russische aandelen	Goldman Sachs	4.078.134	276.940	277.369
CFD op Russische aandelen	J.P. Morgan	(20.847)	52.743	52.743
CFD op Saoedi-Arabisch aandelen	Goldman Sachs	(85.360)	(44.171)	(44.171)
CFD op Saoedi-Arabisch aandelen	J.P. Morgan	10.981	84.297	84.297
CFD op Singaporese aandelen	Goldman Sachs	1.313.899	180.530	180.564
CFD op Singaporese aandelen	J.P. Morgan	886.800	(4.271)	(4.271)
CFD op Zuid-Afrikaanse aandelen	Goldman Sachs	(16.411)	27.252	27.252
CFD op Zuid-Afrikaanse aandelen	J.P. Morgan	57.929	(16.261)	(16.261)
CFD op Spaanse aandelen	Goldman Sachs	(108.388)	(79.997)	(79.966)
CFD op Spaanse aandelen	J.P. Morgan	(193.482)	(170.279)	(170.279)
CFD op Zweedse aandelen	Goldman Sachs	631.110	117.075	117.280
CFD op Zweedse aandelen	J.P. Morgan	581.161	315.796	315.796
CFD op Zwitserse aandelen	Goldman Sachs	69.821	36.595	36.595
CFD op Zwitserse aandelen	J.P. Morgan	274.504	(8.549)	(8.549)
CFD op Taiwanese aandelen	Goldman Sachs	(12.324)	(52.371)	(52.522)
CFD op Taiwanese aandelen	J.P. Morgan	(213.830)	56.291	56.291
CFD op aandelen van de Verenigde Arabische Emiraten	Goldman Sachs	(100.115)	(1.932)	(1.932)
CFD op aandelen van de Verenigde Arabische Emiraten	J.P. Morgan	125.984	(18.410)	(18.410)
CFD op Amerikaanse aandelen	Goldman Sachs	999.632	476.149	471.913
CFD op Amerikaanse aandelen	J.P. Morgan	653.432	357.356	357.356
CFD op FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(332)	(29.306)	(29.306)
CFD op MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(25.281)	2.506.724	2.506.724
CFD op MSCI EM Europe 10/40 Index	Goldman Sachs	(799)	470.329	(35.044)
			USD	1.975.020
				1.734.717
Schroder GAIA M&A*				
CFD op Australische aandelen	Goldman Sachs	74.041	4.590	4.590
CFD op Britse aandelen	Goldman Sachs	(1.020)	(4.676)	(3.994)
CFD op Canadese aandelen	Goldman Sachs	184.944	(21.059)	(21.059)
CFD op Canadese aandelen	J.P. Morgan	17.626	1.823	1.823
CFD op Chinese aandelen	Goldman Sachs	787.000	2.414	2.414
CFD op Franse aandelen	Goldman Sachs	24	1.949	1.949
CFD op Duitse aandelen	Goldman Sachs	187	(885)	(885)
CFD op Duitse aandelen	J.P. Morgan	(370)	651	651
CFD op Hongkongse aandelen	Goldman Sachs	24.041	1.202	1.202
CFD op Ierse aandelen	Goldman Sachs	18.242	(535)	(535)
CFD op Japanse aandelen	Goldman Sachs	2.500	3.274	3.274
CFD op Zweedse aandelen	Goldman Sachs	(2.203)	(3.217)	(3.217)
CFD op Amerikaanse aandelen	Goldman Sachs	13.352	29.960	29.960
			USD	15.491
				16.173
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
CFD op Britse aandelen	Morgan Stanley	6.342.493	74.998	74.998
CFD op aandelen van de Verenigde Arabische Emiraten	Morgan Stanley	(112.989)	(1.582)	(1.582)
CFD op Amerikaanse aandelen	Morgan Stanley	(20.805)	15.500	15.500
CFD op FTSE 250 Index	Bank of America	(316)	(20.436)	(20.436)
CFD on ML Custom Index	Bank of America	(17.684)	7.493	6.424
			GBP	75.973
				74.904

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Credit default index swaps

Een credit default index swap maakt het mogelijk om het debiteurenrisico over te dragen. Hierdoor kan een Fonds effectief een verzekering kopen op een gehouden referentie-indexobligatie (afdekking van de belegging), of bescherming kopen op een referentie-indexobligatie die het Fonds niet fysiek in bezit heeft, in de verwachting dat het krediet in kwaliteit zal afnemen. Eén partij, de koper van de bescherming, verricht een reeks betalingen aan de verkoper van de bescherming, en er is aan de koper een betaling verschuldigd wanneer er een kredietgebeurtenis plaatsvindt (een daling in de kredietkwaliteit, die vooraf wordt vastgelegd in de overeenkomst tussen de partijen). Als de kredietgebeurtenis niet plaatsvindt, dan betaalt de koper alle vereiste premies en wordt de swap op de eindvervaldatum beëindigd zonder verdere betalingen. Het risico van de koper wordt daarom beperkt tot de waarde van de betaalde premies. Als er daarnaast een kredietgebeurtenis plaatsvindt en het Fonds de onderliggende benchmarkobligatie niet houdt, dan kan er een marktrisico bestaan aangezien het Fonds mogelijk tijd nodig heeft om de benchmarkobligatie te verwerven en aan de tegenpartij te leveren. Als de tegenpartij bovendien insolvent wordt, dan kan het Fonds het volledige door de tegenpartij verschuldigde bedrag wellicht niet terugkrijgen. De markt voor credit default index swaps kan soms minder liquide zijn dan de obligatiemarkten. De Venootschap zal dit risico beperken door het gebruik van dit type transactie op gepaste wijze te controleren.

Credit default index swaps zijn gewaardeerd tegen hun intrinsieke waarde. De waarderingmethode houdt rekening met de huidige waarde van de rentereeks en de huidige waarde van de kredietspread die op de afsluitingsdatum op de markt wordt verhandeld. Het resultaat van deze herwaarderingen en enige te ontvangen/te betalen rente in verband met credit default swaps worden in het Overzicht van het nettovermogen weergegeven onder 'Netto niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering) op credit default index swaps'.

Op 31 maart 2021 bestonden er voor de volgende subfondsen credit default index swaps op financiële indexen:

Beschermingspositie	Beschrijving	Tegenpartij	Valuta	Nominaal bedrag	(Betaalde)/ontvangen rente %	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA BlueTrend							
Verkopen	CDX iTraxx Europe Crossover Series 35 20/06/2026	J.P. Morgan	EUR	8.000.000	2,00	20 jun 2026	988.465
Verkopen	CDX iTraxx Europe Series 35 20/06/2026	J.P. Morgan	EUR	41.000.000	3,00	20 jun 2026	1.069.416
Verkopen	CDX North America High Yield Series 35 20/12/2025	J.P. Morgan	USD	13.946.330	4,00	20 dec 2025	830.888
Verkopen	CDX North America High Yield Series 36 20/06/2026	J.P. Morgan	USD	4.946.330	4,00	20 jun 2026	6.668
Verkopen	CDX North America Investment Grade Series 36 20/06/2026	J.P. Morgan	USD	49.000.000	3,00	20 jun 2026	867.463
USD							3.762.900
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Verkopen	CDX iTraxx Europe Series 35 20/06/2026	Citi Bank	EUR	54.000.000	1,00	20 jun 2026	(64.540)
Verkopen	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 35 20/06/2026	Citi Bank	EUR	10.000.000	1,00	20 jun 2026	(20.674)
Verkopen	CDX North America High Yield Series 36 20/06/2026	Citi Bank	USD	20.000.000	5,00	20 jun 2026	74.968
Verkopen	CDX North America Investment Grade Series 36 20/06/2026	Citi Bank	USD	70.000.000	1,00	20 jun 2026	(137.817)
USD							(148.063)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkopen	CDX North America High Yield Series 32 20/06/2024	Morgan Stanley	USD	2.670.000	1,00	20 jun 2024	(29.623)
Verkopen	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 34 20/12/2025	Morgan Stanley	EUR	13.890.000	1,00	20 dec 2025	(21.765)
Verkopen	CDX Emerging Markets Series 35 20/06/2026	Morgan Stanley	USD	7.628.000	1,00	20 jun 2026	10.371
Verkopen	CDX iTraxx Europe Crossover Series 35 20/06/2026	Morgan Stanley	EUR	6.720.000	1,00	20 jun 2026	(53.629)
Verkopen	CDX iTraxx Europe Series 35 20/06/2026	Morgan Stanley	EUR	6.675.000	1,00	20 jun 2026	(12.328)
Verkopen	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 35 20/06/2026	Morgan Stanley	EUR	13.455.000	1,00	20 jun 2026	(29.016)
Verkopen	CDX North America High Yield Series 36 20/06/2026	Morgan Stanley	USD	7.775.000	1,00	20 jun 2026	(35.891)
Verkopen	CDX North America Investment Grade Series 36 20/06/2026	Morgan Stanley	USD	63.050.000	1,00	20 jun 2026	(122.350)
USD							(294.231)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Credit default swaps

Een credit default swap maakt het mogelijk om het debiteurenrisico over te dragen. Daardoor kan het Fonds effectief een verzekering kopen op een gehouden referentieobligatie (afdekking van de belegging), of bescherming kopen op een referentieobligatie die het Fonds niet fysiek in bezit heeft, in de verwachting dat het krediet in kwaliteit zal afnemen. Eén partij, de koper van de bescherming, verricht een reeks betalingen aan de verkoper van de bescherming, en er is aan de koper een betaling verschuldigd wanneer er een kredietgebeurtenis plaatsvindt (een daling in de kredietkwaliteit, die vooraf wordt vastgelegd in de overeenkomst tussen de partijen). Als de kredietgebeurtenis niet plaatsvindt, dan betaalt de koper alle vereiste premies en wordt de swap op de eindvervaldatum beëindigd zonder verdere betalingen. Het risico van de koper wordt daarom beperkt tot de waarde van de betaalde premies. Als er daarnaast een kredietgebeurtenis plaatsvindt en het subfonds houdt de onderliggende referentieobligatie niet, dan kan er een marktrisico bestaan aangezien het subfonds mogelijk tijd nodig heeft om de referentieobligatie te verwerven en aan de tegenpartij te leveren. Als de tegenpartij bovendien insolvent wordt, dan kan het subfonds het volledige door de tegenpartij verschuldigde bedrag wellicht niet terugkrijgen. De markt voor credit default swaps kan soms minder liquide zijn dan de obligatiemarkten. De Venootschap zal dit risico beperken door het gebruik van dit type transactie op gepaste wijze te controleren.

Credit default swaps zijn tegen hun intrinsieke waarde gewaardeerd. De waarderingmethode houdt rekening met de huidige waarde van de rentereeks en de huidige waarde van de kredietspread die op de afsluitingsdatum op de markt wordt verhandeld. Het resultaat van deze herwaarderingen en enige te ontvangen/te betalen rente in verband met credit default swaps worden in het Overzicht van het nettovermogen weergegeven onder 'Netto niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering) op credit default swaps'.

Per 31 maart 2021 was het volgende subfonds gebonden door uitstaande credit default swap-overeenkomsten:

Beschermingspositie	Risicoland	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkopen	Australië	Mijnbouw	Morgan Stanley	EUR	600.000	20 jun 2026	8.368
Verkopen	Oostenrijk	Telecommunicatie	Morgan Stanley	EUR	4.175.000	20 jun 2026	(1.415)
Verkopen	Brazil	Overheid	Morgan Stanley	USD	545.000	20 jun 2025	3.129
Verkopen	Brazil	Overheid	Morgan Stanley	USD	596.000	20 dec 2025	(1.174)
Verkopen	Brazil	Overheid	Morgan Stanley	USD	2.380.000	20 jun 2026	3.567
Verkopen	Chili	Overheid	Morgan Stanley	USD	1.103.000	20 jun 2026	291
Verkopen	China	Overheid	Morgan Stanley	USD	978.000	20 dec 2025	1.443
Verkopen	China	Overheid	Morgan Stanley	USD	600.000	20 jun 2026	405
Verkopen	Colombia	Overheid	Morgan Stanley	USD	1.500.000	20 dec 2025	(2.479)
Verkopen	Colombia	Overheid	Morgan Stanley	USD	1.775.000	20 jun 2026	1.697
Verkopen	Frankrijk	Reclame	Morgan Stanley	EUR	1.225.000	20 jun 2026	(5.990)
Kopen	Frankrijk	Commerciële diensten	J.P. Morgan	EUR	300.000	20 dec 2022	(1.927)
Verkopen	Frankrijk	Commerciële diensten	Credit Suisse	EUR	300.000	20 dec 2025	9.054
Verkopen	Frankrijk	Elektrisch	Morgan Stanley	EUR	2.625.000	20 jun 2026	(10.199)
Verkopen	Frankrijk	Bouw en techniek	Morgan Stanley	EUR	2.925.000	20 jun 2026	(1.141)
Verkopen	Frankrijk	Logies	Morgan Stanley	EUR	2.230.000	20 jun 2026	(14.974)
Kopen	Frankrijk	Media	Morgan Stanley	EUR	1.470.000	20 jun 2026	15.470
Kopen	Frankrijk	Media	Credit Suisse	EUR	735.000	20 jun 2026	(586)
Verkopen	Frankrijk	Telecommunicatie	Credit Suisse	EUR	325.000	20 dec 2025	(3.134)
Verkopen	Duitsland	Banken	Morgan Stanley	EUR	1.550.000	20 jun 2026	1.242
Verkopen	Duitsland	Vrije tijd	Morgan Stanley	EUR	725.000	20 dec 2025	(24.137)
Verkopen	Indonesië	Overheid	Morgan Stanley	USD	1.140.000	20 dec 2025	2.500
Kopen	Italië	Banken	Barclays Bank	EUR	1.100.000	20 jun 2026	(2.100)
Verkopen	Luxemburg	Ijzer/staal	Morgan Stanley	EUR	1.075.000	20 jun 2026	(4.077)
Kopen	Luxemburg	Media	Barclays Bank	EUR	525.000	20 dec 2024	26.639
Kopen	Maleisië	Overheid	Citi Bank	USD	550.000	20 jun 2026	50
Verkopen	Mexico	Overheid	Morgan Stanley	USD	730.000	20 dec 2024	(5.628)
Verkopen	Mexico	Overheid	Morgan Stanley	USD	574.000	20 dec 2025	(376)
Verkopen	Mexico	Overheid	Morgan Stanley	USD	11.984.210	20 jun 2026	2.547
Verkopen	Nederland	Media	J.P. Morgan	EUR	300.000	20 dec 2025	(3.104)
Verkopen	Nederland	Telecommunicatie	Morgan Stanley	EUR	1.125.000	20 jun 2026	(11.827)
Verkopen	Peru	Overheid	Morgan Stanley	USD	1.077.000	20 jun 2025	3.955
Verkopen	Peru	Overheid	Morgan Stanley	USD	1.744.000	20 dec 2025	(13.164)
Verkopen	Filipijnen	Overheid	Morgan Stanley	USD	1.555.000	20 dec 2025	(4.331)
Verkopen	Russische Federatie	Overheid	Morgan Stanley	USD	522.000	20 dec 2025	4.569
Verkopen	Russische Federatie	Overheid	Morgan Stanley	USD	1.071.000	20 jun 2026	322
Verkopen	Saoedi-Arabië	Overheid	Morgan Stanley	USD	2.155.000	20 dec 2025	7.296

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Credit default swaps (vervolg)

Beschermingspositie	Risicoland	Sector	Tegenpartij	Valuta	Nominaal bedrag	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)							
Verkopen	Zuid-Afrika	Mijnbouw	Morgan Stanley	EUR	900.000	20 jun 2026	6.482
Verkopen	Zuid-Afrika	Overheid	Morgan Stanley	USD	1.189.000	20 jun 2025	44.924
Verkopen	Zuid-Afrika	Overheid	Morgan Stanley	USD	1.105.000	20 dec 2025	(238)
Verkopen	Zuid-Afrika	Overheid	Morgan Stanley	USD	2.080.000	20 jun 2026	(950)
Verkopen	Zuid-Korea	Overheid	Morgan Stanley	USD	2.855.000	20 dec 2024	5.524
Verkopen	Zuid-Korea	Overheid	Morgan Stanley	USD	551.000	20 dec 2025	(547)
Verkopen	Zwitserland	Bouwmaterialen	Morgan Stanley	EUR	1.750.000	20 dec 2025	402
Verkopen	Turkije	Overheid	Morgan Stanley	USD	585.000	20 dec 2025	8.423
Kopen	Turkije	Overheid	Goldman Sachs	USD	490.000	20 jun 2026	7.589
Verkopen	Verenigd Koninkrijk	Autofabrikanten	Morgan Stanley	EUR	950.000	20 jun 2023	(86.018)
Verkopen	Verenigd Koninkrijk	Autofabrikanten	Morgan Stanley	EUR	410.000	20 dec 2025	(44.436)
Verkopen	Verenigd Koninkrijk	Banken	Morgan Stanley	EUR	5.400.000	20 jun 2026	6.316
Kopen	Verenigd Koninkrijk	Commerciële diensten	Barclays Bank	EUR	175.000	20 jun 2026	746
Verkopen	Verenigd Koninkrijk	Amusement	Morgan Stanley	EUR	350.000	20 dec 2025	6.083
Verkopen	Verenigd Koninkrijk	Voeding	Bank of America	EUR	150.000	20 dec 2022	642
Verkopen	Verenigd Koninkrijk	Voeding	BNP Paribas	EUR	175.000	20 dec 2022	748
Verkopen	Verenigd Koninkrijk	Voeding	Morgan Stanley	EUR	460.000	20 dec 2025	6.749
Verkopen	Verenigd Koninkrijk	Voeding	Credit Suisse	EUR	455.000	20 dec 2025	7.917
Verkopen	Verenigd Koninkrijk	Voeding	Morgan Stanley	EUR	750.000	20 jun 2026	842
Verkopen	Verenigd Koninkrijk	Media	Morgan Stanley	EUR	300.000	20 dec 2025	(262)
Verkopen	Verenigd Koninkrijk	Media	Morgan Stanley	EUR	2.020.000	20 jun 2026	(4.913)
Verkopen	Verenigde Staten	Autofabrikanten	Morgan Stanley	EUR	650.000	20 dec 2025	1.192
Verkopen	Verenigde Staten	Autofabrikanten	Morgan Stanley	EUR	1.700.000	20 jun 2026	23.631
Verkopen	Verenigde Staten	Autofabrikanten	Morgan Stanley	USD	825.000	20 jun 2026	(2.062)
Verkopen	Verenigde Staten	Auto-onderdelen en -uitrusting	Morgan Stanley	USD	930.000	20 jun 2026	(7.049)
Kopen	Verenigde Staten	Commerciële diensten	Goldman Sachs	USD	500.000	20 dec 2024	3.874
Verkopen	Verenigde Staten	Voeding	Morgan Stanley	USD	910.000	20 jun 2025	(40.235)
Verkopen	Verenigde Staten	IJzer/staal	Morgan Stanley	USD	995.000	20 dec 2024	(131.674)
Verkopen	Verenigde Staten	Media	Morgan Stanley	USD	1.155.000	20 dec 2024	(24.733)
Verkopen	Verenigde Staten	Verpakking en containers	Bank of America	EUR	300.000	20 dec 2025	(2.985)
Kopen	Verenigde Staten	Onroerend goed	J.P. Morgan	USD	705.000	20 jun 2024	(60.355)
Verkopen	Verenigde Staten	Detailhandel	Morgan Stanley	USD	1.920.000	20 jun 2025	32.529
USD							(261.063)

Cross Currency Swaps

Cross currency swaps zijn gewaardeerd tegen de laatste beschikbare koers op de Berekeningsdag van de IW. De niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering) wordt in het Overzicht van het nettovermogen weergegeven onder 'Netto niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering) op cross currency swaps'. Een cross currency swap is een contract waarbij twee partijen zich er gedurende een bepaalde periode toe verbinden om rentebetalingen in twee verschillende valuta's te ruilen.

Op 31 maart 2021 bestonden er voor het volgende subfonds cross currency swaps:

Tegenpartij	Betalende valuta	Nominale waarde	Ontvangende valuta	Nominale waarde	Verval-	Betalende rente	Ontvangende rente	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa								
Bank of America	RUB	137.842.000	USD	1.866.513	16 jun 2023	4,98%	USD LIBOR 3 months	68.189
Bank of America	RUB	124.950.000	USD	1.797.842	15 jun 2025	5,05%	USD LIBOR 3 months	183.797
Bank of America	RUB	62.814.000	USD	850.562	16 jun 2026	5,50%	USD LIBOR 3 months	32.329

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Cross Currency Swaps (vervolg)

Tegenpartij	Betalende valuta	Nominale waarde	Ontvangende valuta	Nominale waarde	Verval-	Betalende rente	Ontvangende rente	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)								
Bank of America	RUB	194.790.000	USD	2.639.639	16 jun 2026	5,58%	USD LIBOR 3 months	93.296
Bank of America	RUB	5.145.000	USD	70.239	21 jun 2026	4,80%	USD LIBOR 3 months	5.229
Bank of America	USD	1.222.535	MXN	26.040.000	4 jun 2031	USD LIBOR 1 month	MXN TIEE 28 days	76.146
Barclays	RUB	144.254.000	USD	1.981.511	16 jun 2023	5,44%	USD LIBOR 3 months	83.431
Barclays	RUB	111.415.000	USD	1.503.576	16 jun 2026	5,46%	USD LIBOR 3 months	54.530
Barclays	RUB	159.525.000	USD	2.151.673	15 sep 2026	5,99%	USD LIBOR 3 months	34.229
Barclays	TRY	1.655.000	USD	223.001	16 jun 2023	14,22%	USD LIBOR 3 months	44.965
Barclays	TRY	8.749.000	USD	1.453.926	15 jun 2025	10,93%	USD LIBOR 3 months	529.522
BNP Paribas	RUB	58.516.000	USD	779.694	16 jun 2023	4,66%	USD LIBOR 3 months	20.796
BNP Paribas	RUB	236.655.000	USD	3.193.294	16 jun 2026	5,46%	USD LIBOR 3 months	115.721
Citibank	RUB	152.382.000	USD	2.028.514	16 jun 2023	4,60%	USD LIBOR 3 months	54.284
Credit Suisse	TRY	6.990.000	USD	885.932	16 jun 2023	20,75%	USD LIBOR 3 months	55.312
Credit Suisse	TRY	6.110.000	USD	778.344	16 jun 2023	26,00%	USD LIBOR 3 months	(2.854)
Goldman Sachs	RUB	58.021.000	USD	778.805	16 jun 2026	5,54%	USD LIBOR 3 months	21.619
Goldman Sachs	RUB	115.845.000	USD	1.591.277	16 jun 2026	5,72%	USD LIBOR 3 months	68.297
J.P. Morgan	RUB	145.198.000	USD	1.926.981	16 jun 2023	4,65%	USD LIBOR 3 months	44.050
J.P. Morgan	RUB	234.636.000	USD	3.191.024	15 sep 2023	5,41%	USD LIBOR 3 months	110.944
J.P. Morgan	RUB	75.162.000	USD	1.071.218	21 dec 2025	4,09%	USD LIBOR 3 months	122.270
J.P. Morgan	RUB	114.313.000	USD	1.538.740	15 sep 2026	5,99%	USD LIBOR 3 months	21.316
J.P. Morgan	RUB	70.915.000	USD	947.555	15 sep 2026	6,17%	USD LIBOR 3 months	(806)
J.P. Morgan	TRY	18.722.000	USD	2.534.281	16 jun 2023	15,99%	USD LIBOR 3 months	463.325
J.P. Morgan	TRY	20.114.000	USD	2.651.988	16 jun 2023	16,41%	USD LIBOR 3 months	412.194
J.P. Morgan	TRY	13.529.000	USD	1.818.414	15 sep 2023	15,40%	USD LIBOR 3 months	305.220
J.P. Morgan	TRY	10.191.000	USD	1.244.930	15 sep 2023	22,77%	USD LIBOR 3 months	10.779
J.P. Morgan	TRY	4.005.000	USD	510.516	16 jun 2026	19,10%	USD LIBOR 3 months	34.364
J.P. Morgan	TRY	2.797.000	USD	354.499	16 jun 2026	20,70%	USD LIBOR 3 months	6.533
J.P. Morgan	TRY	19.481.000	USD	2.491.176	21 jun 2026	11,88%	USD LIBOR 3 months	317.532
J.P. Morgan	USD	8.393.683	GBP	6.193.000	16 jun 2026	USD LIBOR 3 months	GBP LIBOR 3 months	130.591
J.P. Morgan	USD	9.713.223	GBP	7.020.000	15 sep 2026	USD LIBOR 3 months	GBP LIBOR 3 months	(40.040)
J.P. Morgan	USD	1.196.416	MXN	26.040.000	4 jun 2031	USD LIBOR 1 month	MXN TIEE 28 days	102.572
Morgan Stanley	RUB	53.995.000	USD	731.640	16 jun 2023	5,02%	USD LIBOR 3 months	26.711
Morgan Stanley	USD	8.209.606	AUD	10.721.000	16 jun 2026	USD LIBOR 3 months	AUD BBR 6 months	(61.011)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Cross Currency Swaps (vervolg)

Tegenpartij	Betalende valuta	Nominale waarde	Ontvangende valuta	Nominale waarde	Verval-	Betalende rente	Ontvangende rente	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)								
Morgan Stanley	USD	11.419.381	AUD	14.901.000	15 sep 2026	USD LIBOR 3 months	AUD BBR 6 months	(45.792)
Morgan Stanley	USD	8.431.058	CAD	10.777.000	16 jun 2026	USD LIBOR 3 months	CAD BA 3 months	118.415
Morgan Stanley	USD	11.133.793	CAD	14.126.000	15 sep 2026	USD LIBOR 3 months	CAD BA 3 months	104.848
Morgan Stanley	USD	1.304.165	GBP	970.000	16 jun 2026	USD LIBOR 3 months	GBP LIBOR 3 months	32.760
Morgan Stanley	USD	8.520.972	NOK	73.003.000	16 jun 2026	USD LIBOR 3 months	NOK NIBOR 3 months	14.877
Morgan Stanley	USD	11.101.497	NOK	95.202.000	15 sep 2026	USD LIBOR 3 months	NOK NIBOR 3 months	36.968
Morgan Stanley	USD	8.065.078	NZD	11.257.000	16 jun 2026	USD LIBOR 3 months	NZD BBR 3 months	(245.283)
Morgan Stanley	USD	11.466.853	NZD	16.104.000	15 sep 2026	USD LIBOR 3 months	NZD BBR 3 months	(229.230)
Morgan Stanley	USD	8.183.036	SEK	67.508.000	16 jun 2026	USD LIBOR 3 months	SEK STIBOR 3 months	(465.764)
Morgan Stanley	USD	11.678.470	SEK	100.182.000	15 sep 2026	USD LIBOR 3 months	SEK STIBOR 3 months	(202.662)
USD								2.664.519

Renteswaps

Om renteschommelingen af te dekken, kan de Vennootschap renteswaps aangaan, op voorwaarde dat:

- De verbintenissen die daaruit voortvloeien niet meer bedragen dan de waarde van de betreffende activa die moeten worden afgedekt; en
- Het totaalbedrag van dergelijke transacties het benodigde niveau om het risico op schommelingen van de waarde van de betreffende effecten af te dekken, niet overschrijdt.

Dergelijke contracten moeten luiden in de valuta's waarin de activa van dat Fonds luiden, of in valuta's waarvan het waarschijnlijk is dat ze op een vergelijkbare wijze schommelen, en ze moeten ofwel genoteerd zijn aan een beurs ofwel worden verhandeld op een Gereguleerde Markt.

Renteswaps zijn gewaardeerd tegen de laatst beschikbare koers op de Berekeningsdag van de IW tegen hun intrinsieke waarde. De waarderingmethode houdt rekening met de huidige waarde van elke rente- en kapitaalreeks omgerekend naar de valuta van het Fonds op de afsluitingsdatum. Het resultaat van deze herwaarderingen en enige te ontvangen/te betalen rente in verband met renteswaps wordt in het Overzicht van het nettovermogen weergegeven onder 'Netto niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering) op renteswaps'.

Op 31 maart 2021 bestonden er voor de volgende subfondsen swapovereenkomsten op rentevoeten:

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA BlueTrend					
Ontvangst vaste rente 6,79%					
Betaling vlottende rente BRL CDI 1 day	J.P. Morgan	40.000.000	BRL	2 jan 2024	(237.454)
Betaling vaste rente 7,09%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	J.P. Morgan	40.000.000	BRL	2 jan 2024	165.659
Betaling vaste rente 1,72%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	J.P. Morgan	500.000	USD	16 jun 2046	48.442
Betaling vaste rente 6,54%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	J.P. Morgan	77.402.588	BRL	2 jan 2023	130.631
Ontvangst vaste rente 6,33%					
Betaling vlottende rente BRL CDI 1 day	J.P. Morgan	77.402.588	BRL	2 jan 2023	(159.187)
Ontvangst vaste rente 5,05%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	J.P. Morgan	100.000.000	MXN	10 jun 2026	(245.659)
Betaling vaste rente 1,61%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	J.P. Morgan	500.000	USD	16 jun 2046	59.526
Betaling vaste rente 1,82%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	J.P. Morgan	1.000.000	USD	16 jun 2041	59.337

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA BlueTrend (vervolg)					
Betaling vaste rente 1,91%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	J.P. Morgan	500.000	USD	16 jun 2046	29.447
Betaling vaste rente 5,34%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	J.P. Morgan	100.000.000	MXN	10 jun 2026	183.102
Betaling vaste rente 1,93%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	J.P. Morgan	1.000.000	USD	16 jun 2041	41.867
Betaling vaste rente 2,13%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	J.P. Morgan	500.000	USD	16 jun 2046	7.127
Betaling vaste rente 4,80%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	J.P. Morgan	181.132.075	MXN	14 jun 2023	80.484
Ontvangst vaste rente 4,54%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	J.P. Morgan	181.132.075	MXN	14 jun 2023	(125.296)
Betaling vaste rente 1,50%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	J.P. Morgan	3.492.692	USD	16 jun 2028	1.089
Betaling vaste rente 0,62%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	J.P. Morgan	2.039.606	USD	16 jun 2025	20.274
Ontvangst vaste rente 0,74%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	J.P. Morgan	10.000.000	NZD	16 jun 2023	30.292
Ontvangst vaste rente 0,30%					
Betaling vlottende rente USD LIBOR 3 months	J.P. Morgan	5.039.606	USD	16 jun 2025	(114.062)
Ontvangst vaste rente -0,35%					
Betaling vlottende rente CHF LIBOR 6 months	J.P. Morgan	938.501	CHF	16 jun 2031	(41.126)
Betaling vaste rente 6,32%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	J.P. Morgan	41.525.424	ZAR	16 jun 2026	(15.087)
Ontvangst vaste rente 0,61%					
Betaling vlottende rente USD LIBOR 3 months	J.P. Morgan	1.492.692	USD	16 jun 2028	(90.559)
Betaling vaste rente 1,72%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	J.P. Morgan	2.000.000	NZD	16 jun 2031	39.587
Betaling vaste rente 0,23%					
Ontvangst vlottende rente CHF LIBOR 6 months	J.P. Morgan	3.938.501	CHF	16 jun 2031	(79.075)
Betaling vaste rente 0,45%					
Ontvangst vlottende rente JPY LIBOR 6 months	J.P. Morgan	800.000.000	JPY	16 jun 2041	(12.616)
Betaling vaste rente 0,41%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	J.P. Morgan	2.679.012	USD	16 jun 2023	(4.512)
Betaling vaste rente -0,21%					
Ontvangst vlottende rente CHF LIBOR 6 months	J.P. Morgan	2.000.000	CHF	16 jun 2026	(18.609)
Betaling vaste rente -0,21%					
Ontvangst vlottende rente CHF LIBOR 6 months	J.P. Morgan	4.000.000	CHF	16 jun 2026	(37.218)
Ontvangst vaste rente 5,14%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	J.P. Morgan	41.525.424	ZAR	16 jun 2026	(127.167)
Ontvangst vaste rente 0,12%					
Betaling vlottende rente USD LIBOR 3 months	J.P. Morgan	2.679.012	USD	16 jun 2023	(10.657)
Ontvangst vaste rente 3,78%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	J.P. Morgan	72.222.222	ZAR	16 jun 2023	(80.190)
Betaling vaste rente 4,50%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	J.P. Morgan	72.222.222	ZAR	16 jun 2023	14.125

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA BlueTrend (vervolg)					
Betaling vaste rente 0,54%					
Ontvangst vlottende rente SEK STIBOR 3 months	J.P. Morgan	28.664.807	SEK	16 jun 2026	(29.496)
Betaling vaste rente 0,29%					
Betaling vlottende rente SEK STIBOR 3 months	J.P. Morgan	14.756.443	SEK	16 jun 2031	(87.262)
Ontvangst vaste rente 0,04%					
Betaling vlottende rente SEK STIBOR 3 months	J.P. Morgan	28.664.807	SEK	16 jun 2026	(53.116)
Ontvangst vaste rente -0,13%					
Betaling vlottende rente SEK STIBOR 3 months	J.P. Morgan	71.000.000	SEK	16 jun 2023	(25.455)
Ontvangst vaste rente -0,13%					
Betaling vlottende rente SEK STIBOR 3 months	J.P. Morgan	29.000.000	SEK	16 jun 2023	(10.397)
Betaling vaste rente 0,97%					
Ontvangst vlottende rente SEK STIBOR 3 months	J.P. Morgan	24.756.443	SEK	16 jun 2031	(41.202)
Ontvangst vaste rente -0,63%					
Betaling vlottende rente EUR EURIBOR 6 months	J.P. Morgan	13.108.893	EUR	16 jun 2023	(43.997)
Betaling vaste rente -0,35%					
Ontvangst vlottende rente EUR EURIBOR 6 months	J.P. Morgan	3.108.893	EUR	16 jun 2023	(9.857)
				USD	(788.267)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Betaling vaste rente 9,44%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	J.P. Morgan	1.290.325	BRL	2 jan 2025	(20.357)
Betaling vaste rente 6,71%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	Goldman Sachs	3.571.494	BRL	2 jan 2025	35.109
Betaling vaste rente 1,11%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Goldman Sachs	1.812.875.000	KRW	18 mrt 2031	59.783
Betaling vaste rente 4,80%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	BNP Paribas	7.322.414	BRL	2 jan 2023	14.069
Betaling vaste rente 4,70%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	Goldman Sachs	9.784.783	BRL	2 jan 2023	23.236
Betaling vaste rente 4,98%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	J.P. Morgan	9.187.996	BRL	2 jan 2023	18.806
Betaling vaste rente 2,95%					
Ontvangst vlottende rente CNY REPO RATE 7 days	Morgan Stanley	3.815.000	CNY	16 jun 2026	(4.064)
Ontvangst vaste rente 4,70%					
Betaling vlottende rente INR MIBOR 1 day	Morgan Stanley	167.511.000	INR	16 jun 2026	(44.185)
Ontvangst vaste rente 0,99%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	1.443.000	NZD	16 jun 2031	(96.690)
Ontvangst vaste rente 4,50%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	132.117.000	MXN	15 mrt 2023	(66.254)
Ontvangst vaste rente 0,22%					
Betaling vlottende rente GBP LIBOR 6 months	Morgan Stanley	1.261.000	GBP	15 jun 2023	(5.507)
Betaling vaste rente 4,24%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	295.544.000	MXN	15 jun 2022	74.488
Ontvangst vaste rente 3,57%					
Betaling vlottende rente COP IBR 1 day	Goldman Sachs	4.141.638.000	COP	16 jun 2026	(49.222)
Betaling vaste rente 0,13%					
Ontvangst vlottende rente ILS TELBOR 3 months	Goldman Sachs	14.025.000	ILS	16 jun 2023	10.624

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Ontvangst vaste rente 1,37%					
Betaling vlottende rente CZK PRIBOR 6 months	Morgan Stanley	5.806.000	CZK	17 jun 2031	(7.722)
Ontvangst vaste rente 3,34%					
Betaling vlottende rente COP IBR 1 day	Citi Bank	1.982.841.000	COP	16 jun 2026	(29.179)
Betaling vaste rente 4,35%					
Ontvangst vlottende rente INR MIBOR 1 day	Bank of America	74.119.000	INR	16 jun 2026	34.992
Ontvangst vaste rente 3,26%					
Betaling vlottende rente COP IBR 1 day	Citi Bank	3.484.003.000	COP	16 jun 2026	(54.716)
Betaling vaste rente 5,07%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	BNP Paribas	9.444.681	BRL	2 jan 2023	24.051
Betaling vaste rente 5,07%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	Bank of America	6.513.178	BRL	2 jan 2023	17.018
Betaling vaste rente 6,63%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	J.P. Morgan	5.544.725	BRL	4 jan 2027	90.926
Ontvangst vaste rente 5,02%					
Betaling vlottende rente INR MIBOR 1 day	Goldman Sachs	38.136.000	INR	16 jun 2026	(2.909)
Betaling vaste rente 6,74%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	J.P. Morgan	5.752.072	BRL	4 jan 2027	88.323
Betaling vaste rente 6,72%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	J.P. Morgan	1.893.760	BRL	4 jan 2027	29.463
Betaling vaste rente 2,03%					
Ontvangst vlottende rente MYR KLIBOR 3 months	J.P. Morgan	28.481.000	MYR	16 jun 2023	43.254
Betaling vaste rente 6,89%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	Morgan Stanley	3.680.828	BRL	4 jan 2027	51.009
Ontvangst vaste rente 4,55%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	67.338.000	ZAR	15 jun 2023	(27.159)
Betaling vaste rente 3,85%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	93.516.000	ZAR	16 jun 2022	16.450
Ontvangst vaste rente 5,30%					
Betaling vlottende rente INR MIBOR 1 day	Morgan Stanley	176.605.000	INR	16 jun 2026	16.487
Betaling vaste rente 1,39%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	353.000	NZD	17 mrt 2031	13.044
Betaling vaste rente 0,32%					
Ontvangst vlottende rente SGD SOR 6 months	Morgan Stanley	5.733.000	SGD	16 jun 2023	19.976
Ontvangst vaste rente 1,63%					
Betaling vlottende rente CZK PRIBOR 6 months	Morgan Stanley	23.321.000	CZK	17 jun 2031	(18.606)
Betaling vaste rente 0,91%					
Ontvangst vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	2.165.802.000	HUF	16 jun 2022	23.672
Betaling vaste rente 7,10%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	Morgan Stanley	12.664.953	BRL	4 jan 2027	150.150
Ontvangst vaste rente 2,96%					
Betaling vlottende rente CNY REPO RATE 7 days	J.P. Morgan	8.790.000	CNY	17 mrt 2026	11.501
Betaling vaste rente 7,71%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	Morgan Stanley	11.711.490	BRL	4 jan 2027	67.102
Betaling vaste rente 3,24%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Citi Bank	513.061.000	CLP	16 jun 2031	17.411

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Betaling vaste rente 3,23%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	J.P. Morgan	176.115.000	CLP	16 jun 2031	6.146
Betaling vaste rente 1,96%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	1.680.000	NZD	16 jun 2031	6.927
Betaling vaste rente 1,96%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	1.668.000	NZD	16 jun 2031	7.094
Betaling vaste rente 2,56%					
Ontvangst vlottende rente MYR KLIBOR 3 months	Bank of America	8.006.000	MYR	16 jun 2026	26.238
Ontvangst vaste rente 2,84%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	6.141.000	AUD	17 jun 2031	(19.012)
Ontvangst vaste rente 1,94%					
Betaling vlottende rente ILS TELBOR 3 months	Deutsche Bank	850.000	ILS	17 jun 2031	(1.080)
Betaling vaste rente 8,01%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	Morgan Stanley	11.560.570	BRL	4 jan 2027	30.557
Betaling vaste rente 8,07%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	Morgan Stanley	11.522.847	BRL	4 jan 2027	22.779
Betaling vaste rente 7,75%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	Morgan Stanley	2.818.214	BRL	4 jan 2027	15.540
Betaling vaste rente 5,56%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	Morgan Stanley	8.909.918	BRL	2 jan 2023	14.019
Betaling vaste rente 4,54%					
Ontvangst vlottende rente INR MIBOR 1 day	Morgan Stanley	184.821.000	INR	16 jun 2023	(16.473)
Ontvangst vaste rente 5,57%					
Betaling vlottende rente INR MIBOR 1 day	Morgan Stanley	86.404.000	INR	16 jun 2026	21.952
Betaling vaste rente 4,52%					
Ontvangst vlottende rente INR MIBOR 1 day	Deutsche Bank	121.016.000	INR	16 jun 2023	(10.162)
Ontvangst vaste rente 5,60%					
Betaling vlottende rente INR MIBOR 1 day	Citi Bank	135.348.000	INR	15 sep 2026	23.439
Betaling vaste rente 2,52%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Citi Bank	2.185.240.000	CLP	16 jun 2026	1.607
Ontvangst vaste rente 1,39%					
Betaling vlottende rente INR MIBOR 1 day	Morgan Stanley	67.054.000	INR	16 jun 2023	48.393
Betaling vaste rente 4,90%					
Ontvangst vlottende rente INR MIBOR 1 day	Morgan Stanley	228.477.000	INR	15 sep 2023	(28.216)
Betaling vaste rente 7,74%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	J.P. Morgan	1.332.503	BRL	4 jan 2027	7.828
Ontvangst vaste rente 4,56%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	137.875.000	MXN	14 mrt 2023	(65.357)
Betaling vaste rente 5,43%					
Ontvangst vlottende rente INR MIBOR 1 day	Morgan Stanley	113.505.000	INR	16 jun 2026	(19.379)
Betaling vaste rente 4,63%					
Ontvangst vlottende rente INR MIBOR 1 day	J.P. Morgan	200.450.000	INR	16 jun 2026	61.822
Ontvangst vaste rente 4,47%					
Betaling vlottende rente COP IBR 1 day	Goldman Sachs	4.816.626.000	COP	15 sep 2026	(17.356)
Ontvangst vaste rente 4,47%					
Betaling vlottende rente COP IBR 1 day	J.P. Morgan	3.951.104.000	COP	15 sep 2026	(14.237)
Betaling vaste rente 5,30%					
Ontvangst vlottende rente INR MIBOR 1 day	Morgan Stanley	19.150.000	INR	16 jun 2026	(1.759)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Betaling vaste rente 5,39%					
Ontvangst vlottende rente INR MIBOR 1 day	J.P. Morgan	27.220.000	INR	16 jun 2026	(4.040)
Ontvangst vaste rente 4,34%					
Betaling vlottende rente COP IBR 1 day	Goldman Sachs	9.530.664.000	COP	16 jun 2026	(21.694)
Ontvangst vaste rente 4,57%					
Betaling vlottende rente COP IBR 1 day	Morgan Stanley	4.281.893.000	COP	15 sep 2026	(10.271)
Betaling vaste rente 6,65%					
Ontvangst vlottende rente BRL CDI 1 day	J.P. Morgan	3.085.385	BRL	2 jan 2023	(4.863)
Betaling vaste rente 3,57%					
Ontvangst vlottende rente COP IBR 1 day	J.P. Morgan	5.835.286.000	COP	15 sep 2023	(4.638)
Ontvangst vaste rente 7,21%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	13.215.040	MXN	16 sep 2026	3.115
Ontvangst vaste rente 3,31%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Credit Suisse	830.706.000	CLP	18 mrt 2031	(52.804)
Betaling vaste rente 0,96%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Citi Bank	1.059.594.000	KRW	16 jun 2023	3.361
Betaling vaste rente 0,66%					
Ontvangst vlottende rente GBP LIBOR 6 months	Morgan Stanley	2.576.000	GBP	15 jun 2025	13.808
Ontvangst vaste rente 1,09%					
Betaling vlottende rente CAD BA 3 months	Morgan Stanley	1.844.000	CAD	15 jun 2025	(22.025)
Betaling vaste rente 0,34%					
Ontvangst vlottende rente SEK STIBOR 3 months	Morgan Stanley	11.107.000	SEK	21 sep 2025	1.602
Betaling vaste rente 1,12%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Goldman Sachs	1.514.755.000	KRW	17 sep 2030	49.386
Betaling vaste rente 0,78%					
Ontvangst vlottende rente SEK STIBOR 3 months	Morgan Stanley	28.576.000	SEK	17 dec 2030	46.954
Ontvangst vaste rente 3,48%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Goldman Sachs	1.268.566.000	CLP	17 dec 2030	(68.355)
Ontvangst vaste rente 0,45%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	2.933.000	NZD	21 dec 2025	(58.372)
Betaling vaste rente -0,03%					
Ontvangst vlottende rente EUR EURIBOR 6 months	Morgan Stanley	2.335.000	EUR	17 dec 2030	64.241
Betaling vaste rente 6,73%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	12.042.800	MXN	11 dec 2030	22.231
Betaling vaste rente 1,05%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Goldman Sachs	2.051.546.000	KRW	17 dec 2030	72.450
Betaling vaste rente 1,24%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Goldman Sachs	2.017.758.000	KRW	17 dec 2030	56.265
Betaling vaste rente 1,20%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	J.P. Morgan	168.121.000	KRW	17 dec 2030	4.905
Ontvangst vaste rente 2,77%					
Betaling vlottende rente CNY REPO RATE 7 days	BNP Paribas	62.404.000	CNY	16 dec 2025	1.879
Ontvangst vaste rente 1,16%					
Betaling vlottende rente ILS TELBOR 3 months	Goldman Sachs	3.032.000	ILS	17 dec 2030	(33.234)
Ontvangst vaste rente 0,56%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	2.291.000	AUD	15 mrt 2026	(42.401)
Ontvangst vaste rente 0,94%					
Betaling vlottende rente KRW CD 3 months	Goldman Sachs	4.651.068.000	KRW	16 mrt 2023	(12.979)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Ontvangst vaste rente 0,47%					
Betaling vlottende rente USD LIBOR 3 months	Morgan Stanley	3.047.000	USD	15 mrt 2026	(89.274)
Betaling vaste rente 1,11%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Morgan Stanley	1.354.506.000	KRW	18 mrt 2031	44.932
Ontvangst vaste rente 1,11%					
Betaling vlottende rente ILS TELBOR 3 months	Citi Bank	492.000	ILS	18 mrt 2031	(5.966)
Betaling vaste rente 0,55%					
Ontvangst vlottende rente SEK STIBOR 3 months	Morgan Stanley	1.749.000	SEK	18 mrt 2031	6.766
Betaling vaste rente 0,72%					
Ontvangst vlottende rente GBP LIBOR 6 months	Morgan Stanley	539.000	GBP	18 mrt 2031	26.631
Betaling vaste rente 0,60%					
Ontvangst vlottende rente SEK STIBOR 3 months	Morgan Stanley	15.032.000	SEK	18 mrt 2031	54.118
Ontvangst vaste rente 1,39%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	2.916.000	AUD	18 mrt 2031	(147.505)
Ontvangst vaste rente 0,96%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	424.000	NZD	18 mrt 2031	(25.385)
Betaling vaste rente 6,71%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	5.913.000	MXN	12 mrt 2031	11.441
Betaling vaste rente 7,58%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	76.505.000	ZAR	8 nov 2031	202.270
Ontvangst vaste rente 1,32%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	1.609.000	AUD	18 mrt 2031	(85.161)
Ontvangst vaste rente 4,55%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	51.395.000	MXN	7 nov 2023	(49.800)
Betaling vaste rente 1,33%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Goldman Sachs	1.378.254.000	KRW	18 mrt 2031	33.620
Ontvangst vaste rente 1,57%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	969.000	AUD	18 mrt 2031	(42.857)
Betaling vaste rente 4,56%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	184.140.000	MXN	15 nov 2022	49.865
Ontvangst vaste rente 1,54%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	1.355.000	AUD	18 mrt 2031	(61.349)
Ontvangst vaste rente 1,34%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	5.572.000	NZD	18 mrt 2031	(268.572)
Ontvangst vaste rente 1,48%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	2.214.000	AUD	18 mrt 2031	(104.958)
Betaling vaste rente 1,33%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Goldman Sachs	976.073.000	KRW	18 mrt 2031	23.733
Betaling vaste rente 0,31%					
Ontvangst vlottende rente ILS TELBOR 3 months	Goldman Sachs	14.398.000	ILS	16 jun 2026	93.259
Betaling vaste rente 1,82%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	6.301.000	PLN	18 mrt 2031	48.014
Ontvangst vaste rente 0,83%					
Betaling vlottende rente CZK PRIBOR 6 months	Morgan Stanley	160.394.000	CZK	16 jun 2023	(45.204)
Betaling vaste rente 0,14%					
Ontvangst vlottende rente JPY LIBOR 6 months	Morgan Stanley	74.911.000	JPY	18 mrt 2031	5.134
Ontvangst vaste rente 0,37%					
Betaling vlottende rente SGD SOR 6 months	Morgan Stanley	6.734.000	SGD	15 jun 2023	(16.091)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Ontvangst vaste rente 4,03%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Morgan Stanley	712.123.000	CLP	18 mrt 2031	(17.242)
Ontvangst vaste rente 1,68%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	1.323.000	AUD	18 mrt 2031	(53.862)
Betaling vaste rente -0,44%					
Ontvangst vlottende rente EUR EURIBOR 6 months	Morgan Stanley	2.660.000	EUR	16 jun 2026	26.972
Betaling vaste rente -0,22%					
Ontvangst vlottende rente EUR EURIBOR 6 months	Morgan Stanley	253.000	EUR	16 jun 2031	10.848
Betaling vaste rente -0,03%					
Ontvangst vlottende rente JPY LIBOR 6 months	Morgan Stanley	314.319.000	JPY	21 jun 2026	6.339
Betaling vaste rente 0,19%					
Ontvangst vlottende rente AUD BBR 3 months	Morgan Stanley	7.070.000	AUD	15 jun 2023	6.658
Ontvangst vaste rente 1,09%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	2.655.000	AUD	16 jun 2031	(91.902)
Betaling vaste rente 0,66%					
Ontvangst vlottende rente NOK NIBOR 6 months	Morgan Stanley	49.952.000	NOK	15 jun 2023	30.447
Ontvangst vaste rente 0,59%					
Betaling vlottende rente NOK NIBOR 6 months	Morgan Stanley	32.197.000	NOK	16 jun 2023	(25.935)
Betaling vaste rente 0,94%					
Ontvangst vlottende rente NOK NIBOR 6 months	Morgan Stanley	41.516.000	NOK	16 jun 2026	163
Betaling vaste rente 0,16%					
Ontvangst vlottende rente SEK STIBOR 3 months	Morgan Stanley	37.062.000	SEK	16 jun 2026	33.724
Betaling vaste rente 0,41%					
Ontvangst vlottende rente SEK STIBOR 3 months	Morgan Stanley	6.163.000	SEK	16 jun 2031	29.406
Betaling vaste rente 0,56%					
Ontvangst vlottende rente GBP LIBOR 6 months	Morgan Stanley	1.884.000	GBP	16 jun 2031	76.393
Ontvangst vaste rente 0,72%					
Betaling vlottende rente CAD BA 3 months	Morgan Stanley	5.940.000	CAD	15 jun 2023	(8.881)
Ontvangst vaste rente 0,97%					
Betaling vlottende rente CAD BA 3 months	Morgan Stanley	6.352.000	CAD	16 jun 2026	(152.296)
Betaling vaste rente 0,53%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	Morgan Stanley	4.597.000	USD	16 jun 2026	50.673
Betaling vaste rente 0,32%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	20.007.000	NZD	15 jun 2023	46.954
Ontvangst vaste rente 4,31%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	87.455.000	MXN	16 dec 2021	(4.502)
Betaling vaste rente 5,45%					
Ontvangst vlottende rente RUB MOSPRIME 3 maanden	Morgan Stanley	67.493.000	RUB	16 jun 2023	21.210
Betaling vaste rente 0,26%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 3 months	Morgan Stanley	16.016.000	PLN	16 jun 2022	2.113
Betaling vaste rente 0,64%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	1.313.000	NZD	16 jun 2026	25.082
Betaling vaste rente 0,58%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	3.863.000	NZD	16 jun 2026	81.486
Betaling vaste rente 0,58%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	2.325.000	NZD	16 jun 2026	48.204

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Betaling vaste rente 0,66%					
Ontvangst vlottende rente GBP LIBOR 6 months	Morgan Stanley	5.292.000	GBP	17 jun 2031	113.576
Betaling vaste rente 0,25%					
Ontvangst vlottende rente GBP LIBOR 6 months	Morgan Stanley	7.395.000	GBP	16 jun 2026	239.439
Ontvangst vaste rente 0,22%					
Betaling vlottende rente USD LIBOR 3 months	Morgan Stanley	7.515.000	USD	16 jun 2023	(11.496)
Ontvangst vaste rente 0,45%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	4.174.000	AUD	16 jun 2026	(86.143)
Ontvangst vaste rente 1,18%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Goldman Sachs	3.890.801.000	CLP	15 jun 2023	(64.478)
Ontvangst vaste rente 1,04%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Citi Bank	4.008.043.000	CLP	16 mrt 2023	(63.286)
Ontvangst vaste rente 1,01%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Bank of America	3.890.476.000	CLP	17 mrt 2023	(62.801)
Ontvangst vaste rente 3,79%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Morgan Stanley	4.348.000	CLP	18 mrt 2031	(162)
Ontvangst vaste rente 3,71%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Citi Bank	6.005.000	CLP	18 mrt 2031	(252)
Ontvangst vaste rente 4,40%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	66.925.000	MXN	4 jan 2024	(87.215)
Ontvangst vaste rente 1,77%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	2.275.000	AUD	18 mrt 2031	(85.696)
Ontvangst vaste rente 4,32%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	65.809.810	MXN	15 mrt 2023	(38.266)
Ontvangst vaste rente 4,31%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	132.341.190	MXN	15 mrt 2023	(77.653)
Betaling vaste rente 1,45%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	J.P. Morgan	957.824.000	KRW	18 mrt 2031	18.880
Ontvangst vaste rente 0,22%					
Betaling vlottende rente PLN WIBOR 3 months	Morgan Stanley	10.545.000	PLN	16 mrt 2023	(10.185)
Betaling vaste rente 1,70%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	2.795.000	PLN	18 mrt 2031	25.179
Betaling vaste rente 1,49%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	J.P. Morgan	1.516.016.000	KRW	18 mrt 2031	27.516
Betaling vaste rente 0,93%					
Ontvangst vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	1.790.495.000	HUF	16 jun 2023	71.857
Betaling vaste rente 1,81%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	5.075.000	PLN	17 jun 2031	40.602
Betaling vaste rente 0,98%					
Ontvangst vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	686.068.000	HUF	16 jun 2023	25.771
Betaling vaste rente 0,69%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Bank of America	854.353.000	CLP	16 jun 2022	4.863
Betaling vaste rente 1,20%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	J.P. Morgan	839.682.000	KRW	16 jun 2026	11.974
Betaling vaste rente 0,14%					
Ontvangst vlottende rente ILS TELBOR 3 months	J.P. Morgan	9.649.000	ILS	16 jun 2023	6.878
Ontvangst vaste rente 4,20%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	29.295.000	MXN	17 jan 2022	(3.296)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Betaling vaste rente 0,15%					
Ontvangst vlottende rente ILS TELBOR 3 months	Goldman Sachs	11.919.000	ILS	16 jun 2023	7.892
Betaling vaste rente 4,04%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	99.478.000	ZAR	16 jun 2023	76.708
Betaling vaste rente 0,99%					
Ontvangst vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	722.293.000	HUF	16 jun 2023	26.443
Betaling vaste rente 0,78%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	4.380.000	PLN	16 jun 2026	31.871
Betaling vaste rente 1,01%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Bank of America	851.028.000	CLP	16 jun 2023	17.024
Betaling vaste rente 0,19%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 3 months	Morgan Stanley	53.036.000	PLN	16 jun 2022	17.336
Betaling vaste rente 4,85%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	34.090.000	MXN	10 jun 2026	98.327
Betaling vaste rente 1,20%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Morgan Stanley	1.057.352.000	KRW	16 jun 2026	15.191
Betaling vaste rente 1,51%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Bank of America	780.855.000	KRW	17 jun 2031	13.859
Betaling vaste rente 6,58%					
Ontvangst vlottende rente RUB MOSPRIME 3 maanden	Barclays Bank	33.718.000	RUB	16 jun 2031	27.330
Betaling vaste rente 0,19%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 3 months	Morgan Stanley	11.383.000	PLN	16 jun 2022	3.629
Betaling vaste rente 0,32%					
Ontvangst vlottende rente SGD SOR 6 months	Morgan Stanley	5.230.000	SGD	16 jun 2023	18.417
Betaling vaste rente 0,69%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	491.000	NZD	16 jun 2026	8.599
Betaling vaste rente 1,33%					
Ontvangst vlottende rente NOK NIBOR 6 months	Morgan Stanley	9.082.000	NOK	21 jun 2026	16.792
Betaling vaste rente 5,23%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	10.682.000	ZAR	16 jun 2026	29.999
Betaling vaste rente 5,25%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	10.926.000	ZAR	16 jun 2026	29.971
Betaling vaste rente 1,04%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	2.763.000	PLN	21 jun 2026	17.407
Ontvangst vaste rente 1,81%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	574.000	AUD	17 jun 2031	(21.529)
Betaling vaste rente 1,21%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	J.P. Morgan	649.829.000	KRW	16 jun 2026	9.129
Betaling vaste rente 6,59%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	4.454.000	MXN	11 jun 2031	9.696
Betaling vaste rente 1,55%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Goldman Sachs	680.982.000	KRW	17 jun 2031	11.104
Betaling vaste rente 0,97%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	J.P. Morgan	1.397.404.000	KRW	16 jun 2023	4.311
Betaling vaste rente 5,20%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	3.252.000	ZAR	16 jun 2026	9.374
Betaling vaste rente 1,84%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	11.185.000	PLN	17 jun 2031	85.794

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Ontvangst vaste rente 2,04%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	1.834.000	AUD	17 jun 2031	(54.633)
Ontvangst vaste rente 2,04%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	1.835.000	AUD	17 jun 2031	(54.643)
Ontvangst vaste rente 2,01%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	3.241.000	NZD	17 jun 2031	(92.065)
Ontvangst vaste rente 2,13%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	3.285.000	AUD	17 jun 2031	(87.568)
Betaling vaste rente 6,47%					
Ontvangst vlottende rente RUB MOSPRIME 3 maanden	Barclays Bank	49.189.000	RUB	16 jun 2031	44.925
Betaling vaste rente 1,06%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Morgan Stanley	1.474.953.000	CLP	16 jun 2023	27.414
Betaling vaste rente 1,11%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	J.P. Morgan	1.802.721.000	CLP	16 jun 2023	31.081
Betaling vaste rente 1,94%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	4.183.000	PLN	17 jun 2031	27.443
Betaling vaste rente 0,48%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	8.065.000	PLN	16 jun 2023	4.910
Betaling vaste rente 4,16%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	26.137.000	ZAR	16 jun 2023	16.236
Betaling vaste rente 1,04%					
Ontvangst vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	2.583.268.000	HUF	16 jun 2023	85.949
Betaling vaste rente 1,06%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Morgan Stanley	1.120.326.000	CLP	16 jun 2023	20.646
Betaling vaste rente 4,88%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	12.180.000	MXN	10 jun 2026	34.245
Betaling vaste rente 0,97%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Bank of America	5.522.328.000	KRW	16 jun 2023	16.989
Betaling vaste rente 0,98%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Deutsche Bank	5.522.328.000	KRW	16 jun 2023	16.315
Ontvangst vaste rente 2,11%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	1.511.000	AUD	17 jun 2031	(41.724)
Betaling vaste rente 0,89%					
Ontvangst vlottende rente HUF BUBOR 3 months	Morgan Stanley	2.037.069.000	HUF	16 jun 2022	23.669
Ontvangst vaste rente 4,52%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	115.645.000	ZAR	15 jun 2023	(48.790)
Betaling vaste rente 3,85%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	132.623.000	ZAR	16 jun 2022	23.329
Ontvangst vaste rente 1,94%					
Betaling vlottende rente USD LIBOR 3 months	Morgan Stanley	2.838.000	USD	17 jun 2031	(30.138)
Ontvangst vaste rente 6,67%					
Betaling vlottende rente RUB MOSPRIME 3 months	Barclays Bank	76.885.000	RUB	16 jun 2031	(55.587)
Ontvangst vaste rente 6,66%					
Betaling vlottende rente RUB MOSPRIME 3 months	BNP Paribas	76.885.000	RUB	16 jun 2031	(56.079)
Betaling vaste rente 5,72%					
Ontvangst vlottende rente RUB MOSPRIME 3 maanden	Barclays Bank	287.720.000	RUB	16 jun 2023	71.620
Betaling vaste rente 5,70%					
Ontvangst vlottende rente RUB MOSPRIME 3 maanden	BNP Paribas	287.725.000	RUB	16 jun 2023	73.014

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Betaling vaste rente 5,35%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	21.751.000	ZAR	16 jun 2026	53.128
Betaling vaste rente 1,56%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	402.000	NZD	17 mrt 2031	10.442
Betaling vaste rente 1,14%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	5.957.000	PLN	16 jun 2026	16.720
Betaling vaste rente 0,57%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	12.882.000	PLN	16 jun 2023	1.600
Betaling vaste rente 4,43%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	84.191.000	ZAR	16 jun 2023	23.418
Betaling vaste rente 5,61%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	52.766.000	ZAR	16 jun 2026	89.592
Ontvangst vaste rente 4,12%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	85.695.000	MXN	16 feb 2022	(15.046)
Betaling vaste rente 0,97%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	2.817.000	NZD	16 jun 2026	22.255
Ontvangst vaste rente 1,79%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	1.546.000	NZD	16 jun 2031	(23.133)
Ontvangst vaste rente 1,65%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	2.020.000	NZD	16 jun 2031	(49.623)
Ontvangst vaste rente 0,23%					
Betaling vlottende rente USD LIBOR 3 months	Morgan Stanley	3.600.000	USD	16 jun 2023	(6.157)
Betaling vaste rente 0,78%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	Morgan Stanley	1.200.000	USD	16 jun 2026	19.697
Ontvangst vaste rente 2,39%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	1.230.000	AUD	17 jun 2031	(22.075)
Ontvangst vaste rente 2,39%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	1.995.000	AUD	17 jun 2031	(36.274)
Ontvangst vaste rente 2,39%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	2.640.000	AUD	17 jun 2031	(47.602)
Ontvangst vaste rente 1,65%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	995.000	NZD	16 jun 2031	(24.443)
Betaling vaste rente 0,97%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	1.940.000	NZD	16 jun 2026	15.160
Ontvangst vaste rente 1,65%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	990.000	NZD	16 jun 2031	(24.320)
Betaling vaste rente 1,03%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	1.940.000	NZD	16 jun 2026	11.676
Ontvangst vaste rente 1,69%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	995.000	NZD	16 jun 2031	(21.528)
Betaling vaste rente 5,84%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	24.910.000	ZAR	16 jun 2026	25.662
Ontvangst vaste rente 7,44%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	26.975.000	ZAR	16 jun 2031	(50.629)
Ontvangst vaste rente 2,49%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	1.072.000	AUD	17 jun 2031	(15.696)
Ontvangst vaste rente 1,60%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	4.562.000	AUD	16 jun 2031	(101.484)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Betaling vaste rente 2,15%					
Ontvangst vlottende rente NOK NIBOR 6 months	Morgan Stanley	13.980.000	NOK	17 jun 2031	8.202
Betaling vaste rente 1,81%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Goldman Sachs	3.997.245.000	KRW	17 jun 2031	23.607
Betaling vaste rente 5,39%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	56.169.000	MXN	10 jun 2026	96.000
Ontvangst vaste rente 2,62%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	1.435.000	NZD	17 jun 2031	(13.728)
Ontvangst vaste rente 2,58%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	1.432.000	NZD	17 jun 2031	(15.469)
Betaling vaste rente 2,96%					
Ontvangst vlottende rente CNY REPO RATE 7 days	Citi Bank	16.432.000	CNY	16 jun 2026	(18.961)
Ontvangst vaste rente 1,38%					
Betaling vlottende rente SGD SOR 6 months	Morgan Stanley	1.830.000	SGD	21 jun 2026	(12.638)
Ontvangst vaste rente 1,80%					
Betaling vlottende rente ILS TELBOR 3 months	Citi Bank	2.850.000	ILS	17 jun 2031	(9.118)
Betaling vaste rente 2,06%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	1.125.000	NZD	17 mrt 2031	(7.404)
Betaling vaste rente 1,96%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	Morgan Stanley	500.000	USD	8 feb 2033	11.047
Ontvangst vaste rente 6,35%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	6.505.000	MXN	14 feb 2031	(11.776)
Betaling vaste rente 0,34%					
Ontvangst vlottende rente EUR EURIBOR 6 months	Morgan Stanley	1.397.000	EUR	18 mrt 2031	4.705
Betaling vaste rente 4,61%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	47.430.000	ZAR	16 jun 2023	2.527
Betaling vaste rente 4,67%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	60.535.000	ZAR	16 jun 2023	(1.620)
Ontvangst vaste rente 4,11%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	46.585.000	ZAR	16 jun 2022	(396)
Ontvangst vaste rente 4,16%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	59.185.000	ZAR	16 jun 2022	1.637
Ontvangst vaste rente 5,11%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	56.080.000	ZAR	16 jun 2024	(5.928)
Ontvangst vaste rente 5,20%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	17.955.000	ZAR	16 jun 2024	1.286
Betaling vaste rente 1,96%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	65.000	NZD	16 jun 2031	260
Betaling vaste rente 1,96%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	870.000	NZD	16 jun 2031	3.672
Betaling vaste rente 1,95%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	870.000	NZD	16 jun 2031	3.842
Betaling vaste rente 1,93%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	870.000	NZD	16 jun 2031	5.116
Betaling vaste rente 1,80%					
Ontvangst vlottende rente NOK NIBOR 6 months	Morgan Stanley	43.861.000	NOK	16 jun 2031	29.076
Betaling vaste rente 1,91%					
Ontvangst vlottende rente CAD BA 3 months	Morgan Stanley	1.329.000	CAD	16 jun 2031	20.559

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Betaling vaste rente 1,89%					
Ontvangst vlottende rente CAD BA 3 months	Morgan Stanley	2.690.000	CAD	16 jun 2031	47.977
Betaling vaste rente 1,92%					
Ontvangst vlottende rente CAD BA 3 months	Morgan Stanley	2.710.000	CAD	16 jun 2031	42.305
Ontvangst vaste rente 1,37%					
Betaling vlottende rente CAD BA 3 months	Morgan Stanley	5.365.000	CAD	16 jun 2026	(32.818)
Ontvangst vaste rente 1,38%					
Betaling vlottende rente CAD BA 3 months	Morgan Stanley	5.580.000	CAD	16 jun 2026	(34.312)
Ontvangst vaste rente 1,39%					
Betaling vlottende rente CAD BA 3 months	Morgan Stanley	5.365.000	CAD	16 jun 2026	(29.367)
Ontvangst vaste rente 1,95%					
Betaling vlottende rente ILS TELBOR 3 months	Goldman Sachs	6.125.000	ILS	17 jun 2031	(6.950)
Ontvangst vaste rente 1,39%					
Betaling vlottende rente CAD BA 3 months	Morgan Stanley	5.153.000	CAD	16 jun 2026	(29.077)
Betaling vaste rente 2,59%					
Ontvangst vlottende rente MYR KLIBOR 3 months	J.P. Morgan	4.625.000	MYR	16 jun 2026	13.359
Betaling vaste rente 2,91%					
Ontvangst vlottende rente CNY REPO RATE 7 days	J.P. Morgan	13.863.000	CNY	16 jun 2026	(10.842)
Ontvangst vaste rente 2,06%					
Betaling vlottende rente ILS TELBOR 3 months	Citi Bank	2.351.000	ILS	17 jun 2031	973
Betaling vaste rente 4,37%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	50.117.000	MXN	15 jun 2022	9.976
Betaling vaste rente 7,43%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	13.925.000	MXN	11 jun 2031	13.016
Ontvangst vaste rente 2,86%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	1.725.000	NZD	17 jun 2031	(3.861)
Ontvangst vaste rente 1,03%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	755.000	AUD	16 jun 2026	848
Betaling vaste rente 0,37%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 3 months	Morgan Stanley	11.765.000	PLN	16 jun 2022	(1.793)
Betaling vaste rente 2,41%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	5.096.000	PLN	17 jun 2031	6.453
Betaling vaste rente 0,72%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	4.596.000	PLN	16 jun 2023	(2.904)
Betaling vaste rente 1,36%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	1.818.000	PLN	16 jun 2026	88
Betaling vaste rente 0,27%					
Ontvangst vlottende rente ILS TELBOR 3 months	Citi Bank	6.455.000	ILS	16 jun 2023	(209)
Betaling vaste rente 0,70%					
Ontvangst vlottende rente ILS TELBOR 3 months	Citi Bank	3.610.000	ILS	16 jun 2026	2.588
Betaling vaste rente 1,42%					
Ontvangst vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	1.445.071.000	HUF	16 jun 2023	13.824
Betaling vaste rente 1,13%					
Ontvangst vlottende rente HUF BUBOR 3 months	Morgan Stanley	525.536.000	HUF	16 jun 2022	2.067
Betaling vaste rente 4,60%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	45.007.000	ZAR	16 jun 2023	2.655
Betaling vaste rente 4,12%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	41.824.000	ZAR	16 jun 2022	137

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Betaling vaste rente 1,77%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	J.P. Morgan	2.710.398.000	KRW	17 jun 2031	19.954
Betaling vaste rente 1,06%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	J.P. Morgan	2.870.272.000	KRW	16 jun 2023	4.224
Ontvangst vaste rente 1,66%					
Betaling vlottende rente HUF BUBOR 3 months	Morgan Stanley	3.897.825.000	HUF	15 jun 2023	(28.339)
Betaling vaste rente 1,43%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Goldman Sachs	1.491.823.000	KRW	16 jun 2025	1.078
Ontvangst vaste rente 1,34%					
Betaling vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	4.510.000	PLN	16 jun 2026	(1.323)
Betaling vaste rente 1,92%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	6.515.000	PLN	16 jun 2031	(625)
Ontvangst vaste rente 6,72%					
Betaling vlottende rente RUB MOSPRIME 3 months	J.P. Morgan	65.715.000	RUB	16 jun 2026	(15.431)
Ontvangst vaste rente 7,14%					
Betaling vlottende rente RUB MOSPRIME 3 months	Barclays Bank	80.315.000	RUB	16 jun 2031	(20.543)
Betaling vaste rente 1,09%					
Ontvangst vlottende rente CZK PRIBOR 6 months	Morgan Stanley	615.355.000	CZK	16 jun 2023	26.664
Ontvangst vaste rente 1,60%					
Betaling vlottende rente CZK PRIBOR 6 months	Morgan Stanley	524.865.000	CZK	16 jun 2026	(141.256)
Betaling vaste rente 1,76%					
Ontvangst vlottende rente CZK PRIBOR 6 months	Morgan Stanley	140.325.000	CZK	16 jun 2031	61.753
Betaling vaste rente 1,42%					
Ontvangst vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	6.170.265.000	HUF	16 jun 2023	56.594
Ontvangst vaste rente 1,92%					
Betaling vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	6.292.945.000	HUF	16 jun 2026	(256.252)
Betaling vaste rente 2,43%					
Ontvangst vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	2.374.520.000	HUF	16 jun 2031	188.909
Betaling vaste rente 1,73%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	10.730.000	PLN	16 jun 2031	47.092
Betaling vaste rente 6,10%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	60.635.000	ZAR	16 jun 2026	16.873
Ontvangst vaste rente 7,67%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	54.220.000	ZAR	16 jun 2031	(42.527)
Ontvangst vaste rente 10,01%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	26.480.000	ZAR	17 jun 2031	(14.062)
Betaling vaste rente 2,24%					
Ontvangst vlottende rente NOK NIBOR 6 months	Morgan Stanley	14.122.000	NOK	17 jun 2031	1.692
Betaling vaste rente 2,22%					
Ontvangst vlottende rente NOK NIBOR 6 months	Morgan Stanley	17.260.000	NOK	17 jun 2031	3.914
Ontvangst vaste rente 0,43%					
Betaling vlottende rente ILS TELBOR 3 months	Bank of America	24.462.000	ILS	15 jun 2023	3.424
Ontvangst vaste rente 0,42%					
Betaling vlottende rente ILS TELBOR 3 months	Citi Bank	27.038.000	ILS	15 jun 2023	2.658
Ontvangst vaste rente 1,11%					
Betaling vlottende rente CZK PRIBOR 6 months	Morgan Stanley	122.400.000	CZK	16 jun 2023	(3.313)
Betaling vaste rente -0,47%					
Ontvangst vlottende rente EUR EURIBOR 6 months	Morgan Stanley	14.720.000	EUR	16 jun 2023	(5.227)

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Ontvangst vaste rente -0,28%					
Betaling vlottende rente EUR EURIBOR 6 months	Morgan Stanley	8.530.000	EUR	16 jun 2026	(1.945)
Betaling vaste rente 0,06%					
Ontvangst vlottende rente EUR EURIBOR 6 months	Morgan Stanley	1.345.000	EUR	16 jun 2031	7.759
Ontvangst vaste rente 0,28%					
Betaling vlottende rente USD LIBOR 3 months	Morgan Stanley	3.335.000	USD	16 jun 2023	(1.167)
Betaling vaste rente 1,69%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	Morgan Stanley	355.000	USD	16 jun 2031	5.904
Ontvangst vaste rente 7,94%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	11.722.000	ZAR	16 jun 2031	6.049
Ontvangst vaste rente 1,21%					
Betaling vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	11.890.000	PLN	16 jun 2026	(22.715)
Ontvangst vaste rente 1,81%					
Betaling vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	26.266.000	PLN	16 jun 2031	(91.697)
Betaling vaste rente 7,44%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	11.120.052	MXN	11 jun 2031	9.868
Betaling vaste rente 6,39%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	21.591.000	MXN	4 jun 2031	44.553
Betaling vaste rente 3,12%					
Ontvangst vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	153.851.000	HUF	17 jun 2031	3.512
Betaling vaste rente 4,73%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	76.356.000	MXN	14 jun 2023	39.203
Betaling vaste rente 1,53%					
Ontvangst vlottende rente KRW CD 3 months	Deutsche Bank	1.934.505.000	KRW	15 sep 2026	5.149
Betaling vaste rente 2,95%					
Ontvangst vlottende rente CNY REPO RATE 7 days	Morgan Stanley	9.006.000	CNY	15 sep 2026	(7.872)
Ontvangst vaste rente 2,54%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Morgan Stanley	2.670.850.000	CLP	16 jun 2026	(33.955)
Betaling vaste rente 1,39%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Morgan Stanley	2.302.290.000	CLP	16 jun 2023	21.612
Betaling vaste rente 1,42%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Citi Bank	3.051.870.000	CLP	16 jun 2023	26.060
Betaling vaste rente 3,43%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Morgan Stanley	757.795.000	CLP	16 jun 2031	8.601
Betaling vaste rente 3,43%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Citi Bank	595.415.000	CLP	16 jun 2031	6.586
Betaling vaste rente 5,49%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	82.035.000	MXN	4 mrt 2026	97.947
Ontvangst vaste rente 6,70%					
Betaling vlottende rente RUB MOSPRIME 3 months	Citi Bank	52.425.000	RUB	16 jun 2026	(12.749)
Betaling vaste rente 6,09%					
Ontvangst vlottende rente RUB MOSPRIME 3 maanden	Citi Bank	317.355.000	RUB	16 jun 2023	50.587
Betaling vaste rente 1,13%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Morgan Stanley	10.610.887.000	CLP	15 sep 2022	54.630
Betaling vaste rente 6,52%					
Ontvangst vlottende rente RUB MOSPRIME 3 maanden	J.P. Morgan	536.389.000	RUB	15 sep 2023	50.629
Betaling vaste rente 0,31%					
Ontvangst vlottende rente ILS TELBOR 3 months	BNP Paribas	7.100.000	ILS	15 sep 2023	513

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Betaling vaste rente 1,64%					
Ontvangst vlottende rente CZK PRIBOR 6 months	Morgan Stanley	16.254.000	CZK	15 sep 2026	6.137
Betaling vaste rente 2,37%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	11.985.000	PLN	16 sep 2031	25.593
Ontvangst vaste rente 1,93%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Goldman Sachs	4.403.991.000	CLP	15 jun 2023	(27.828)
Ontvangst vaste rente 0,38%					
Betaling vlottende rente GBP LIBOR 6 months	Morgan Stanley	786.000	GBP	15 sep 2023	(807)
Betaling vaste rente -0,25%					
Ontvangst vlottende rente EUR EURIBOR 6 months	Morgan Stanley	485.000	EUR	15 sep 2026	481
Ontvangst vaste rente 1,09%					
Betaling vlottende rente AUD BBR 6 months	Morgan Stanley	1.524.000	AUD	15 sep 2026	(4.077)
Betaling vaste rente 0,69%					
Ontvangst vlottende rente GBP LIBOR 6 months	Morgan Stanley	277.000	GBP	15 sep 2026	1.734
Ontvangst vaste rente 0,56%					
Betaling vlottende rente GBP LIBOR 6 months	Morgan Stanley	1.425.000	GBP	21 sep 2023	(1.122)
Ontvangst vaste rente 2,46%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Morgan Stanley	4.784.645.000	CLP	16 jun 2026	(84.326)
Betaling vaste rente 1,34%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Morgan Stanley	5.645.230.000	CLP	16 jun 2023	60.447
Betaling vaste rente 3,35%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Morgan Stanley	1.329.735.000	CLP	16 jun 2031	26.764
Ontvangst vaste rente 2,92%					
Betaling vlottende rente CNY REPO RATE 7 days	J.P. Morgan	5.370.000	CNY	16 jun 2026	4.580
Betaling vaste rente 1,60%					
Ontvangst vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	1.073.904.000	HUF	15 sep 2023	8.941
Ontvangst vaste rente 0,81%					
Betaling vlottende rente CAD BA 3 months	Morgan Stanley	5.601.000	CAD	15 sep 2023	240
Betaling vaste rente 0,19%					
Ontvangst vlottende rente JPY LIBOR 6 months	Morgan Stanley	47.918.000	JPY	15 sep 2031	432
Betaling vaste rente 1,71%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	6.070.000	PLN	16 jun 2031	30.222
Ontvangst vaste rente 1,18%					
Betaling vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	11.590.000	PLN	16 jun 2026	(26.217)
Betaling vaste rente 0,47%					
Ontvangst vlottende rente USD LIBOR 3 months	Morgan Stanley	5.048.000	USD	21 sep 2023	1.247
Ontvangst vaste rente 0,34%					
Betaling vlottende rente USD LIBOR 3 months	Morgan Stanley	6.530.000	USD	15 sep 2023	(2.844)
Ontvangst vaste rente 1,63%					
Betaling vlottende rente USD LIBOR 3 months	Morgan Stanley	5.760.000	USD	15 sep 2031	(102.338)
Ontvangst vaste rente 2,45%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	J.P. Morgan	973.918.000	CLP	16 jun 2026	(17.861)
Betaling vaste rente 2,21%					
Ontvangst vlottende rente NOK NIBOR 6 months	Morgan Stanley	22.420.000	NOK	17 jun 2031	7.014
Betaling vaste rente 0,81%					
Ontvangst vlottende rente ILS TELBOR 3 months	J.P. Morgan	6.191.000	ILS	15 sep 2026	1.097

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Ontvangst vaste rente 2,10%					
Betaling vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	391.542.000	HUF	16 jun 2026	(5.562)
Betaling vaste rente 1,58%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Bank of America	5.125.549.000	CLP	15 sep 2023	56.785
Betaling vaste rente 4,19%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Goldman Sachs	882.600.000	ZAR	17 jan 2022	(21.805)
Ontvangst vaste rente 2,01%					
Betaling vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	225.155.000	HUF	16 jun 2026	(6.010)
Ontvangst vaste rente 4,17%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	105.510.000	ZAR	16 jun 2022	3.262
Ontvangst vaste rente 4,21%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	63.305.000	ZAR	16 jun 2022	3.504
Betaling vaste rente 4,63%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	107.760.000	ZAR	16 jun 2023	3.277
Betaling vaste rente 4,68%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	64.660.000	ZAR	16 jun 2023	(2.552)
Ontvangst vaste rente 5,20%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	22.145.000	ZAR	16 jun 2024	1.483
Betaling vaste rente 4,75%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	163.590.000	MXN	16 mrt 2023	48.560
Betaling vaste rente 5,63%					
Ontvangst vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	96.130.000	MXN	12 mrt 2026	87.267
Betaling vaste rente 1,47%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	6.122.000	NZD	15 sep 2026	(33.725)
Ontvangst vaste rente 1,69%					
Betaling vlottende rente CAD BA 3 months	Morgan Stanley	8.609.000	CAD	15 sep 2026	24.316
Ontvangst vaste rente 2,56%					
Betaling vlottende rente USD LIBOR 3 months	Morgan Stanley	2.553.000	USD	16 sep 2031	1.719
Betaling vaste rente 1,49%					
Ontvangst vlottende rente HUF BUBOR 6 months	Morgan Stanley	1.735.995.000	HUF	16 jun 2023	8.085
Ontvangst vaste rente 2,91%					
Betaling vlottende rente CAD BA 3 months	Morgan Stanley	3.883.000	CAD	16 sep 2031	5.870
Ontvangst vaste rente 2,87%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Morgan Stanley	436.147.000	CLP	15 sep 2026	(1.460)
Ontvangst vaste rente 2,60%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Citi Bank	1.205.090.000	CLP	16 jun 2026	(10.296)
Betaling vaste rente 1,49%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Citi Bank	1.416.980.000	CLP	16 jun 2023	9.516
Betaling vaste rente 3,45%					
Ontvangst vlottende rente CLP ICP 1 day	Citi Bank	336.430.000	CLP	16 jun 2031	2.749
Betaling vaste rente 7,29%					
Ontvangst vlottende rente RUB MOSPRIME 3 maanden	Goldman Sachs	52.390.000	RUB	15 sep 2026	(1.844)
Betaling vaste rente 7,50%					
Ontvangst vlottende rente RUB MOSPRIME 3 maanden	Goldman Sachs	54.390.000	RUB	15 sep 2026	(8.177)
Betaling vaste rente 7,14%					
Ontvangst vlottende rente RUB MOSPRIME 3 maanden	Barclays Bank	54.389.000	RUB	15 sep 2026	2.610

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Renteswaps (vervolg)

Beschrijving	Tegenpartij	Nominale waarde	Valuta	Vervaldatum	Niet-gerealiseerde waardevermeerdering/(-vermindering)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)					
Betaling vaste rente 2,45%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	11.425.000	PLN	16 jun 2031	9.787
Betaling vaste rente 1,80%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	11.470.000	PLN	20 sep 2026	15.764
Betaling vaste rente 1,29%					
Ontvangst vlottende rente SGD SOR 6 months	Morgan Stanley	2.112.000	SGD	15 sep 2026	2.213
Ontvangst vaste rente 0,49%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	6.899.000	NZD	15 sep 2023	(10.505)
Ontvangst vaste rente 1,33%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	7.525.000	NZD	21 jun 2025	(9.594)
Ontvangst vaste rente 1,18%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	7.689.000	NZD	21 jun 2025	(25.693)
Ontvangst vaste rente 1,15%					
Betaling vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	22.422.000	NZD	21 jun 2025	(82.901)
Ontvangst vaste rente 2,66%					
Betaling vlottende rente CNY REPO RATE 7 days	Citi Bank	21.983.000	CNY	15 sep 2023	1.223
Betaling vaste rente 1,86%					
Ontvangst vlottende rente NZD BBR 3 months	Morgan Stanley	1.109.000	NZD	16 jun 2031	11.987
Ontvangst vaste rente 4,56%					
Betaling vlottende rente CLP ICP 1 day	Goldman Sachs	1.066.645.000	CLP	16 sep 2031	3.764
Ontvangst vaste rente 0,64%					
Betaling vlottende rente PLN WIBOR 3 months	Morgan Stanley	20.627.000	PLN	21 sep 2023	(13.464)
Ontvangst vaste rente 8,05%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	9.300.000	ZAR	15 sep 2031	978
Ontvangst vaste rente 8,03%					
Betaling vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Morgan Stanley	6.025.000	ZAR	15 sep 2031	133
Betaling vaste rente 4,10%					
Ontvangst vlottende rente ZAR JIBAR 3 months	Goldman Sachs	1.297.445.000	ZAR	31 jan 2022	(5.318)
Ontvangst vaste rente 6,76%					
Betaling vlottende rente MXN TIIE 28 days	Morgan Stanley	19.940.000	MXN	18 mrt 2031	(6.800)
Betaling vaste rente 2,86%					
Ontvangst vlottende rente MYR KLIBOR 3 months	J.P. Morgan	8.705.000	MYR	15 sep 2026	5.589
Betaling vaste rente 0,69%					
Ontvangst vlottende rente PLN WIBOR 6 months	Morgan Stanley	12.105.000	PLN	15 sep 2023	1.590
				USD	1.103.554

Te ontvangen onderpand per tegenpartij

Per 31 maart 2021 was de blootstelling van het te ontvangen onderpand per tegenpartij voor derivatencontracten als volgt:

Compartimenten	Tegenpartij	Type onderpand	Valuta	Totaal Ontvangen onderpand
Schroder GAIA BlueTrend				
	Credit Suisse	Contanten	USD	5.132.752
	J.P. Morgan	Contanten	EUR	1.653.399
	J.P. Morgan	Contanten	NZD	73.590
	J.P. Morgan	Contanten	USD	2.471.143
			USD	9.594.231

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Te ontvangen onderpand per tegenpartij (vervolg)

Compartimenten	Tegenpartij	Type onderpand	Valuta	Totaal Ontvangen onderpand
Schroder GAIA Egerton Equity				
	HSBC	Contanten	EUR	9.184.503
	Merrill Lynch	Contanten	CAD	2
	Morgan Stanley	Contanten	CAD	3
	Morgan Stanley	Contanten	EUR	13.530.443
			EUR	22.714.950
Schroder GAIA Helix				
	Goldman Sachs	Contanten	EUR	2.248.114
	Goldman Sachs	Contanten	GBP	2.522.217
	Goldman Sachs	Contanten	HKD	967.140
	Goldman Sachs	Contanten	USD	15.125.590
	J.P. Morgan	Contanten	CAD	12.484
	J.P. Morgan	Contanten	EUR	4.358.560
	J.P. Morgan	Contanten	HKD	2.545.691
	J.P. Morgan	Contanten	JPY	75.158.628
	J.P. Morgan	Contanten	USD	10.281.034
			USD	37.771.981
Schroder GAIA M&A*				
	Goldman Sachs	Contanten	USD	8.944
			USD	8.944
Schroder GAIA Sirios US Equity				
	Morgan Stanley	Contanten	USD	320.000
			USD	320.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified				
	Credit Suisse	Contanten	EUR	5.234.230
	Morgan Stanley	Contanten	CAD	1.721.469
	Morgan Stanley	Contanten	EUR	20.427.431
	Morgan Stanley	Contanten	JPY	416.675.698
	Morgan Stanley	Contanten	USD	25.012.467
	Societe Generale	Contanten	AUD	6.597.457
	Societe Generale	Contanten	GBP	7.421.329
	Societe Generale	Contanten	SEK	9.867.123
	Societe Generale	Contanten	SGD	553.631
	Societe Generale	Contanten	USD	49
			USD	77.022.446
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
	Morgan Stanley	Contanten	GBP	148.635
	Morgan Stanley	Contanten	USD	10
			GBP	148.642
Schroder GAIA Wellington Pagosa				
	Barclays Bank	Contanten	USD	680.000
	BNP Paribas	Contanten	USD	260.000
	Citi Bank	Contanten	USD	354.000
	Credit Suisse	Contanten	USD	90.000
	Goldman Sachs	Contanten	USD	2.340.024
	J.P. Morgan	Contanten	USD	3.838.000
	Merrill Lynch	Contanten	USD	684.529
	Morgan Stanley	Contanten	AUD	260
	Morgan Stanley	Contanten	EUR	39.965
	Morgan Stanley	Contanten	GBP	302.781
	Morgan Stanley	Contanten	HUF	7.967
	Morgan Stanley	Contanten	NOK	4.019.866

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Te ontvangen onderpand per tegenpartij (vervolg)

Compartimenten	Tegenpartij	Type onderpand	Valuta	Totaal Ontvangen onderpand
Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)	Morgan Stanley	Contanten	NZD	9.024
	Morgan Stanley	Contanten	PLN	12.898
	Morgan Stanley	Contanten	SGD	5.106
	Morgan Stanley	Contanten	USD	2.325.943
	Standard Chartered Bank	Contanten	USD	320.000
			USD	11.840.349

Bekendmaking van transactiekosten

De transactiekosten bestaan uit makelaarsprovisies en belastingen die verband houden met de aankoop en verkoop van overdraagbare effecten. Bij obligatiesubfondsen staat bij makelaarsprovisies meestal het getal nul omdat deze kosten zijn opgenomen in de spread, die uitgesloten is van de berekening volgens Bijlage I, Overzicht B, Hoofdstuk V van Richtlijn 2009/65/EG van het Europees Parlement. Het transactiekostendeel van de aankoopkosten/verkoopprijs van de betrokken activa en de transactiekosten van de bewaarder zijn niet opgenomen in deze tabel.

De transactiekosten voor de verslagperiode waren als volgt:

Compartimenten	Valuta	Provisies
Schroder GAIA BlueTrend	USD	21.413
Schroder GAIA Cat Bond	USD	61.334
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	530.138
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	430.450
Schroder GAIA Helix	USD	556.182
Schroder GAIA M&A*	USD	2.383
Schroder GAIA Sirius US Equity	USD	821.222
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	209.708
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	GBP	17.580
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	755.306

Dividenden

Tijdens de verslagperiode betaalde het volgende subfonds dividenden uit:

Registratiedatum	Ex-dividenddatum	Betalingsdatum	Compartiment	Brutodividend	Valuta	Dividend per Aandeel
9 okt 2020	16 okt 2020	23 okt 2020	Schroder GAIA Cat Bond Categorie F Dis	226,18	USD	1,020023
			Schroder GAIA Cat Bond Categorie F Dis SGD Hedged	428,54	SGD	1,349634
13 nov 2020	20 nov 2020	27 nov 2020	Schroder GAIA Cat Bond Categorie F Dis	901,52	USD	4,065662
			Schroder GAIA Cat Bond Categorie F Dis SGD Hedged	1.710,72	SGD	5,387570
11 dec 2020	18 dec 2020	28 dec 2020	Schroder GAIA Cat Bond Categorie F Dis	850,70	USD	3,836475
			Schroder GAIA Cat Bond Categorie F Dis SGD Hedged	2.105,06	SGD	5,099957
			Schroder GAIA Cat Bond Categorie IF Dis QV	64.179,91	USD	11,740972
8 jan 2021	15 jan 2021	22 jan 2021	Schroder GAIA Cat Bond Categorie F Dis	599,65	USD	2,704293
			Schroder GAIA Cat Bond Categorie F Dis SGD Hedged	1.484,78	SGD	3,596859
12 feb 2021	19 feb 2021	26 feb 2021	Schroder GAIA Cat Bond Categorie F Dis	728,12	USD	3,283666
			Schroder GAIA Cat Bond Categorie F Dis SGD Hedged	2.366,42	SGD	4,387777
12 mrt 2021	19 mrt 2021	26 mrt 2021	Schroder GAIA Cat Bond Categorie F Dis	619,67	USD	2,794579
			Schroder GAIA Cat Bond Categorie F Dis SGD Hedged	1.793,74	SGD	3,762040
			Schroder GAIA Cat Bond Categorie IF Dis QV	157.508,93	USD	11,870498

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

Toelichting bij de financiële overzichten per 31 maart 2021 (vervolg)

Gekruiste beleggingen tussen de Compartimenten

Per 31 maart 2021 bedroeg het totaal van de gekruiste beleggingen tussen de subfondsen EUR 5.108.723, zodat de totale gecombineerde IW per het einde van de periode zonder deze gekruiste beleggingen tussen de subfondsen EUR 5.175.712.309 zou hebben bedragen. De details van de gekruiste beleggingen tussen de compartimenten zijn te vinden in onderstaande tabel:

Beleggingen	Valuta van het Subfonds	Marktwaaarde	% van netto-vermogen
Schroder GAIA Helix			
Schroder GAIA M&A		5.991.000	1,21
	USD	5.991.000	1,21

Wisselkoers

De wisselkoers die is gebruikt voor de berekening van het gecombineerde totaal in euro van de financiële overzichten per 31 maart 2021 is:

1 euro = 1,17270 Amerikaanse dollar

1 euro = 0,85065 Britse pond

Opeenvolgende gebeurtenissen

Op 28 april 2021 werd het subfonds Schroder GAIA M&A vereffend.

Op 12 mei 2021 werd het volgende subfonds geïntroduceerd: Schroder GAIA Oaktree Credit.

Total Expense Ratio (de “TER”) voor de periode afgesloten op 31 maart 2021

Aandelen categorie	Schroder GAIA BlueTrend	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Helix	Schroder GAIA M&A*	Schroder GAIA Sirius US Equity	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Compartment	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Categorie A Acc	2,00%	1,80%	2,46%	2,45%	2,50%	1,41%	2,45%	-	-	2,45%
Categorie A Acc CHF Hedged	2,03%	-	2,51%	-	2,50%	1,72%	2,48%	-	-	2,48%
Categorie A Acc EUR Hedged	2,03%	-	2,49%	-	2,54%	1,72%	2,48%	-	-	2,48%
Categorie A Acc GBP Hedged	-	-	-	2,48%	-	-	-	-	-	-
Categorie A Acc SEK Hedged	-	1,77%	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie A Acc SGD Hedged	2,03%	-	2,48%	-	2,49%	-	-	-	-	2,48%
Categorie A Acc USD Hedged	-	-	-	2,48%	-	-	-	-	-	-
Categorie A Dis GBP	-	-	-	2,45%	-	-	-	-	-	-
Categorie A1 Acc	-	-	2,95%	2,95%	-	-	-	-	-	2,81%
Categorie A1 Acc USD Hedged	-	-	-	2,98%	-	-	-	-	-	-
Categorie C Acc	1,40%	1,40%	1,71%	1,70%	1,41%	0,75%	1,69%	1,85%	1,20%	1,70%
Categorie C Acc BRL Hedged	1,56%	-	-	-	-	-	-	-	-	1,74%
Categorie C Acc CHF Hedged	1,43%	1,42%	1,75%	-	1,44%	1,00%	1,73%	1,89%	1,22%	1,69%
Categorie C Acc EUR Hedged	1,43%	1,48%	1,74%	-	1,45%	0,78%	1,73%	1,88%	1,22%	1,72%
Categorie C Acc GBP Hedged	1,43%	1,42%	1,74%	1,73%	1,45%	1,00%	1,73%	1,89%	-	1,73%
Categorie C Acc JPY Hedged	-	-	-	1,71%	-	-	-	-	-	-
Categorie C Acc SEK Hedged	-	-	1,73%	-	-	-	-	-	-	-
Categorie C Acc SGD Hedged	-	-	1,73%	-	1,45%	-	-	-	-	1,74%
Categorie C Acc USD Hedged	-	-	-	1,73%	-	-	-	-	1,22%	-
Categorie C Dis	-	-	-	1,70%	-	-	-	-	-	-
Categorie C Dis GBP	-	-	-	1,70%	-	-	-	-	-	-
Categorie C Dis GBP Hedged	1,43%	-	-	-	-	-	1,73%	-	-	-
Categorie C1 Acc	-	-	-	-	1,32%	-	-	-	-	1,59%
Categorie C1 Acc CHF Hedged	-	-	-	-	1,44%	-	-	-	-	1,73%
Categorie C1 Acc EUR Hedged	-	-	-	-	1,43%	-	-	-	-	1,73%
Categorie E Acc	1,40%	-	1,45%	1,70%	1,00%	0,47%	1,40%	-	-	1,20%
Categorie E Acc CHF	1,30%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie E Acc CHF Hedged	1,43%	-	1,48%	-	1,00%	0,76%	-	-	-	1,23%
Categorie E Acc EUR Hedged	1,43%	-	1,48%	-	1,00%	0,75%	1,43%	-	-	1,23%
Categorie E Acc GBP	1,39%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie E Acc GBP Hedged	1,43%	-	1,48%	-	1,00%	0,76%	-	-	-	1,23%
Categorie E Acc SEK Hedged	-	-	1,48%	-	-	-	-	-	-	-
Categorie E Acc SGD Hedged	-	-	1,48%	-	1,00%	-	-	-	-	1,24%
Categorie E Dis GBP Hedged	1,43%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie F Acc	-	1,75%	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie F Acc CHF Hedged	-	1,76%	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie F Acc EUR Hedged	-	1,75%	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie F Dis	-	1,75%	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie F Dis SGD Hedged	-	1,75%	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie I Acc	0,05%	0,17%	0,06%	0,12%	0,17%	0,25%	0,15%	0,07%	0,06%	0,07%
Categorie I Acc CHF Hedged	-	0,18%	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie I Acc EUR Hedged	-	0,21%	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie I Acc JPY Hedged	-	0,19%	-	-	0,19%	-	-	-	-	-
Categorie I Acc USD Hedged	-	-	-	0,19%	-	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc	-	1,35%	-	-	-	-	-	-	-	-

Opgelet: de transactiekosten, die gedetailleerd zijn beschreven in de toelichtingen bij de financiële overzichten, en de transactiekosten in verband met de onderliggende portefeuille van gestructureerde producten zijn niet opgenomen in de bovenstaande TER.

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

Total Expense Ratio (de “TER”) voor de periode afgesloten op 31 maart 2021 (vervolg)

Aandelencategorie	Schroder GAIA BlueTrend	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Helix	Schroder GAIA M&A*	Schroder GAIA Sirius US Equity	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Compartment	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Categorie IF Acc CHF Hedged	-	1,36%	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc EUR Hedged	-	1,36%	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie IF Acc SEK Hedged	-	1,36%	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie IF Dis QV	-	1,35%	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie K Acc	-	-	-	-	-	-	-	2,35%	-	-
Categorie K Acc CHF Hedged	-	-	-	-	-	-	-	2,39%	-	-
Categorie K Acc EUR Hedged	-	-	-	-	-	-	-	2,38%	1,74%	-
Categorie K Acc USD Hedged	-	-	-	-	-	-	-	-	1,75%	-
Categorie N Acc GBP Hedged	1,43%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Categorie R Acc	-	-	-	-	-	-	-	-	1,29%	-
Categorie R Acc EUR Hedged	-	-	-	-	-	-	-	-	1,30%	-
Categorie R Acc USD Hedged	-	-	-	-	-	-	-	-	1,32%	-
Categorie X Acc	-	-	-	1,60%	-	-	1,53%	-	-	-
Categorie X Acc EUR Hedged	-	-	-	-	0,78%	-	1,63%	-	-	-

Opgelet: de transactiekosten, die gedetailleerd zijn beschreven in de toelichtingen bij de financiële overzichten, en de transactiekosten in verband met de onderliggende portefeuille van gestructureerde producten zijn niet opgenomen in de bovenstaande TER.

* Raadpleeg het Verslag van de Bestuurders voor informatie over alle zakelijke transacties die hebben plaatsgevonden tijdens de verslagperiode.

Bijlage I – Effectenfinancieringstransacties

De subfondsen voeren effectenfinancieringstransacties (Securities Financing Transactions, SFT's) uit (zoals gedefinieerd in Artikel 3 van Verordening (EU) 2015/2365 omvatten effectenfinancieringstransacties terugkoopovereenkomsten, effecten- of grondstoffenleningen, kooptransacties met wederverkoop of verkooptransacties met wederinkoop en margeleningstransacties). In overeenstemming met Artikel 13 van de Verordening wordt hieronder de betrokkenheid van de subfondsen inzake hun blootstelling aan total return swaps voor de op 31 maart 2021 afgesloten periode uiteengezet:

Schroder GAIA Egerton Equity

Algemene gegevens

Bedragen van de total return swaps

Activabedrag - Longposities EUR	% van het beheerde vermogen
44.370.223	4,39%
Activabedrag - Shortposities EUR	% van het beheerde vermogen
34.947.599	3,46%
Activabedrag - Totaal EUR	% van het beheerde vermogen
79.317.822	7,85%

Geconcentreerde gegevens

Tien grootste emittenten van onderpand (voor alle SFT's en total return swaps)

Per 31 maart 2021 waren er geen effecten en grondstoffen als onderpand ontvangen voor total return swaps.

Top-10 tegenpartijen

Tegenpartij	Brutovolume van uitstaande transacties EUR
Morgan Stanley	38.904.324
J.P. Morgan	24.667.613
Goldman Sachs	13.417.751
Merrill Lynch	2.328.134
	79.317.822

Het subfonds voert met alle bovenstaande tegenpartijen transacties uit voor zijn total return swaps.

Geaggregeerde transactiegegevens

Type en kwaliteit van het onderpand

De samengevoegde transactiegegevens voor onderpand ontvangen voor total return swaps wordt als volgt bewaard:

Type	Marktw waarde EUR
Contanten	13.530.443
	13.530.443

Looptijd van het onderpand

Verval-	Marktw waarde EUR
minder dan 1 dag	13.530.443
1 tot 7 dagen	-
1 tot 4 weken	-
1 tot 3 maanden	-
3 tot 12 maanden	-
meer dan 1 jaar	-
open looptijd	-
	13.530.443

Bijlage I – Effectenfinancieringstransacties (vervolg)

Schroder GAIA Egerton Equity (vervolg)

Valuta van het onderpand

Valuta	Marktwaaarde EUR
EUR	13.530.443
	13.530.443

Resterende looptijd van total return swaps

Verval-	Longposities EUR	Shortposities EUR	Totaal EUR
minder dan 1 dag	-	-	-
1 tot 7 dagen	-	-	-
1 tot 4 weken	-	-	-
1 tot 3 maanden	-	417.699	417.699
3 tot 12 maanden	41.169.027	10.655.724	51.824.751
meer dan 1 jaar	3.201.196	23.874.176	27.075.372
open looptijd	-	-	-
	44.370.223	34.947.599	79.317.822

Land waarin de tegenpartijen bij total return swaps zijn gevestigd

Tegenpartij	Land
Morgan Stanley	Verenigde Staten
J.P. Morgan	Verenigd Koninkrijk
Goldman Sachs	Verenigde Staten
Merrill Lynch	Verenigde Staten

Vereffening en clearing

Het subfonds gebruikt bilaterale vereffening en clearing met zijn tegenpartij voor total return swaps.

Hergebruik van onderpand

Eventueel voor total return swaps ontvangen onderpand wordt niet hergebruikt of herbelegd door het subfonds.

Bewaring van onderpand

Ontvangen onderpand

Onderpand ontvangen voor total return swaps wordt als volgt bewaard:

Bewaarder	Marktwaaarde EUR
Morgan Stanley	13.530.443
	13.530.443

Toegekend onderpand

Het aandeel van het onderpand gehouden in gescheiden rekeningen of gepoolde rekeningen, of in eventuele andere rekeningen betreffende total return swaps is als volgt:

Rekeningtype	Marktwaaarde EUR
Gescheiden	59.489.090
Gepoold	-
Overige	-
	59.489.090

OTC-derivaten die het subfonds afsluit in het kader van een ISDA Master-overeenkomst worden samen gesaldeerd voor onderpanddoeleinden. De bovenstaande vermeldingen voor onderpand gelden dus voor alle OTC-derivaten, en niet enkel voor total return swaps.

Bijlage I – Effectenfinancieringstransacties (vervolg)

Schroder GAIA Egerton Equity (vervolg)

Rendement en kosten

Voor de op 31 maart 2021 afgesloten periode zijn de gegevens van de rendementen en kosten betreffende total return swaps als volgt:

	% van algemeen rendement	Rendement EUR*
Nettorente op swaps	–	–
Netto gerealiseerd verlies	87,05%	106.006.687
Nettowijziging in niet-gerealiseerde waardevermeerdering	12,95%	15.765.553
	100,00%	121.772.240

* uitgedrukt in absolute termen.

Het rendement van de hierboven opgesomde total return swaps is opgenomen in 'Nettorente op swaps' dat deel uitmaakt van de Winst-en-verliesrekening.

Kosten

De kosten voor de total return swaps zijn opgenomen in de spread.

Schroder GAIA Helix

Algemene gegevens

Bedragen van de total return swaps

Activabedrag - Longposities USD	% van het beheerde vermogen
–	–
Activabedrag - Shortposities USD	% van het beheerde vermogen
22.705.790	4,59%
Activabedrag - Totaal USD	% van het beheerde vermogen
22.705.790	4,59%

Geconcentreerde gegevens

Tien grootste emittenten van onderpand (voor alle SFT's en total return swaps)

Per 31 maart 2021 waren er geen effecten en grondstoffen als onderpand ontvangen voor total return swaps.

Top-10 tegenpartijen

Tegenpartij	Brutovolume van uitstaande transacties USD
Goldman Sachs	16.816.469
J.P. Morgan	5.889.321
	22.705.790

Het subfonds voert met alle bovenstaande tegenpartijen transacties uit voor zijn total return swaps.

Geaggregeerde transactiegegevens

Type en kwaliteit van het onderpand

De samengevoegde transactiegegevens voor onderpand ontvangen voor total return swaps wordt als volgt bewaard:

Type	Marktwarde USD
Contanten	14.240.000
	14.240.000

Bijlage I – Effectenfinancieringstransacties (vervolg)

Schroder GAIA Helix (vervolg)

Looptijd van het onderpand

Verval-	Marktwaaarde USD
minder dan 1 dag	14.240.000
1 tot 7 dagen	-
1 tot 4 weken	-
1 tot 3 maanden	-
3 tot 12 maanden	-
meer dan 1 jaar	-
open looptijd	-
	14.240.000

Valuta van het onderpand

Valuta	Marktwaaarde USD
USD	14.240.000
	14.240.000

Resterende looptijd van total return swaps

Verval-	Longposities USD	Shortposities USD	Totaal USD
minder dan 1 dag	-	-	-
1 tot 7 dagen	-	-	-
1 tot 4 weken	-	-	-
1 tot 3 maanden	-	497.287	497.287
3 tot 12 maanden	-	22.208.503	22.208.503
meer dan 1 jaar	-	-	-
open looptijd	-	-	-
	-	22.705.790	22.705.790

Land waarin de tegenpartijen bij total return swaps zijn gevestigd

Tegenpartij	Land
Goldman Sachs	Verenigde Staten
J.P. Morgan	Verenigd Koninkrijk

Vereffening en clearing

Het subfonds gebruikt bilaterale vereffening en clearing met zijn tegenpartij voor total return swaps.

Hergebruik van onderpand

Eventueel voor total return swaps ontvangen onderpand wordt niet hergebruikt of herbelegd door het subfonds.

Bewaring van onderpand

Ontvangen onderpand

Onderpand ontvangen voor total return swaps wordt als volgt bewaard:

Bewaarder	Marktwaaarde USD
Goldman Sachs	11.600.000
J.P. Morgan	2.640.000
	14.240.000

Bijlage I – Effectenfinancieringstransacties (vervolg)

Schroder GAIA Helix (vervolg)

Toegekend onderpand

Per 31 maart 2021 was er geen onderpand toegekend voor total return swaps.

OTC-derivaten die het subfonds afsluit in het kader van een ISDA Master-overeenkomst worden samen gesaldeerd voor onderpanddoeleinden. De bovenstaande vermeldingen voor onderpand gelden dus voor alle OTC-derivaten, en niet enkel voor total return swaps.

Rendement en kosten

Voor de op 31 maart 2021 afgesloten periode zijn de gegevens van de rendementen en kosten betreffende total return swaps als volgt:

	% van algemeen rendement	Rendement USD*
Nettorente op swaps	-	-
Netto gerealiseerd verlies	96,66%	108.822.802
Nettowijziging in niet-gerealiseerde waardevermeerdering	3,34%	3.755.966
	100,00%	112.578.768

* uitgedrukt in absolute termen.

Het rendement van de hierboven opgesomde total return swaps is opgenomen in 'Nettorente op swaps' dat deel uitmaakt van de Winst-en-verliesrekening.

Kosten

De kosten voor de total return swaps zijn opgenomen in de spread.

Schroder GAIA Sirius US Equity

Algemene gegevens

Bedragen van de total return swaps

Activabedrag – Longposities USD	% van het beheerde vermogen
3.572.180	0,90%
Activabedrag - Shortposities USD	% van het beheerde vermogen
11.537.308	2,89%
Activabedrag - Totaal USD	% van het beheerde vermogen
15.109.488	3,79%

Geconcentreerde gegevens

Tien grootste emittenten van onderpand (voor alle SFT's en total return swaps)

Per 31 maart 2021 waren er geen effecten en grondstoffen als onderpand ontvangen voor total return swaps.

Top-10 tegenpartijen

Tegenpartij	Brutovolume van uitstaande transacties USD
Morgan Stanley	6.098.137
Goldman Sachs	3.980.336
Merrill Lynch	3.033.891
Credit Suisse	1.854.446
Barclays Bank	142.678
	15.109.488

Het subfonds voert met alle bovenstaande tegenpartijen transacties uit voor zijn total return swaps.

Bijlage I – Effectenfinancieringstransacties (vervolg)

Schroder GAIA Sirius US Equity (vervolg)

Geaggregeerde transactiegegevens

Type en kwaliteit van het onderpand

De samengevoegde transactiegegevens voor onderpand ontvangen voor total return swaps wordt als volgt bewaard:

Type	Marktwaaarde USD
Contanten	320.000
	320.000

Looptijd van het onderpand

Verval-	Marktwaaarde USD
minder dan 1 dag	320.000
1 tot 7 dagen	-
1 tot 4 weken	-
1 tot 3 maanden	-
3 tot 12 maanden	-
meer dan 1 jaar	-
open looptijd	-
	320.000

Valuta van het onderpand

Valuta	Marktwaaarde USD
USD	320.000
	320.000

Resterende looptijd van total return swaps

Verval-	Longposities USD	Shortposities USD	Totaal USD
minder dan 1 dag	-	-	-
1 tot 7 dagen	-	-	-
1 tot 4 weken	-	142.678	142.678
1 tot 3 maanden	-	5.377.900	5.377.900
3 tot 12 maanden	517.675	3.750.593	4.268.268
meer dan 1 jaar	3.054.505	2.266.137	5.320.642
open looptijd	-	-	-
	3.572.180	11.537.308	15.109.488

Land waarin de tegenpartijen bij total return swaps zijn gevestigd

Tegenpartij	Land
Morgan Stanley	Verenigde Staten
Goldman Sachs	Verenigde Staten
Merrill Lynch	Verenigde Staten
Credit Suisse	Zwitserland
Barclays Bank	Verenigd Koninkrijk

Vereffening en clearing

Het subfonds gebruikt bilaterale vereffening en clearing met zijn tegenpartij voor total return swaps.

Hergebruik van onderpand

Eventueel voor total return swaps ontvangen onderpand wordt niet hergebruikt of herbelegd door het subfonds.

Bijlage I – Effectenfinancieringstransacties (vervolg)

Schroder GAIA Sirios US Equity (vervolg)

Bewaring van onderpand

Ontvangen onderpand

Onderpand ontvangen voor total return swaps wordt als volgt bewaard:

Bewaarder	Marktwaarde USD
Morgan Stanley	320.000
	320.000

Toegekend onderpand

Het aandeel van het onderpand gehouden in gescheiden rekeningen of gepoolde rekeningen, of in eventuele andere rekeningen betreffende total return swaps is als volgt:

Rekeningtype	Marktwaarde USD
Gescheiden	2.550.000
Gepoold	-
Overige	-
	2.550.000

OTC-derivaten die het subfonds afsluit in het kader van een ISDA Master-overeenkomst worden samen gesaldeerd voor onderpanddoeleinden. De bovenstaande vermeldingen voor onderpand gelden dus voor alle OTC-derivaten, en niet enkel voor total return swaps.

Rendement en kosten

Voor de op 31 maart 2021 afgesloten periode zijn de gegevens van de rendementen en kosten betreffende total return swaps als volgt:

	% van algemeen rendement	Rendement USD*
Nettorente op swaps	-	-
Netto gerealiseerd verlies	84,90%	48.715.545
Nettowijziging in niet-gerealiseerde waardevermindering	15,10%	8.662.289
	100,00%	57.377.834

* uitgedrukt in absolute termen.

Het rendement van de hierboven opgesomde total return swaps is opgenomen in 'Nettorente op swaps' dat deel uitmaakt van de Winst-en-verliesrekening.

Kosten

De kosten voor de total return swaps zijn opgenomen in de spread.

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Algemene gegevens

Bedragen van de total return swaps

Activabedrag - Longposities USD	% van het beheerde vermogen
18.587.592	1,73%
Activabedrag - Shortposities USD	% van het beheerde vermogen
-	-
Activabedrag - Totaal USD	% van het beheerde vermogen
18.587.592	1,73%

Bijlage I – Effectenfinancieringstransacties (vervolg)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (vervolg)

Geconcentreerde gegevens

Tien grootste emittenten van onderpand (voor alle SFT's en total return swaps)

Per 31 maart 2021 waren er geen effecten en grondstoffen als onderpand ontvangen voor total return swaps.

Top-10 tegenpartijen

Tegenpartij	Brutovolume van uitstaande transacties USD
Morgan Stanley	18.587.592
	18.587.592

Het subfonds sluit alleen met Morgan Stanley transacties voor zijn total return swaps.

Geaggregeerde transactiegegevens

Type en kwaliteit van het onderpand

De samengevoegde transactiegegevens voor onderpand ontvangen voor total return swaps wordt als volgt bewaard:

Type	Marktwaaarde USD
Contanten	14.300.000
	14.300.000

Looptijd van het onderpand

Verval-	Marktwaaarde USD
minder dan 1 dag	14.300.000
1 tot 7 dagen	-
1 tot 4 weken	-
1 tot 3 maanden	-
3 tot 12 maanden	-
meer dan 1 jaar	-
open looptijd	-
	14.300.000

Valuta van het onderpand

Valuta	Marktwaaarde USD
USD	14.300.000
	14.300.000

Resterende looptijd van total return swaps

Verval-	Longposities USD	Shortposities USD	Totaal USD
minder dan 1 dag	-	-	-
1 tot 7 dagen	-	-	-
1 tot 4 weken	-	-	-
1 tot 3 maanden	-	-	-
3 tot 12 maanden	18.587.592	-	18.587.592
meer dan 1 jaar	-	-	-
open looptijd	-	-	-
	18.587.592	-	18.587.592

Bijlage I – Effectenfinancieringstransacties (vervolg)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (vervolg)

Land waarin de tegenpartijen bij total return swaps zijn gevestigd

Tegenpartij	Land
Morgan Stanley	Verenigde Staten

Vereffening en clearing

Het subfonds gebruikt bilaterale vereffening en clearing met zijn tegenpartij voor total return swaps.

Hergebruik van onderpand

Eventueel voor total return swaps ontvangen onderpand wordt niet hergebruikt of herbelegd door het subfonds.

Bewaring van onderpand

Ontvangen onderpand

Onderpand ontvangen voor total return swaps wordt als volgt bewaard:

Bewaarder	Marktwarde USD
Morgan Stanley	14.300.000
	14.300.000

Toegekend onderpand

Per 31 maart 2021 was er geen onderpand toegekend voor total return swaps.

OTC-derivaten die het subfonds afsluit in het kader van een ISDA Master-overeenkomst worden samen gesaldeerd voor onderpanddoeleinden. De bovenstaande vermeldingen voor onderpand gelden dus voor alle OTC-derivaten, en niet enkel voor total return swaps.

Rendement en kosten

Voor de op 31 maart 2021 afgesloten periode zijn de gegevens van de rendementen en kosten betreffende total return swaps als volgt:

	% van algemeen rendement	Rendement USD*
Nettorente op swaps	-	-
Netto gerealiseerd verlies	83,66%	114.900.932
Nettowijziging in niet-gerealiseerde waardevermeerdering	16,34%	22.434.784
	100,00%	137.335.716

* uitgedrukt in absolute termen.

Het rendement van de hierboven opgesomde total return swaps is opgenomen in 'Nettorente op swaps' dat deel uitmaakt van de Winst-en-verliesrekening.

Kosten

De kosten voor de total return swaps zijn opgenomen in de spread.

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Algemene gegevens

Bedragen van de total return swaps

Activabedrag - Longposities USD	% van het beheerde vermogen
6.568.173	1,37%
Activabedrag - Shortposities USD	% van het beheerde vermogen
7.781.085	1,62%
Activabedrag - Totaal USD	% van het beheerde vermogen
14.349.258	2,99%

Bijlage I – Effectenfinancieringstransacties (vervolg)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Geconcentreerde gegevens

Tien grootste emittenten van onderpand (voor alle SFT's en total return swaps)

Per 31 maart 2021 waren er geen effecten en grondstoffen als onderpand ontvangen voor total return swaps.

Top-10 tegenpartijen

Tegenpartij	Brutovolume van uitstaande transacties USD
J.P. Morgan	5.837.555
Goldman Sachs	4.357.937
Morgan Stanley	4.153.766
	14.349.258

Het subfonds voert met alle bovenstaande tegenpartijen transacties uit voor zijn total return swaps.

Geaggregeerde transactiegegevens

Type en kwaliteit van het onderpand

De samengevoegde transactiegegevens voor onderpand ontvangen voor total return swaps wordt als volgt bewaard:

Type	Marktwaaarde USD
Contanten	3.015.562
	3.015.562

Looptijd van het onderpand

Verval-	Marktwaaarde USD
minder dan 1 dag	3.015.562
1 tot 7 dagen	-
1 tot 4 weken	-
1 tot 3 maanden	-
3 tot 12 maanden	-
meer dan 1 jaar	-
open looptijd	-
	3.015.562

Valuta van het onderpand

Valuta	Marktwaaarde USD
USD	3.015.562
	3.015.562

Resterende looptijd van total return swaps

Verval-	Longposities USD	Shortposities USD	Totaal USD
minder dan 1 dag	-	68.160	68.160
1 tot 7 dagen	-	2.553	2.553
1 tot 4 weken	-	970	970
1 tot 3 maanden	371.364	547.674	919.038
3 tot 12 maanden	19.997	77.684	97.681
meer dan 1 jaar	6.176.812	7.084.044	13.260.856
open looptijd	-	-	-
	6.568.173	7.781.085	14.349.258

Bijlage I – Effectenfinancieringstransacties (vervolg)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (vervolg)

Land waarin de tegenpartijen bij total return swaps zijn gevestigd

Tegenpartij	Land
J.P. Morgan	Verenigd Koninkrijk
Goldman Sachs	Verenigde Staten
Morgan Stanley	Verenigde Staten

Vereffening en clearing

Het subfonds gebruikt bilaterale vereffening en clearing met zijn tegenpartij voor total return swaps.

Hergebruik van onderpand

Eventueel voor total return swaps ontvangen onderpand wordt niet hergebruikt of herbelegd door het subfonds.

Bewaring van onderpand

Ontvangen onderpand

Onderpand ontvangen voor total return swaps wordt als volgt bewaard:

Bewaarder	Marktwaaarde USD
J.P. Morgan	1.595.000
Morgan Stanley	964.000
Goldman Sachs	456.562
	3.015.562

Toegekend onderpand

Het aandeel van het onderpand gehouden in gescheiden rekeningen of gepoolde rekeningen, of in eventuele andere rekeningen betreffende total return swaps is als volgt:

Rekeningtype	Marktwaaarde USD
Gescheiden	189.000
Gepoold	-
Overige	-
	189.000

OTC-derivaten die het subfonds afsluit in het kader van een ISDA Master-overeenkomst worden samen gesaldeerd voor onderpanddoeleinden. De bovenstaande vermeldingen voor onderpand gelden dus voor alle OTC-derivaten, en niet enkel voor total return swaps.

Rendement en kosten

Voor de op 31 maart 2021 afgesloten periode zijn de gegevens van de rendementen en kosten betreffende total return swaps als volgt:

	% van algemeen rendement	Rendement USD*
Nettorente op swaps	-	-
Netto gerealiseerd verlies	92,43%	28.488.617
Nettowijziging in niet-gerealiseerde waardevermindering	7,57%	2.331.790
	100,00%	30.820.407

* uitgedrukt in absolute termen.

Het rendement van de hierboven opgesomde total return swaps is opgenomen in 'Nettorente op swaps' dat deel uitmaakt van de Winst-en-verliesrekening.

Kosten

De kosten voor de total return swaps zijn opgenomen in de spread.



EST. 1804

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

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

GAIA 31 maart 2021 NLNL