



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Halbjahresbericht

31. März 2021

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

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

Inhalt

Schroder GAIA	5
Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland	6
Verwaltungsrat	7
Verwaltung	8
Bericht des Verwaltungsrats	9
Bericht des Anlageverwalters	10
Nettovermögensaufstellung	12
Ertrags- und Aufwandsrechnung	18
Veränderung des Nettovermögens	20
Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen	22
Anlageportfolio	26
Schroder GAIA BlueTrend	26
Schroder GAIA Cat Bond	26
Schroder GAIA Contour Tech Equity	30
Schroder GAIA Egerton Equity	31
Schroder GAIA Helix	32
Schroder GAIA M&A*	36
Schroder GAIA Sirios US Equity	37
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	39
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	40
Schroder GAIA Wellington Pagosa	41
Anmerkungen zum Abschluss	53
Gesamtkostenquote („TER“)	131
Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte	133

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

Die Gesellschaft

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

Dieser Bericht bezieht sich auf den Berichtszeitraum vom 1. Oktober 2020 bis zum 31. März 2021. Der Abschluss wurde im Einklang mit den Luxemburger Verordnungen in Bezug auf Organismen für gemeinsame Anlagen erstellt. Der letzte Termin, an dem die Anteilkurse berechnet wurden, war der 31. März 2021, der letzte Arbeitstag im Berichtszeitraum. Zum Zeitpunkt dieses Berichts stehen zehn Teilfonds innerhalb der Gesellschaft für Investitionen zur Verfügung (die „Teilfonds“).

Die Anlageziele der Teilfonds sowie Angaben zu Anlagebeschränkungen finden Sie im aktuellen Verkaufsprospekt. Den Bericht des Anlageverwalters für den jeweiligen Teilfonds finden Sie in den vierteljährlichen Anlageberichten, die am Sitz der Gesellschaft und auf der Website von Schroder Investment Management (Europe) S.A. erhältlich sind (<http://www.schroders.lu>).

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

Corporate Governance

Die Gesellschaft unterliegt der Corporate Governance beruhend auf:

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

Interne Kontroll- und Risikomanagementsysteme

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

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

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

Zusätzliche Informationen für Investoren in der Bundesrepublik Deutschland

Zahl- und Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

UBS Europe SE

OpernTurm

Bockenheimer Landstraße 2-4

D-60306 Frankfurt am Main

Weitere Informationsstelle in der Bundesrepublik Deutschland

Schroder Investment Management GmbH

Taunustor 1

D-60310 Frankfurt am Main

Die am Geschäftssitz der Gesellschaft zur Einsichtnahme verfügbaren Unterlagen (der ausführliche Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung, die Jahres- und Halbjahresberichte) stehen auch bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle und der weiteren deutschen Informationsstelle kostenlos in Papierform zur Verfügung.

Wertpapierbestandsveränderungen

Eine Aufstellung der Wertpapierbestandsveränderungen im Berichtszeitraum kann kostenlos am Geschäftssitz der Gesellschaft sowie bei der deutschen Zahl- und Informationsstelle und bei der weiteren deutschen Informationsstelle angefordert werden.

Verwaltungsrat

Verwaltungsratsvorsitzender

- **Eric Bertrand**

Head of Schroders GAIA

Vaults 13-16
Valletta Waterfront
FRN 1914
Malta

Andere Verwaltungsratsmitglieder

- **Carla Bergareche**

Head of Iberian Business

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

- **Mike Champion**

Head of Product Development

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

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

Independent Director

19, rue de Bitbourg, 1273 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

- **Bernard Herman**

Independent Director

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

- **Achim Kuessner**

Country Head Germany, Austria & CEE

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

- **Hugh Mullan**

Independent Director

5, rue Hohenhof, 1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

- **Neil Walton**

Head of Investment Solutions

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

Verwaltung

Eingetragener Sitz

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft, Register- und Domizilstelle

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, 1736 Senningerberg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptzahlstelle und Transferstelle

HSBC Continental Europe, Luxembourg

16, boulevard d'Avranches, 1160 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Depotbank und Fondsverwalter

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

80, route d'Esch, 1470 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Hauptrechtsberater

Arendt & Medernach S.A.

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

Unabhängiger Abschlussprüfer

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative

2, rue Gerhard Mercator, 2182 Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter

BennBridge Ltd.

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

Contour Asset Management, LLC

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

Egerton Capital (UK) LLP

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

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

- Egerton Capital (US), LP.

Schroder Investment Management Limited

1 London Wall Place, London EC2Y 5AU
Vereinigtes Königreich
Schroder GAIA Helix
Schroder GAIA M&A*

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

- BennBridge Ltd.

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

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

Sirios Capital Management LP

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

Systematica Investments Limited

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

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

- Systematica Investments UK LLP,

- Systematica Investments Jersey Limited,

- Systematica Investments GP Limited, Niederlassung Genf, und

- Systematica Investments Singapore PTE.

Two Sigma Advisers LP

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

Wellington Management International Limited

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

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

- Wellington Management Company LLP.

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

Bericht des Verwaltungsrats

Einleitung

Der Verwaltungsrat der Gesellschaft legt hiermit seinen Bericht und den Abschluss für den Berichtszeitraum zum 31. März 2021 vor.

Aktivitäten während des Berichtszeitraums

Zum 31. März 2021 belief sich das Nettovermögen der Gesellschaft insgesamt auf 5.180.821.032 EUR, was im Vergleich zu 4.869.786.470 EUR zum 30. September 2020 einem Anstieg von 6,39 % entspricht.

1. Neue Teilfonds

Während des Berichtszeitraums wurde 1 neuer Teilfonds für Anlagen innerhalb der Gesellschaft zur Verfügung gestellt:

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA M&A	USD	29. Januar 2021

2. Neue Anteilsklassen

Zusätzlich zu den 12 im vorstehend aufgeführten Teilfonds zum jeweiligen Auflegungsdatum aufgelegten Anteilsklassen wurden während des Berichtszeitraums außerdem folgende Anteilsklassen neu angeboten:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA BlueTrend			
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	USD	USD	21. Januar 2021
Schroder GAIA Cat Bond			
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	USD	11. Dezember 2020
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	USD	29. Januar 2021

3. Auflösungen von Anteilsklassen

Während des Berichtszeitraums wurde die folgende Anteilsklasse aufgelöst:

Teilfonds und Anteilsklasse	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflösungsdatum
Schroder GAIA Egerton Equity			
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	JPY	EUR	24. März 2021

Der Verwaltungsrat

Schroder GAIA
31. März 2021

Bericht des Anlageverwalters

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

Wirtschaftlicher Rückblick

Während des sechsmonatigen Berichtszeitraums kam es zu einer ermutigenden Wende in der Covid-19-Pandemie, nachdem im November die Entdeckung erfolgreicher Impfstoffe gemeldet worden war. Das andere wichtige Ereignis, das ebenfalls im November stattfand, war die US-Präsidentschaftswahl, die der demokratische Kandidat Joe Biden für sich entscheiden konnte. Auch bei der Stichwahl für die Senatorenposten für den US-Bundesstaat Georgia errangen die Demokraten im Januar einen Sieg, so dass die Partei nun das Weiße Haus, den Senat und das Repräsentantenhaus kontrolliert.

Der deutliche Wahlsieg der Demokraten ebnete den Weg für umfangreiche fiskalpolitische Anreizmaßnahmen. Im März wurde ein 1,9 Bio. USD schweres Coronavirus-Rettungspaket verabschiedet, das die wirtschaftliche Erholung vom pandemiebedingten Abschwung beschleunigen soll. Die BIP-Daten belegten, dass die US-Wirtschaft im Jahr 2020 um 3,5 % geschrumpft war. Auch im Hinblick auf die Impfung der Bevölkerung gegen Covid-19 waren die USA unter den großen Wirtschaftsnationen führend. Präsident Biden gab das Ziel vor, innerhalb der ersten 100 Tage seiner Amtszeit 100 Millionen Impfdosen zu verabreichen. Nachdem das ursprüngliche Ziel vorzeitig erreicht worden war, erhöhte er die Vorgabe auf 200 Millionen Dosen.

Das Vereinigte Königreich war ein weiteres bedeutendes Wirtschaftszentrum, das seine Impfkampagne schnell in Gang brachte. Das Land verbrachte einen Großteil des Berichtszeitraums im Lockdown, nachdem im Herbst und Winter eine Welle von Covid-19-Infektionen das Land überflutet hatte. Die Wirtschaft verzeichnete für das Jahr einen Rückgang um 9,8 %. Da die Lockdowns jedoch die Übertragungsraten senkten und die Impfkampagne zügig umgesetzt wurde, war die Regierung im Frühjahr in der Lage, einen Plan für die Wiedereröffnung der stillgelegten Wirtschaftszweige vorzulegen. Das andere bedeutende Ereignis für das Vereinigte Königreich war die kurz vor Ablauf der Brexit-Übergangszeit am 1. Januar 2021 erreichte Einigung auf ein neues Handels- und Kooperationsabkommen mit der EU.

In den EU-Ländern fiel das Tempo der Covid-19-Impfungen uneinheitlich aus. Allgemein verlief die Umsetzung der Impfprogramme dort jedoch langsamer als in den USA und dem Vereinigten Königreich. Während die meisten Länder weiterhin in irgendeiner Form Einschränkungen unterworfen waren, ließen sich auch hier erhebliche Unterschiede von Land zu Land bzw. von Region zu Region erkennen. Die Daten ließen erkennen, dass die Wirtschaft der Eurozone im Jahr 2020 um 6,6 % geschrumpft war. In Italien kam es während des Berichtszeitraums zu einem politischen Wechsel, nachdem die Mitte-Links-Koalition unter Giuseppe Conte zusammengebrochen war. Mario Draghi, der ehemalige Präsident der Europäischen Zentralbank, übernahm die Führung an der Spitze einer Einheitsregierung.

China war das erste Land, das Anfang 2020 von der Pandemie heimgesucht worden war. Allerdings war es dem Land bis zum Beginn des Berichtszeitraums gelungen, das Virus weitgehend einzudämmen. Daher meldete China für das Jahr ein positives BIP-Wachstum, im Zuge dessen die Wirtschaft 2020 um 2,3 % zulegte. Die Handelsspannungen hielten während des Berichtszeitraums an. Allerdings kam angesichts der Veränderungen in der politischen Landschaft der USA Hoffnung auf eine Änderung des Tonfalls auf. Während des Berichtszeitraums ließen sich zudem Anzeichen auf eine verschärfte Regulierung chinesischer Finanztechnologiefirmen ausmachen, was zur Folge hatte, dass der Börsengang der Ant Group abgesehen wurde.

Überblick über die Entwicklung am Aktienmarkt

Während des sechsmonatigen Berichtszeitraums verbuchten globale Aktien gemessen am MSCI World Index extrem starke Zugewinne in Höhe von 19,6 % (Quelle: FactSet, Nettogesamtrendite in US-Dollar). In Kombination mit den anhaltenden geld- und fiskalpolitischen Anreizmaßnahmen der Regierungen und Zentralbanken trieben Meldungen über Impfstoffe die Aktienkurse in die Höhe. Insbesondere die Hoffnung, dass die stillgelegten Teile der Wirtschaft in Kürze wiedereröffnen würden, löste im November eine starke Erholung in Branchen wie etwa dem Reisesektor aus.

Auf globaler Ebene erzielte der Energiesektor während des sechsmonatigen Berichtszeitraums die stärkste Wertentwicklung. Im Frühjahr 2020 waren die Ölpreise stark eingebrochen, da die Covid-Krise die Ölnachfrage belastet hatte. Angesichts der Impfstoffmeldungen stiegen die Ölpreise aufgrund von Erwartungen, dass sich die Nachfrage wieder normalisieren würde. Auch der Finanzsektor entwickelte sich überdurchschnittlich. Insbesondere Banken hatten in der ersten Phase der Covid-Krise aufgrund von Sorgen über mögliche Insolvenzen Kursverluste hinnehmen müssen. Die Aufsichtsbehörden in mehreren Ländern untersagten Ausschüttungen an Aktionäre, um sicherzustellen, dass die Banken über ausreichende Kapitalpolster zur Bewältigung einer möglichen Insolvenzwelle verfügten. Auch hier ließen Impfstoffe Hoffnung auf eine Rückkehr zu normalen Betriebsbedingungen aufkommen.

Zuden Sektoren, die sich unterdurchschnittlich entwickelten, zählten hingegen defensive Teile des Marktes wie die Bereiche Basiskonsumgüter und Gesundheit. Titel aus dem Bereich der nicht-zyklischen Konsumgüter wie z. B. Supermärkte und Lebensmittelhersteller waren allgemein nur begrenzt durch das Virus belastet worden. Angesichts der Erwartungen einer baldigen Erholung der Weltwirtschaft bevorzugten Anleger andere Segmente des Marktes, die mit höherer Wahrscheinlichkeit von dieser Erholung profitieren würden.

An anderer Stelle löste die plötzliche Wiedereröffnung verschiedener Teile der Weltwirtschaft vereinzelt Nachfragespitzen sowie gewisse Angebotsengpässe aus. Ein Paradebeispiel hierfür war der Halbleitersektor, der eine starke Nachfrage aus verschiedensten Endmärkten verzeichnete, unter anderem von Automobil- und Mobiltelefonherstellern.

Auch Schwellenmarktaktien erzielten während des Berichtszeitraums eine robuste Rendite. Der MSCI Emerging Markets Index verbuchte eine Rendite von 22,4 % (Quelle: FactSet, Nettogesamtrendite in US-Dollar). Chile erzielte innerhalb des Index die stärkste Wertentwicklung, was neben einer Rally bei den Kupferpreisen auch einer zügigen Impfkampagne zu verdanken war. Thailand und die VAE verbuchten in Erwartung einer Erholung des Tourismussektors starke Zugewinne, während Russland von höheren Rohölpreisen profitierte.

Die Türkei hingegen fiel zurück, nachdem der Gouverneur der Zentralbank überraschend ersetzt worden war, was einen starken Einbruch der Währung sowie der Aktien des Landes auslöste. China erzielte in US-Dollar gemessen zweistellige Zugewinne, entwickelte sich jedoch unterdurchschnittlich. Nach einer zuvor starken Entwicklung trübten Erwartungen einer politischen Normalisierung, aufsichtsrechtliche Ungewissheit in bestimmten Branchen und anhaltende geopolitische Sorgen die Stimmung ein wenig ein.

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

Bericht des Anlageverwalters (Forts.)

Überblick über die Entwicklung am Anleihemarkt

In den sechs Monaten bis Ende März kam es zu einer deutlichen Verbesserung des konjunkturellen Ausblicks. Die Entwicklung von Covid-19-Impfstoffen im letzten Quartal 2020 trug erheblich dazu bei, die Stimmung unter den Anlegern aufzuhellen. Dies hatte zur Folge, dass mit höherem Risiko behaftete Anlagen starke Zugewinne verbuchten, während die Renditen auf Staatsanleihen anstiegen.

Bei den im November abgehaltenen US-Wahlen konnten die Demokraten einen entscheidenden Sieg erringen. In den folgenden Monaten nahm der Optimismus über ein potenziell umfangreiches fiskalpolitisches US-Konjunkturpaket zu, das schließlich im März verabschiedet wurde. Dies führte zu einem erheblichen Abverkauf bei den Renditen auf Staatsanleihen, was steigende Wachstums- und Inflationserwartungen widerspiegelte. Einige Anleger begannen, die Möglichkeit unerwartet früher Zinserhöhungen zu berücksichtigen. Die Rendite auf 10-jährige US-Staatsanleihen stieg von 0,68 % auf 1,75 %, wobei sowohl im Februar als auch im März jeweils ein Anstieg um mehr als 30 Basispunkte (Bp) verzeichnet wurde.

Die Rendite auf zehnjährige britische Titel stieg während des Berichtszeitraums um 69 Bp auf 0,88 %. Das Vereinigte Königreich brachte Ende 2020 seinen Austritt aus der EU in relativ geordneter Manier zum Abschluss. Die Regierung sicherte sich einen großen Vorrat an Impfstoffen und verpflichtete sich zu einer schnellen Umsetzung der Impfkampagne.

In Europa stiegen die Renditen weniger stark an. Vor dem Hintergrund einer „dritten Pandemiewelle“ und anhaltender Lockdowns in verschiedenen Ländern tat sich die Region bei der Umsetzung ihres Impfprogramms schwer. Die Rendite auf zehnjährige deutsche Staatsanleihen stieg von -0,52 % auf -0,33 %. In Italien wurde ein Rückgang um 15 Bp auf 0,63 % verzeichnet, was Optimismus über die Ankündigung des EU-Wiederaufbaufonds gegen Ende des Jahres 2020 widerspiegelte. Seit Jahresbeginn haben die Renditen allerdings wieder um 11 Bp zugelegt.

Unternehmensanleihen übertrafen ihre staatlichen Pendanten, und Hochzinstitel erzielten Zugewinne. Investment-Grade-Werte verbuchten während des Berichtszeitraums negative Gesamrenditen in Höhe von -0,7 % (in Lokalwährung), da ein Anstieg der Renditen im ersten Quartal 2021 dazu führte, dass die Erträge in den negativen Bereich abrutschten. Hochzinsanleihen legten um 7,2 % zu (Quelle: ICE BofAML).

Ausblick

Die Wirtschaftsexperten von Schroders rechnen für 2021 mit einem weltweiten BIP-Wachstum von 5,3 %, gefolgt von 4,6 % im Jahr 2022. Im Jahr 2021 wird die verstärkte Fiskalpolitik der USA Unterstützung bieten. In der Eurozone dürfte das Wachstum jedoch durch einen verlängerten Lockdown und die langsame Verabreichung von Impfstoffen belastet werden. Um einen Kontext für den Wachstumsausblick zu bieten: Nachdem das weltweite BIP 2020 um fast 4 % zurückgegangen ist, wird für 2021 eine der stärksten jemals verzeichneten Erholungen der Weltwirtschaft erwartet, die den Aufschwung im Nachgang der globalen Finanzkrise übertreffen dürfte.

Das stärkere Wachstum geht mit einer erhöhten Inflation einher, die in erster Linie durch gestiegene Öl- und Rohstoffpreise verursacht wird. Die Wirtschaftsexperten von Schroders gehen davon aus, dass die weltweite Verbraucherpreis-inflation in diesem Jahr auf 2,6 % ansteigen wird, bevor sie 2022 wieder auf 2,4 % zurückgeht.

Hinsichtlich der Geldpolitik bietet die Weltwirtschaft genügend Spielraum, um einen im Zuge der Wiedereröffnung der Wirtschaft zu erwartenden starken anfänglichen Wiederanstieg der globalen Nachfrage zu bewältigen. Im Hinblick auf die USA gehen die Volkswirte davon aus, dass die US-Notenbank ihre Zinsen weder in diesem noch im kommenden Jahr anheben wird. Ein solcher Schritt dürfte frühestens Ende 2023 zu erwarten sein.

In diesem Jahr dürfte der Industriesektor, der das Wachstum bislang gestützt hat, diese Rolle an den Dienstleistungssektor übergeben, während Impfungen einen gewissen Grad an Normalisierung und die Wiedereröffnung dieses wichtigen Teils der Wirtschaft ermöglichen. Eine Folge hiervon dürfte sein, dass die kommende Erholung voraussichtlich stärker von den dienstleistungsabhängigen fortgeschrittenen Wirtschaftsräumen getragen wird als nach der globalen Finanzkrise.

Zudem profitieren die Schwellenländer im Vergleich zu der Zeit vor zehn Jahren nicht von einer enormen fiskalpolitischen Unterstützung aus China. Darüber hinaus haben sie aufgrund ihres schlechteren Zugangs zu medizinischer Versorgung und Impfstoffen stärker mit der Pandemie zu kämpfen als ihre wohlhabenderen Nachbarländer.

Die Anlageverwalter

Schroder GAIA

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 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
VERMÖGENSWERTE					
Anlagen					
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	115.179.221	1.804.454.778	308.965.686	731.942.426	392.624.033
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)	895.988	(999.453)	40.633.214	200.477.747	35.779.571
Wertpapiere zum Marktwert	116.075.209	1.803.455.325	349.598.900	932.420.173	428.403.604
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)					
aus Devisenterminkontrakten	(1.582.751)	(11.822.992)	(1.624.064)	(18.202.804)	(3.335.660)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	177.904	-	-	-	(277.601)
aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit-Default-Index-Swap-Kontrakten	3.762.900	-	-	-	-
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	(788.267)	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	29.725.481	10.981.932
aus Differenzkontrakten	596.649	-	12.372.716	-	1.734.717
	2.166.435	(11.822.992)	10.748.652	11.522.677	9.103.388
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	261.102	9.159	5.248.044	27.406.203	5.838.431
Bankguthaben	15.657.891	46.705.573	36.876.242	7.771.668	82.585.920
Termineinlagen	-	-	-	-	-
Broker-Einschusskonto	2.436.830	-	-	-	5.643.678
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	11.099.948	41.720.000	35.501.336	41.620.101	-
Forderungen aus Zeichnungen	1.743.231	6.922.617	-	-	7.711.628
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	466.321	573	337.791
Dividenden und Zinsforderungen	759.090	12.665.726	270.711	775.723	3.993.903
Erstattungsforderung des Fonds	45.032	-	-	-	4.556
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	222.949	8.170.000	1.000.000	-	980.000
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	270.000	90.000	220.000	2.560.000	80.000
Sonstige Forderungen	-	-	-	9.259.744	-
GESAMTVERMÖGEN	150.737.717	1.907.915.408	439.930.206	1.033.336.862	544.682.899
VERBINDLICHKEITEN					
Anlagen					
Leerverkäufe, Erlöse erhalten	-	-	-	-	183.558
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)	-	-	-	-	849
Wertpapiere zum Marktwert	-	-	-	-	184.407
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	2.599.152	25.359.792	3.452.718	11.323.063	33.793.818
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Anteilen	233.943	4.211.476	-	-	1.600
Fällige Managementgebühren	149.582	1.578.075	482.795	1.264.570	171.189
Fällige Performancegebühren	62.112	-	7.784.000	5.868.556	3.842.433
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	5.095	-	1.333.179	646.905	698.649
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	-	-	5.139.140
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	2.560.000	-
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	492.949	8.260.000	1.220.000	-	1.060.000
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	2.381.790	42.465.740	5.794.857	1.175.821	4.867.869
SUMME VERBINDLICHKEITEN	5.924.623	81.875.083	20.067.549	22.838.915	49.759.105
SUMME NETTOVERMÖGEN	144.813.094	1.826.040.325	419.862.657	1.010.497.947	494.923.794

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2021 (Forts.)

	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	Summe** EUR
VERMÖGENSWERTE						
Anlagen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	5.243.571	322.489.006	464.975.042	29.609.804	354.702.723	3.980.389.737
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)	(2.906)	63.181.959	72.098	127.058	23.144.589	339.371.090
Wertpapiere zum Marktwert	5.240.665	385.670.965	465.047.140	29.736.862	377.847.312	4.319.760.827
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	12.233	(634.496)	772.665	(215.486)	(80.391)	(34.057.263)
aus Kassageschäften	-	-	27.183	-	-	23.180
aus Terminkontrakten	(470)	-	8.007.609	8.430	471.646	7.155.035
aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(261.063)	(222.617)
aus Credit-Default-Index-Swap-Kontrakten	-	-	(148.063)	-	(294.231)	2.831.590
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	2.664.519	2.272.123
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	1.103.554	268.856
aus Total Return Swaps	-	(5.559.610)	18.587.592	-	533.487	50.654.449
aus Differenzkontrakten	16.173	-	-	74.904	-	12.640.503
	27.936	(6.194.106)	27.246.986	(132.152)	4.137.521	41.565.856
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren	10.179	808.165	158.599.392	104.752	48.539.383	214.545.514
Bankguthaben	5.736.579	36.409.486	358.085.435	2.847.690	32.685.193	535.330.420
Termineinlagen	-	-	161.573.700	-	-	137.779.228
Broker-Einschusskonto	11.040	-	62.031.917	-	23.116.048	79.508.411
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	10.000	10.030.000	19.314.305	1.813.296	48.845.828	185.750.081
Forderungen aus Zeichnungen	-	1.921.118	-	-	-	15.603.815
Optionen und Swaptions zum Marktwert	550	-	-	78.407	4.353.306	4.491.116
Dividenden und Zinsforderungen	3.187	232.059	30.301	48.944	1.418.718	17.353.850
Erstattungsforderung des Fonds	-	-	-	-	-	42.285
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	720.000	1.443.278	80.000	700.000	11.381.014
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	60.000	1.260.000	20.000	330.000	4.553.325
Sonstige Forderungen	-	-	-	-	-	9.259.744
GESAMTVERMÖGEN	11.040.136	429.657.687	1.254.632.454	34.597.799	541.973.309	5.576.925.486
VERBINDLICHKEITEN						
Anlagen						
Leerverkäufe, Erlöse erhalten	-	-	-	-	-	156.526
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)	-	-	-	-	-	724
Wertpapiere zum Marktwert	-	-	-	-	-	157.250
Verbindlichkeiten aus dem Ankauf von Wertpapieren	4.060.613	2.980.723	163.107.965	-	49.222.785	253.991.751
Verbindlichkeiten aus der Rücknahme von Anteilen	-	21.390.137	-	80.675	-	22.127.036
Fällige Managementgebühren	75	615.538	1.469.772	23.254	546.838	5.567.394
Fällige Performancegebühren	-	46.378	-	754.492	5.252.011	21.240.839
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	7.868	517.233	647.016	5.193	690.717	3.978.461
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	-	-	-	4.382.314
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	-	2.560.000
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	780.000	2.703.278	100.000	1.030.000	13.374.339
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	5.303	4.306.444	13.716.464	79.200	5.567.352	68.725.070
SUMME VERBINDLICHKEITEN	4.073.859	30.636.453	181.644.495	1.042.814	62.309.703	396.104.454
SUMME NETTOVERMÖGEN	6.966.277	399.021.234	1.072.987.959	33.554.985	479.663.606	5.180.821.032

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

** Für die in Euro angegebene Summe der Nettovermögensaufstellung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 31. März 2021 umgerechnet: 1 Euro = 1,17270 US-Dollar und 1 Euro = 0,85065 Pfund Sterling.

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2021 (Forts.)

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2021 (Forts.)

	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
Nettoinventarwert					
zum 31. März 2021	6.966.277	399.021.234	1.072.987.959	33.554.985	479.663.606
Im Umlauf befindliche Anteile**					
zum 31. März 2021					
Klasse A Thes.	15	845.927	-	-	122.508
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	100	7.285	-	-	1.873
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	100	194.622	-	-	106.819
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	16.833
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	15
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	15	813.714	3.531.336	2.812	2.193.182
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	-	131.345
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	100	14.912	80.755	1.022	30.817
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	100	422.646	2.033.255	113.706	809.821
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	100	64.438	2.000.746	-	426.689
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	96
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	20.673	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	-	3.291	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	1
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	6
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	43
Klasse E Thes.	15	2.620	-	-	51.825
Klasse E Thes. CHF	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	100	-	-	-	54.007
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	100	25.516	-	-	171.570
Klasse E Thes. GBP	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	100	-	-	-	77.869
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	96
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	68.704	15	15	15	15
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch. QV	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	1.100.844	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	3.174	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	100.747	95	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	77	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	131.801	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	27.965	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	7.597	-
Klasse X Thes.	-	15	-	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	168.216	-	-	-

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2021 (Forts.)

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2021 (Forts.)

	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
Nettoinventarwert je Anteil**					
zum 31. März 2021					
Klasse A Thes.	99,75	147,01	-	-	108,72
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	99,46	175,66	-	-	100,77
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	99,55	132,33	-	-	101,64
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	149,60
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	107,32
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	99,87	153,44	111,42	112,07	110,76
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	-	-	-	-	108,86
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	99,58	181,10	100,79	141,67	102,75
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	99,67	137,71	102,68	126,78	103,59
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	99,78	143,24	106,49	-	85,10
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	152,48
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	149,48	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	-	143,14	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	5.541,13
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	5.135,24
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	5.177,41
Klasse E Thes.	99,91	163,74	-	-	112,53
Klasse E Thes. CHF	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	99,62	-	-	-	104,15
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	99,71	147,61	-	-	105,12
Klasse E Thes. GBP	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	99,82	-	-	-	86,43
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	154,94
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	99,96	196,11	128,81	117,84	117,51
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch. QV	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	109,15	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	98,70	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	100,41	124,66	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	146,94	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	112,02	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	126,81	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	149,49	-
Klasse X Thes.	-	101,46	-	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	146,56	-	-	-

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

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Berichtszeitraum zum 31. März 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
ERTRÄGE					
Nettoausschüttungen	-	-	-	282.691	6.603.640
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	856.651	40.506.712	-	-	109.970
Nettoertrag aus Swaps	726.836	-	-	-	-
Bankzinsen	79	274	4.453	-	-
Sonstige Erträge	81.864	-	-	-	-
Erträge insgesamt	1.665.430	40.506.986	4.453	282.691	6.713.610
AUFWAND					
Performancegebühren	62.112	-	7.784.000	5.895.379	3.842.454
Managementgebühren	661.147	7.937.930	2.130.694	7.013.938	748.923
Nettodividendenaufwand	-	-	1.871.782	-	-
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	987.804	1.302.160	1.062.086
Verwahrstellengebühren	40.771	208.312	42.266	131.996	62.413
Verwaltungsgebühren	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
Vertriebsgebühren	-	-	10.779	51.153	-
Abschreibung des Gründungsaufwands	3.770	-	-	-	-
Bank- und Zinskosten	16.798	3.775	26	188.642	26.279
Sonstige Aufwendungen	35.166	251.072	88.224	1.404.533	89.529
Aufwendungen insgesamt	1.038.453	9.748.393	13.526.498	17.805.148	6.119.429
Abzüglich: Kostenzuschüsse	(45.032)	-	-	-	(4.556)
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	672.009	30.758.593	(13.522.045)	(17.522.457)	598.737

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Ertrags- und Aufwandsrechnung für den Berichtszeitraum zum 31. März 2021 (Forts.)

	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	Summe** EUR
ERTRÄGE						
Nettoausschüttungen	-	1.310.605	248	300.556	541.268	7.846.524
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	-	406.048	58.801	178.483	2.267.767	37.905.693
Nettoertrag aus Swaps	-	-	-	-	-	619.797
Bankzinsen	39	5.582	-	-	198	9.060
Sonstige Erträge	-	52.460	-	-	9.749	122.856
Erträge insgesamt	39	1.774.695	59.049	479.039	2.818.982	46.503.930
AUFWAND						
Performancegebühren	-	46.378	-	754.492	5.252.011	21.267.679
Managementgebühren	137	3.713.603	9.282.878	194.215	3.192.029	30.835.108
Nettodividendenaufwand	206	-	-	-	-	1.596.306
Nettoaufwand aus Swaps	3.635	2.069.794	6.624.193	166.253	1.860.370	12.248.761
Verwahrstellengebühren	843	64.517	168.179	7.485	128.787	751.427
Verwaltungsgebühren	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
Vertriebsgebühren	-	-	-	-	4	60.348
Abschreibung des Gründungsaufwands	-	-	-	-	-	3.215
Bank- und Zinskosten	-	150	183.163	1.984	60.514	438.868
Sonstige Aufwendungen	249	112.022	341.287	12.426	135.415	2.317.038
Aufwendungen insgesamt	6.091	6.885.876	18.873.138	1.208.269	11.548.650	76.995.263
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	-	-	-	-	(42.286)
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)	(6.052)	(5.111.181)	(18.814.089)	(729.230)	(8.729.668)	(30.449.047)

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

** Für die in Euro angegebene Summe der Ertrags- und Aufwandsrechnung wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 31. März 2021 umgerechnet: 1 Euro = 1,17270 US-Dollar und 1 Euro = 0,85065 Pfund Sterling.

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Veränderung des Nettovermögens für den Berichtszeitraum zum 31. März 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
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)***	672.009	30.758.593	(13.522.045)	(17.522.457)	598.737
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)					
aus verkauften Wertpapieren	230.318	(6.877.147)	62.767.036	121.874.512	29.001.189
aus Devisenterminkontrakten	5.165.501	(9.128.190)	1.447.457	(232.439)	3.311.251
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	4.309.906	-	(647)	-	(15.895.266)
aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit-Default-Index-Swap-Kontrakten	(2.231.834)	-	-	-	-
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	(1.215.556)	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	(106.006.687)	(108.822.802)
aus Differenzkontrakten	-	-	(33.938.523)	-	105.935.170
aus Optionen und Swaptions	418.573	-	1.658.197	(271.635)	(2.871.730)
aus Devisen und sonstigem Nettovermögen	276.639	(217.048)	66.378	(5.369.750)	1.153.693
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	6.953.547	(16.222.385)	31.999.898	9.994.001	11.811.505
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs/(Wertverlustes)					
aus Anlagen	6.607.528	10.122.129	5.836.362	36.007.708	28.326.917
aus Devisenterminkontrakten	(958.860)	(12.369.325)	(2.116.436)	(12.558.692)	(3.081.054)
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	(650.494)	-	-	-	(1.118.363)
aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Credit-Default-Index-Swap-Kontrakten	2.245.623	-	-	-	-
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-
aus Zins-Swap-Kontrakten	98.110	-	-	-	-
aus Total Return Swaps	-	-	-	15.765.553	3.755.966
aus Differenzkontrakten	684.540	-	10.123.992	-	3.609.927
aus Optionen und Swaptions	784	-	(309.800)	98.204	(30.883)
aus Devisen und sonstigem Nettovermögen	24.116	(51.974)	(601)	2.484	(68.968)
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	8.051.347	(2.299.170)	13.533.517	39.315.257	31.393.542
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	15.676.903	12.237.038	32.011.370	31.786.801	43.803.784
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	51.348.091	695.532.256	206.043.591	99.375.150	84.156.600
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(10.149.826)	(124.938.761)	(47.487.754)	(136.117.809)	(37.225.124)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	(233.016)	-	-	-
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Berichtszeitraums	56.875.168	582.597.517	190.567.207	(4.955.858)	90.735.260
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	87.937.926	1.243.442.808	229.295.450	1.015.453.805	404.188.534
Nennwährungsanpassung****	-	-	-	-	-
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS	144.813.094	1.826.040.325	419.862.657	1.010.497.947	494.923.794

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

**** Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2020 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 31. März 2021.

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Veränderung des Nettovermögens für den Berichtszeitraum zum 31. März 2021 (Forts.)

	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	Summe** EUR
NETTOANLAGEERTRAG/(-VERLUST)***	(6.052)	(5.111.181)	(18.814.089)	(729.230)	(8.729.668)	(30.449.047)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	32.991	90.973.571	776.145	151.529	51.707.451	316.997.266
aus Devisenterminkontrakten	(1.349)	737.673	17.726.461	(1.802.368)	12.024.361	24.324.925
aus Kassageschäften	-	-	449.533	-	-	383.332
aus Terminkontrakten	(4.600)	(287)	36.783.690	(412.770)	3.510.528	23.991.029
aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(764.848)	(652.211)
aus Credit-Default-Index-Swap-Kontrakten	-	-	619.941	-	(574.432)	(1.864.352)
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(1.186.345)	(1.011.636)
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	1.699.842	412.967
aus Total Return Swaps	-	(48.715.545)	(114.900.932)	-	(28.488.617)	(362.617.839)
aus Differenzkontrakten	(27.798)	-	-	430.499	-	61.876.299
aus Optionen und Swaptions	(1.825)	-	-	(111.775)	(2.909.006)	(3.563.086)
aus Devisen und sonstigem Nettovermögen	(12.545)	1.602.642	(37.875)	2.868	4.077.064	525.110
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	(15.126)	44.598.054	(58.583.037)	(1.742.017)	39.095.998	58.801.804
Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)						
aus Anlagen	(2.906)	13.448.351	(253.857)	7.612.584	13.643.502	111.238.145
aus Devisenterminkontrakten	12.233	(1.547.001)	(7.187.078)	192.445	(5.761.952)	(40.480.725)
aus Kassageschäften	-	-	30.977	-	-	26.415
aus Terminkontrakten	(470)	-	7.078.825	27.520	718.026	5.172.221
aus Credit-Default-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(782.320)	(667.110)
aus Credit-Default-Index-Swap-Kontrakten	-	-	(273.763)	-	(120.678)	1.578.564
aus Cross-Currency-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	4.496.224	3.834.079
aus Zins-Swap-Kontrakten	-	-	-	-	1.524.278	1.383.464
aus Total Return Swaps	-	(8.662.289)	22.434.784	-	(2.331.790)	28.724.256
aus Differenzkontrakten	16.173	-	-	159.218	-	12.496.060
aus Optionen und Swaptions	(6.535)	-	-	(22.843)	(886.828)	(980.293)
aus Devisen und sonstigem Nettovermögen	47	(6.117)	(95.949)	-	(3.073.328)	(2.788.319)
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	18.542	3.232.944	21.733.939	7.968.924	7.425.134	119.536.757
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	(2.636)	42.719.817	(55.663.187)	5.497.677	37.791.464	147.889.514
Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen	6.968.913	59.701.497	150.194.308	399.010	58.423.440	1.218.944.332
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	-	(199.829.209)	(458.682.725)	(25.574.145)	(168.441.670)	(1.058.784.810)
Ausschüttungen von Nettoanlageerträgen	-	-	-	-	-	(198.700)
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Berichtszeitraums	6.966.277	(97.407.895)	(364.151.604)	(19.677.458)	(72.226.766)	307.850.336
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	-	496.429.129	1.437.139.563	53.232.443	551.890.372	4.869.786.470
Nennwährungsanpassung****	-	-	-	-	-	3.184.226
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS	6.966.277	399.021.234	1.072.987.959	33.554.985	479.663.606	5.180.821.032

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

** Für die in Euro angegebene Summe der Veränderung des Nettovermögens wurden die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten, die in einer anderen Währung als dem Euro angegeben wurden, mit den folgenden Wechselkursen vom 31. März 2021 umgerechnet: 1 Euro = 1,17270 US-Dollar und 1 Euro = 0,85065 Pfund Sterling.

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

**** Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2020 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 31. März 2021.

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen

	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	80,16	98,76	-	-	30,99
Sonstige Wertpapiere					
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	-	-	-
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	-
Fluggesellschaften	-	-	-	-	-
Bekleidung	-	-	-	-	-
Automobilhersteller	-	-	-	-	-
Autoteile und -zubehör	-	-	-	-	0,24
Banken	-	-	-	0,72	8,86
Getränke	-	-	-	-	0,30
Biotechnologie	-	-	-	-	0,01
Baustoffe	-	-	-	0,89	0,33
Chemie	-	-	-	4,18	1,04
Gewerbliche Dienstleistungen	-	-	3,97	5,13	0,21
Computer	-	-	5,66	-	0,70
Vertrieb und Großhandel	-	-	-	-	-
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	-	6,36	2,05
Elektrik	-	-	-	-	0,02
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	0,60
Elektronik	-	-	4,10	-	1,27
Energie - Alternative Energiequellen	-	-	-	-	0,04
Bau- und Ingenieurwesen	-	-	-	-	0,03
Unterhaltung	-	-	-	-	-
Umweltschutz	-	-	-	-	0,12
Lebensmittel	-	-	-	-	1,68
Gas	-	-	-	-	-
Gesundheitswesen - Produkte	-	-	-	-	0,16
Gesundheitswesen - Dienstleistungen	-	-	-	3,04	0,72
Holdinggesellschaften - Diversifiziert	-	-	-	-	0,37
Wohngebäude-Bauträger	-	-	-	4,61	0,03
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	1,26
Haushaltswaren	-	-	-	-	0,63
Versicherungen	-	-	-	-	0,48
Internet	-	-	22,20	27,13	2,01
Investmentgesellschaften	-	-	-	1,96	6,39
Eisen und Stahl	-	-	-	-	0,56
Freizeit	-	-	-	-	0,18
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	-
Maschinen - Bau und Bergbau	-	-	-	-	0,65
Maschinen - Diversifiziert	-	-	-	-	0,94
Medien	-	-	6,13	8,00	-
Bergbau	-	-	-	-	1,65
Diverse Fertigungsbetriebe	-	-	-	-	0,58
Öl und Gas	-	-	-	-	5,22
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	-
Verpackung und Container	-	-	-	-	-
Pharmazeutika	-	-	-	-	1,04

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)					
Pipelines	-	-	-	-	-
Immobilien	-	-	4,64	0,49	0,16
Einzelhandel	-	-	-	4,65	1,95
Bausparkassen	-	-	-	-	-
Halbleiter	-	-	11,90	4,63	10,95
Software	-	-	24,46	6,86	1,22
Lagerung	-	-	-	-	-
Telekommunikation	-	-	0,21	3,93	0,65
Textilien	-	-	-	-	-
Spielwaren, Spiele und Hobbys	-	-	-	-	-
Transport	-	-	-	9,69	0,23
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	80,16	98,76	83,27	92,27	86,52
Termineinlagen	-	-	-	-	-
Sonstiges Nettovermögen	19,84	1,24	16,73	7,73	13,48
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	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 %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	58,14	2,55	42,87	47,15	46,80
Sonstige Wertpapiere					
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	3,40	-	-	0,07
Agrarwirtschaft	-	0,64	-	-	-
Fluggesellschaften	-	1,62	-	-	-
Bekleidung	-	-	-	-	0,09
Automobilhersteller	-	-	-	-	0,22
Autoteile und -zubehör	-	2,61	-	-	-
Banken	-	4,37	-	-	5,69
Getränke	-	1,70	-	2,08	0,22
Biotechnologie	-	-	-	-	3,26
Baustoffe	-	0,82	-	-	0,24
Chemie	1,76	2,21	-	-	0,18
Gewerbliche Dienstleistungen	3,65	8,87	-	5,32	1,36
Computer	0,88	0,90	-	3,33	0,27
Vertrieb und Großhandel	-	-	-	-	0,15
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	1,47	4,29	-	-	2,12
Elektrik	-	0,39	-	-	0,94
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	0,13
Elektronik	0,86	2,04	-	1,82	0,23
Energie - Alternative Energiequellen	-	0,11	-	-	0,02
Bau- und Ingenieurwesen	0,98	4,36	-	-	0,32
Unterhaltung	-	-	-	2,00	0,04
Umweltschutz	-	0,74	-	-	-
Lebensmittel	-	-	-	-	-
Gas	-	-	-	-	0,08
Gesundheitswesen - Produkte	-	10,06	-	2,01	1,47
Gesundheitswesen - Dienstleistungen	-	-	-	-	0,52
Holdinggesellschaften - Diversifiziert	-	-	-	-	1,08
Wohngebäude-Bauträger	-	1,60	-	-	0,19
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	-
Haushaltswaren	-	-	-	3,44	-
Versicherungen	1,00	0,20	-	-	2,91
Internet	2,58	-	-	-	0,31
Investmentgesellschaften	-	-	0,47	1,24	0,11
Eisen und Stahl	-	-	-	-	0,09
Freizeit	-	2,11	-	2,00	0,20
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	0,12
Maschinen - Bau und Bergbau	-	-	-	-	0,19
Maschinen - Diversifiziert	1,67	0,84	-	1,30	0,27
Medien	-	1,63	-	-	0,05
Bergbau	-	0,13	-	-	0,45
Diverse Fertigungsbetriebe	-	-	-	2,88	0,14
Öl und Gas	-	1,46	-	-	4,26
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	2,50	-	-	0,09
Verpackung und Container	-	1,94	-	-	-
Pharmazeutika	-	3,47	-	-	1,78

* Für nähere Angaben zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Aufteilung der Vermögensanlagen nach Branchen (Forts.)

	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 %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)					
Pipelines	-	-	-	-	0,13
Immobilien	-	0,66	-	3,11	0,29
Einzelhandel	1,02	4,84	-	3,70	0,46
Bausparkassen	-	-	-	-	0,01
Halbleiter	-	7,67	-	-	0,29
Software	1,22	7,58	-	4,52	0,39
Lagerung	-	-	-	2,72	-
Telekommunikation	-	3,09	-	-	0,11
Textilien	-	0,86	-	-	-
Spielwaren, Spiele und Hobbys	-	0,90	-	-	-
Transport	-	3,49	-	-	0,43
Anlageportfolio in Prozent des Nettovermögens	75,23	96,65	43,34	88,62	78,77
Termineinlagen	-	-	15,06	-	-
Sonstiges Nettovermögen	24,77	3,35	41,60	11,38	21,23
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

* Für nähere Angaben zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021

Schroder GAIA BlueTrend

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen			
Vereinigte Staaten		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
Summe Anleihen		105.166.006	72,63
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		105.166.006	72,63

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Sonstige Wertpapiere	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen			
Irland		10.909.203	7,53
502.728.236	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	10.909.203	7,53
Summe Anleihen		10.909.203	7,53
Summe sonstige Wertpapiere		10.909.203	7,53
Summe Kapitalanlagen		116.075.209	80,16
Sonstiges Nettovermögen		28.737.885	19,84
Nettoinventarwert		144.813.094	100,00

Schroder GAIA Cat Bond

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Anleihen			
Bermuda		616.724.733	33,77
14.563.000	3264 Re 07/02/23, variabel	15.018.094	0,82
31.250.000	Acorn Re 10/11/21, variabel	31.585.937	1,73
20.400.000	Bowline Re Series 2018-1 23/05/22, variabel	20.723.339	1,13
4.250.000	Bowline Re Series 2019- 1A 20/03/23, variabel	4.372.613	0,24
10.350.000	Bowline Re Series 2019- 1B 20/03/23, variabel	10.648.598	0,58
31.350.000	Cape Lookout Re 25/02/22, variabel	31.611.772	1,73
4.000.000	Cerulean Re SAC 08/07/21, variabel	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, variabel	17.563.874	0,96
3.000.000	FloodSmart Re Series B 07/03/22, variabel	3.010.950	0,16
6.500.000	FloodSmart Re Series A 27/02/23, variabel	6.589.375	0,36
9.750.000	FloodSmart Re Series B 27/02/23, variabel	9.884.063	0,54
4.700.000	Galileo Re Series C 08/01/24, variabel	4.751.230	0,26
3.750.000	Galileo Re Series D 08/01/24, variabel	3.803.625	0,21
2.400.000	Herbie Re 08/01/25, variabel	2.559.240	0,14
5.000.000	Integrity Re 12/06/23, variabel	5.099.750	0,28
7.750.000	Integrity Re II 12/04/23, variabel	8.080.344	0,44
19.825.000	Kilimanjaro II Re Series ** 20/04/21, variabel	19.929.080	1,09
22.000.000	Kilimanjaro II Re Series A-1 20/04/21, variabel	22.126.499	1,21
4.750.000	Kilimanjaro II Re 21/04/22, variabel	4.830.038	0,26

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
2.850.000	Kilimanjaro II Re Series * 21/04/22, variabel	2.887.763	0,16	2.800.000	Sanders Re 07/04/22, variabel	2.390.500	0,13
15.450.000	Kilimanjaro II Re Series ** 21/04/22, variabel	15.713.423	0,86	15.250.000	Sanders Re II 07/04/23, variabel	2.287.500	0,13
5.250.000	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/23, variabel	5.469.188	0,30	5.270.000	Sanders Re II 07/06/23, variabel	5.395.163	0,30
10.250.000	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/23, variabel	10.441.163	0,57	7.125.000	Sanders Re II 07/04/24, variabel	7.227.778	0,40
5.250.000	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variabel	5.501.213	0,30	5.950.000	Spectrum Capital Series A 08/06/21, variabel	5.999.683	0,33
9.087.000	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variabel	9.281.916	0,51	4.500.000	Sutter Re Series A 06/06/22, variabel	4.634.775	0,25
3.950.000	Kilimanjaro Re Series A1 06/05/22, variabel	3.977.058	0,22	7.000.000	Sutter Re Series F 06/06/22, variabel	7.219.450	0,40
18.600.000	Kilimanjaro Re Series B1 06/05/22, variabel	18.786.929	1,03	4.500.000	Sutter Re Series A 23/05/23, variabel	4.684.275	0,26
4.500.000	Kilimanjaro Re Series A2 05/05/23, variabel	4.576.275	0,25	7.500.000	Sutter Re Series F 23/05/23, variabel	7.860.375	0,43
17.600.000	Kilimanjaro Re Series B2 05/05/23, variabel	17.854.319	0,98	14.800.000	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variabel	15.006.460	0,82
8.650.000	Kizuna Re II Series A 11/04/23, variabel	8.701.468	0,48	14.900.000	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variabel	15.076.565	0,83
1.750.000	Kizuna Re II Series B 11/04/23, variabel	1.762.163	0,10	9.550.000	Tailwind Re 2017-1 08/01/22, variabel	9.673.673	0,53
1.750.000	Manatee Re III Series A 07/06/22, variabel	1.756.913	0,10	6.920.000	Voussoir Re 01/03/24, variabel	6.953.908	0,38
1.750.000	Manatee Re III Series B 07/06/22, variabel	1.754.988	0,10	1.460.000	Voussoir Re perpetual, variabel	257.325	0,01
5.750.000	Merna Re 08/04/21, variabel	5.768.688	0,32	Irland		22.205.954	1,22
18.312.000	Merna Reinsurance II 07/04/22, variabel	18.385.247	1,01	7.856.000	Azzurro Re II DAC 17/01/24, variabel	9.281.827	0,51
7.000.000	Mona Lisa Re Series A 09/01/23, variabel	7.142.450	0,39	10.966.000	Hexagon II Reinsurance DAC 17/01/24, variabel	12.924.127	0,71
9.714.000	Mona Lisa Re Series B 09/01/23, variabel	9.900.995	0,54	Singapur		24.126.713	1,32
14.250.000	Mystic Re IV 08/01/24, variabel	14.602.688	0,80	5.000.000	Alamo Re II 08/06/23, variabel	5.246.250	0,29
15.690.000	Nakama Re 14/01/25, variabel	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, variabel	19.432.249	1,06	9.783.000	Easton Re 08/01/24, variabel	9.883.275	0,54
10.500.000	Northshore Re II 07/07/23, variabel	11.038.125	0,60	6.750.000	Kizuna Re III 07/04/26, variabel	6.766.200	0,37
6.462.000	Northshore Re II 08/01/24, variabel	6.633.243	0,36	Supranational		30.706.768	1,68
8.884.000	Phoenician Re 14/12/23, variabel	9.018.148	0,49	3.450.000	International Bank for Reconstruction & Development Series A 02/12/22, variabel	3.459.660	0,19
23.029.000	Phoenician Re Series A 14/12/23, variabel	23.392.857	1,28	14.800.000	International Bank for Reconstruction & Development Series B 02/12/22, variabel	14.838.479	0,81
5.000.000	Power Protective Re 15/12/23, variabel	5.013.000	0,27	3.697.000	International Bank for Reconstruction & Development Series A 13/03/24, variabel	3.746.910	0,21
13.750.000	Sanders Re 06/12/21, variabel	13.761.688	0,75				

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
1.550.000	International Bank for Reconstruction & Development Series B 13/03/24, variabel	1.565.500	0,09
2.250.000	International Bank for Reconstruction & Development Series C 13/03/24, variabel	2.276.156	0,12
4.750.000	International Bank for Reconstruction & Development Series D 13/03/24, variabel	4.820.063	0,26
Vereinigtes Königreich		1.758.138	0,10
1.750.000	Atlas Capital UK 2019 07/06/23, variabel	1.758.138	0,10
Summe Anleihen		695.522.306	38,09
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		695.522.306	38,09

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Bermuda			
7.308.000	2001 Cat Re 08/01/24, variabel	7.594.839	0,42
19.900.000	Akibare Re 07/04/22, variabel	20.039.299	1,10
9.091.085	Akibare Re 07/04/23, variabel	30.910	-
16.700.000	Aozora Re 07/04/21, variabel	16.783.500	0,92
3.250.000	Armor Re II 08/06/22, variabel	3.312.238	0,18
9.780.000	Bonanza Re 20/02/24, variabel	9.904.695	0,54
16.996.000	Bonanza Re 23/12/24, variabel	17.209.300	0,94
7.500.000	Cape Lookout Re 09/05/22, variabel	7.569.375	0,42
17.917.000	Cape Lookout Re 22/03/24, variabel	17.952.834	0,98
816.477	Citrus Re 20/03/23, variabel	490.662	0,03
2.700.000	Designated as Randolph Re 2020-1 06/07/21, ZCP	2.628.315	0,14
18.474.000	Everglades Re II 04/05/21, variabel	18.576.531	1,02
8.000.000	Everglades Re II 04/05/23, variabel	8.211.600	0,45

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
8.925.000	First Coast Re 2017-1 07/06/21, variabel	8.984.351	0,49
12.650.000	FloodSmart Re Series A 06/08/21, variabel	13.020.013	0,71
13.234.000	FloodSmart Re Series B 06/08/21, variabel	13.654.180	0,75
25.504.000	FloodSmart Re Series A 01/03/24, variabel	25.534.604	1,40
5.625.000	FloodSmart Re Series B 01/03/24, variabel	5.631.188	0,31
9.800.000	Fortius Re II 07/07/21, variabel	9.875.950	0,54
5.750.000	Frontline Re Series A 06/07/22, variabel	4.255.000	0,23
2.303.695	Frontline Re Series B 06/07/22, variabel	350.162	0,02
7.000.000	Herbie Re 08/07/24, variabel	7.241.500	0,40
3.833.000	Herbie Re 08/01/25, variabel	4.061.255	0,22
5.114.000	Hypatia Series A 07/06/23, variabel	5.431.068	0,30
379.000	Hypatia Series B 07/06/23, variabel	404.204	0,02
4.950.000	Integrity Re 10/06/22, variabel	4.964.603	0,27
20.775.000	Kendall Re 06/05/21, variabel	20.821.743	1,14
26.707.000	Kilimanjaro II Re Series * 20/04/21, variabel	26.847.211	1,47
15.250.000	Manatee Re II 07/06/21, variabel	15.337.688	0,84
3.750.000	Manatee Re Series B 07/06/21, variabel	3.771.188	0,21
12.000.000	Matterhorn Re 07/12/21, variabel	12.138.600	0,66
6.500.000	Matterhorn Re Series A 07/12/21, variabel	6.662.825	0,36
3.500.000	Matterhorn Re Series A 07/12/21, variabel	3.614.625	0,20
8.000.000	Matterhorn Re Series B 07/12/21, variabel	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, variabel	7.331.925	0,40
11.118.000	Matterhorn Re Series A 07/12/22, variabel	11.164.140	0,61
14.250.000	Matterhorn Re Series B 07/12/22, variabel	14.360.438	0,79
7.500.000	Matterhorn Re 08/01/24, variabel	7.338.000	0,40

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
10.500.000	Merna Reinsurance II 07/04/23, variabel	10.593.450	0,58	2.500.000	Caelus Re VI 07/06/23, variabel	2.556.500	0,14
22.340.000	Merna Reinsurance II 05/04/24, variabel	22.393.615	1,23	2.750.000	Caelus Re VI 07/06/24, variabel	2.828.925	0,15
6.000.000	MetroCat Re 08/05/23, variabel	6.126.600	0,34	500.000	Long Point Re III 01/06/22, variabel	503.225	0,03
1.250.000	Nakama Re 13/10/21, variabel	1.256.063	0,07	4.750.000	Residential Reinsurance 2017 Series 11 06/06/21, variabel	4.717.225	0,26
7.500.000	Nakama Re 144A 13/10/21, variabel	7.540.125	0,41	6.150.000	Residential Reinsurance 2017 Series 13 06/06/21, variabel	6.133.703	0,34
18.575.000	Nakama Re Series 1 13/04/23, variabel	18.635.369	1,02	10.050.000	Residential Reinsurance 2017 06/12/21, variabel	10.089.697	0,55
12.200.000	Nakama Re Series 2 13/04/23, variabel	12.248.190	0,67	14.400.000	Residential Reinsurance 2018 Series 13 06/06/22, variabel	14.245.199	0,78
3.022.000	Pelican IV Re 07/05/21, variabel	3.034.541	0,17	7.625.000	Residential Reinsurance 2018 06/12/22, variabel	7.664.269	0,42
9.697.000	Sakura Re Series A 07/04/25, variabel	9.720.273	0,53	4.000.000	Residential Reinsurance 2019 Series 12 06/06/23, variabel	3.617.200	0,20
14.242.000	Sakura Re Series B 07/04/25, variabel	14.276.181	0,78	2.250.000	Residential Reinsurance 2019 Series 13 06/06/23, variabel	2.228.513	0,12
3.000.000	SD Re 19/10/21, variabel	2.957.550	0,16	6.062.000	Residential Reinsurance 2019 06/12/23, variabel	6.075.640	0,33
3.750.000	Sierra Series A 28/12/22, variabel	3.823.688	0,21	6.154.000	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variabel	6.210.309	0,34
2.750.000	Sierra Series B 28/12/22, variabel	2.808.163	0,15	5.484.000	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variabel	5.535.824	0,30
14.500.000	Sierra Series A 31/01/24, variabel	14.614.550	0,80	5.000.000	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variabel	5.086.250	0,28
2.000.000	Sierra Series B 31/01/24, variabel	2.008.600	0,11	1.050.000	Vitality Re IX Series A 10/01/22, variabel	1.043.438	0,06
20.000.000	Torrey Pines Re Series A 07/06/24, variabel	20.047.999	1,10	1.900.000	Vitality Re IX Series B 10/01/22, variabel	1.878.625	0,10
19.250.000	Torrey Pines Re Series B 07/06/24, variabel	19.296.200	1,06	5.250.000	Vitality Re X Series A 10/01/23, variabel	5.243.438	0,29
17.050.000	Ursa Re 24/09/21, variabel	17.132.693	0,94	2.250.000	Vitality Re X Series B 10/01/23, variabel	2.213.438	0,12
20.732.000	Ursa Re 10/12/22, variabel	21.070.967	1,15	9.117.000	Vitality Re XI Series A 09/01/24, variabel	8.923.263	0,49
19.250.000	Ursa Re II Series AA 07/12/23, variabel	19.723.549	1,08	3.500.000	Vitality Re XI Series B 09/01/24, variabel	3.423.875	0,19
9.500.000	Ursa Re II Series D 07/12/23, variabel	9.728.000	0,53	12.044.000	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variabel	12.040.988	0,66
16.366.000	Ursa Re II 06/12/24, variabel	16.406.915	0,90	6.000.000	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variabel	5.992.500	0,33
8.269.000	Windmill II Re DAC 05/07/24, variabel	9.842.512	0,54				
Kaimaninseln		122.958.255	6,73				
5.462.500	Caelus Re V Series B 05/06/24, variabel	4.663.609	0,25				
6.600.000	Caelus Re V Series C 05/06/24, variabel	41.250	-				
132.536	Caelus Re V Series D 05/06/24, variabel	1.352	-				

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Irland			
10.000.000	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variabel	10.544.500	0,58
4.100.000	Hexagon Reinsurance DAC Series A 19/01/22, variabel	4.825.379	0,27
3.750.000	Hexagon Reinsurance DAC Series B 19/01/22, variabel	4.409.718	0,24
15.100.000	Lion II Re DAC 15/07/21, variabel	17.752.040	0,97
Singapur			
6.000.000	Catahoula Re 09/05/23, variabel	6.072.300	0,33
3.315.000	Cosaint Re 03/04/24, variabel	3.321.630	0,18
9.966.000	First Coast Re III 07/04/25, variabel	9.974.472	0,55
4.012.000	Phoenix 1 Re 04/01/27, ZCP	4.062.952	0,22
Vereinigtes Königreich		42.833.086	2,35
27.275.000	Atlas Capital UK 2018 07/06/22, variabel	27.491.836	1,51
15.000.000	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variabel	15.341.250	0,84
Vereinigte Staaten		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
Summe Anleihen		1.087.007.854	59,53
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		1.087.007.854	59,53
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Sonstige Wertpapiere	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Vereinigte Staaten			
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
Summe Anleihen		20.925.165	1,14
Summe sonstige Wertpapiere		20.925.165	1,14
Summe Kapitalanlagen		1.803.455.325	98,76
Sonstiges Nettovermögen		22.585.000	1,24
Nettoinventarwert		1.826.040.325	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien			
Vereinigte Staaten		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
Summe Aktien		349.598.900	83,27
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		349.598.900	83,27
Summe Kapitalanlagen		349.598.900	83,27
Sonstiges Nettovermögen		70.263.757	16,73
Nettoinventarwert		419.862.657	100,00

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens
Aktien			
Argentinien			
5.421	MercadoLibre	6.805.211	0,67
Brasilien			
190.857	StoneCo	9.963.559	0,99
Kanada			
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
Indien			
309.377	Housing Development Finance	9.013.882	0,89
Russland			
227.581	Yandex	12.431.857	1,23
Schweiz			
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
Vereinigtes Königreich			
177.046	Linde	42.293.567	4,19
Vereinigte Staaten			
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

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert EUR	% des Netto- vermö- gens
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
Summe Aktien		932.420.173	92,27
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		932.420.173	92,27
Summe Kapitalanlagen		932.420.173	92,27
Sonstiges Nettovermögen		78.077.774	7,73
Nettoinventarwert		1.010.497.947	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Helix

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien - Long			
Brasilien		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
Kanada		7.277	0,00
704	Loop Energy	7.277	-
Chile		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

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
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
Tschechische Republik		2.378.564	0,48
77.057	Komerčni banka	2.378.564	0,48
Ägypten		861.367	0,17
215.826	Commercial International Bank Egypt	769.420	0,15
231.228	Talaat Moustafa Group	91.947	0,02
Georgien		2.664.707	0,54
152.511	Georgia Capital	1.215.255	0,25
106.849	TBC Bank Group	1.449.452	0,29
Griechenland		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	-
Ungarn		7.508.355	1,52
56.245	OTP Bank	2.404.120	0,49
173.122	Richter Gedeon	5.104.235	1,03
Indien		132.145	0,03
6.854	Larsen & Toubro	132.145	0,03

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Indonesien		3.322.155	0,67
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
Italien		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
Kasachstan		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
Mexiko		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
Niederlande		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
Philippinen		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

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
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
Russland		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
Slowenien		3.303.536	0,67
268.289	Nova Ljubljanska Banka dd	3.303.536	0,67
Südafrika		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
Südkorea		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- Preference	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

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
2.626	SK Telecom	638.083	0,13
Spanien		33.445	0,01
2.711	Soltec Power Holdings	33.445	0,01
Schweiz		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
Türkei		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

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
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
Vereinigtes Königreich		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 Electronics	882.453	0,18
85.284	Vesuvius	633.716	0,13
117.171	Watches of Switzerland Group	1.067.726	0,22
Vereinigte Staaten		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
Summe Aktien - Long		247.697.109	50,05
Anleihen - Long			
Argentinien		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
Brasilien		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
Ägypten		102.033	0,02
1.450.000	Egypt Government Bond 09/05/27, 17,18 %	102.033	0,02

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Indonesien		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
Elfenbeinküste		248.225	0,05
200.000	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5,88 %	248.225	0,05
Mexiko		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
Südafrika		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
Supranational		100.358	0,02
7.120.000	International Finance 25/11/24, 6,30 %	100.358	0,02
Türkei		88.489	0,02
68.000	Turkey Government International Bond 15/01/30, 11,88 %	88.489	0,02
Summe Anleihen - Long		2.936.269	0,59
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		250.633.378	50,64

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen - 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
Ukraine		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
Vereinigte Staaten		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
Summe Anleihen - Long		150.443.166	30,40
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		150.443.166	30,40

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien - 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
Summe Aktien - Long		27.327.060	5,52
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen		27.327.060	5,52

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Sonstige Wertpapiere	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien - Short			
Russland			
(30.920)	Gazprom	(184.407)	(0,04)
Summe Aktien - Short		(184.407)	(0,04)
Summe sonstige Wertpapiere		(184.407)	(0,04)
Summe Kapitalanlagen		428.219.197	86,52
Sonstiges Nettovermögen		66.704.597	13,48
Nettoinventarwert		494.923.794	100,00

Schroder GAIA M&A*

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien			
China			
9.277	Hollysys Automation Technologies	116.148	1,67
Vereinigte Staaten			
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
Summe Aktien		1.190.707	17,09
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		1.190.707	17,09

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Vereinigte Staaten			
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

* Für nähere Angaben zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA M&A* (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
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
Summe Anleihen		4.049.958	58,14
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		4.049.958	58,14
Summe Kapitalanlagen		5.240.665	75,23
Sonstiges Nettovermögen		1.725.612	24,77
Nettoinventarwert		6.966.277	100,00

Schroder GAIA Sirios US Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien			
Frankreich		11.485.142	2,88
85.312	Airbus	9.658.381	2,42
13.423	Safran	1.826.761	0,46
Spanien		15.039.035	3,77
261.187	Cellnex Telecom	15.039.035	3,77
Schweden		3.976.049	1,00
300.516	Telefonaktiebolaget LM Ericsson	3.976.049	1,00
Vereinigtes Königreich		13.965.735	3,50
7.025	Linde	1.968.110	0,49
125.400	London Stock Exchange Group	11.997.625	3,01
Vereinigte Staaten		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

* Für nähere Angaben zu den Kapitalmaßnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Verwaltungsrats verwiesen. Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
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

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
38.831	Williams-Sonoma	6.958.515	1,74
46.671	World Wrestling Entertainment	2.532.368	0,63
Summe Aktien		375.494.639	94,10
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		375.494.639	94,10

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Vereinigte Staaten			
		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
Summe Anleihen		10.176.326	2,55
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		10.176.326	2,55
Summe Kapitalanlagen		385.670.965	96,65
Sonstiges Nettovermögen		13.350.269	3,35
Nettoinventarwert		399.021.234	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Deutschland		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	-
Vereinigte Staaten		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	-
Summe Anleihen		146.217	0,01
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		146.217	0,01

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Anleihen			
Österreich		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

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Finnland		74.911.472	6,98
75.000.000	Finnish Treasury Bill 17/11/21, ZCP	74.911.472	6,98
Deutschland		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
Vereinigte Staaten		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	-
Summe Anleihen		459.900.923	42,86
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		459.900.923	42,86

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien			
Luxemburg		5.000.000	0,47
5.000.000	JPMorgan Liquidity Funds-US Dollar Treasury Liquidity Fund	5.000.000	0,47
Summe Aktien		5.000.000	0,47
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Anlagen		5.000.000	0,47
Summe Kapitalanlagen		465.047.140	43,34

Termineinlagen			
Finanzen		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
Summe Termineinlagen		161.573.700	15,06
Sonstiges Nettovermögen		446.367.119	41,60
Nettoinventarwert		1.072.987.959	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert GBP	% des Netto- vermö- gens
Aktien			
Vereinigtes Königreich		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 Electronics	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
Summe Aktien		13.916.419	41,47
Anleihen			
Vereinigtes Königreich		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
Summe Anleihen		10.320.845	30,76
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		24.237.264	72,23

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert GBP	% des Netto- vermö- gens
Anleihen			
Vereinigtes Königreich		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
Summe Anleihen		5.499.598	16,39
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		5.499.598	16,39
Summe Kapitalanlagen		29.736.862	88,62
Sonstiges Nettovermögen		3.818.123	11,38
Nettoinventarwert		33.554.985	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Aktien				Kaimaninseln			
Australien				191.732			
32.568	Glencore	127.623	0,03	6.269	AEA-Bridges Impact	61.562	0,01
58.097	Pilbara Minerals	46.113	0,01	13.017	Alussa Energy Acquisition	130.170	0,03
6.803	Rio Tinto	520.514	0,11	Chile			
1.422	Tyro Payments	3.553	-	21	Sociedad Quimica y Minera de Chile	65	-
Österreich				115	Sociedad Quimica y Minera de Chile-ADR	6.103	-
22.640	BAWAG Group	1.169.259	0,24	China			
14.028	Erste Group Bank	475.752	0,10	7.555.104			
Belgien				132.000	Akeso	833.691	0,18
1.124	Galapagos	87.154	0,02	7.640	Amoy Diagnostics	83.022	0,02
2.310	KBC Ancora	98.876	0,02	186.000	Angang Steel Class A	105.395	0,02
11.564	KBC Group	840.789	0,18	28.000	Angang Steel Class H	13.975	-
612	UCB	58.219	0,01	23.231	Baidu	636.499	0,13
Brasilien				305	Baidu-ADR	66.353	0,01
1.100	BK Brasil Operacao e Assessoria a Restaurantes	1.890	-	116.000	Baoshan Iron & Steel	142.769	0,03
130	BR Properties	199	-	212	BeiGene	73.793	0,02
479	Lojas Renner	3.624	-	519.882	China Longyuan Power Group	706.185	0,15
3.896	StoneCo	238.513	0,05	1.339.914	China Machinery Engineering	598.076	0,12
29.188	XP	1.099.512	0,23	2.798	China Merchants Port Holdings	4.290	-
Kanada				370.000	China Pharmaceutical Group	447.383	0,09
48.304	Advantage Oil & Gas	91.096	0,02	5.900	Connect Biopharma Holdings	109.150	0,02
276.938	ARC Resources	1.701.250	0,36	5.416	Contemporary Amperex Technology	265.784	0,06
1.120	Barrick Gold	22.176	-	53.772	CStone Pharmaceuticals	63.981	0,01
4.622	Canadian Natural Resources	142.681	0,03	34.253	Everest Medicines	324.064	0,07
3.200	Clementia Pharmaceuticals	-	-	557	Ganfeng Lithium	7.997	-
11.903	Dollarama	525.865	0,11	18.551	Gracell Biotechnologies	285.685	0,06
32.658	Enerplus	163.979	0,03	10.290	Guangzhou Automobile Group	8.643	-
234.110	Headwater Exploration	728.392	0,15	920.162	Hope Education Group	307.743	0,06
22.476	Intact Financial	2.754.279	0,58	10.863	InnoCare Pharma	25.376	0,01
56.537	Kelt Exploration	119.669	0,02	52.445	Lifetech Scientific	24.084	0,01
37.826	MEG Energy	196.249	0,04	9.900	Linklogis	22.387	-
23.113	Parex Resources	412.161	0,09	2.000	Microport Cardioflow Medtech	3.386	-
31.907	Seven Generations Energy	215.811	0,04	7.000	Ningbo Joyson Electronic	19.203	-
647.194	Storm Resources	1.405.936	0,29	184.245	Shenzhen Airport	249.215	0,05
81.289	Suncor Energy	1.698.940	0,35	2.445	Tencent Holdings	191.849	0,04
90.636	Tourmaline Oil	1.725.163	0,37	16.728	Venustech Group	85.029	0,02
74.430	Trican Well Service	122.599	0,03	12.683	WuXi AppTec	249.448	0,05
10.770	Whitecap Resources	47.307	0,01				

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
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
Kolumbien		50.272	0,01
3.142	Geopark	50.272	0,01
Tschechische Republik		116.558	0,02
2.339	Komerční banka	72.200	0,01
11.909	Moneta Money Bank	44.358	0,01
Dänemark		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
Frankreich		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
Deutschland		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 MediTech	299.337	0,06

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Ungarn		66.072	0,01
2.241	Richter Gedeon	66.072	0,01
Indien		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
Indonesien		363.876	0,08
16.664.600	Panin Financial	234.050	0,05
2.402.200	Paninvest	129.826	0,03
Irland		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
Israel		457.915	0,10
34.370	Israel Discount Bank	142.801	0,03
11.238	Tower Semiconductor	315.114	0,07
Italien		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

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
32.142	Shinsei Bank	519.323	0,11
12.253	Showa Denko KK	348.584	0,07
Jordanien		44.367	0,01
1.414	Hikma Pharmaceuticals	44.367	0,01
Kasachstan		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	-
Malaysia		8.914	0,00
5.914	Malaysia Airports Holdings	8.914	-
Mexiko		309.320	0,06
25.963	Fresnillo	309.320	0,06
Niederlande		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
Norwegen		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
Philippinen		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
Südafrika		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	-
Südkorea		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
Spanien		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

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Schweden		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
Schweiz		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
Vereinigte Arabische Emirate		207.497	0,04
36.391	Network International Holdings	207.497	0,04
Vereinigtes Königreich		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

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Vereinigte Staaten		82.551.445	17,22	26.951	Brigham Minerals	394.563	0,08
4.202	Accelaron 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	Banc 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

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
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

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
1.747	Penn National Gaming	183.155	0,04	1.714	Teleflex	712.098	0,15
13.065	Pfizer	473.345	0,10	9	Texas Pacific Land	14.305	-
2.489	Phillips 66	202.953	0,04	21.499	Theravance Biopharma	438.795	0,09
2.086	Pinnacle West Capital	169.696	0,04	489	Thor Industries	65.888	0,01
14.487	Pioneer Natural Resources	2.300.824	0,48	7.002	TJX	463.182	0,10
6.674	Planet Fitness	515.900	0,11	13.250	TPG Pace Beneficial Finance	259.435	0,05
4.943	PMV Pharmaceuticals	162.575	0,03	522	TriCo Bancshares	24.727	0,01
3.245	Polaris	433.208	0,09	1.872	TriNet Group	145.941	0,03
14.645	PPD	554.167	0,12	7.926	TriState Capital Holdings	182.774	0,04
506	Quest Diagnostics	64.940	0,01	7.751	Triumph Bancorporation	599.850	0,13
2.123	Quidel	271.595	0,06	10.659	United Community Banks	363.685	0,08
6.130	Radius Health	127.872	0,03	9.412	UroGen Pharma	183.346	0,04
5.442	Rapid7	406.028	0,08	5.571	Vaxcyte	110.027	0,02
1.655	Reata Pharmaceuticals	165.004	0,03	552	Veracyte	29.670	0,01
117	Regeneron Pharmaceuticals	55.357	0,01	264	Vertex Pharmaceuticals	56.731	0,01
14.473	Repay Holdings	339.826	0,07	28.652	Viatis	400.268	0,08
2.457	Revance Therapeutics	68.673	0,01	25.043	Vine Energy	344.091	0,07
2.600	Revolution Medicines	119.288	0,02	8.766	Voya Financial	557.868	0,12
11.898	Rhythm Pharmaceuticals	253.070	0,05	9.900	Wells Fargo	386.793	0,08
39.328	Ribbit LEAP	432.608	0,09	7.727	Western Alliance Bancorporation	729.738	0,15
14.464	Rice Acquisition	146.231	0,03	53.498	Whiting Petroleum	1.896.503	0,40
6.506	Rocket Pharmaceuticals	288.671	0,06	11.028	Wolverine World Wide	422.593	0,09
7.039	Royalty Pharma	307.041	0,06	3.717	Zions Bancorporation	204.286	0,04
4.365	Sage Therapeutics	326.720	0,07				
2.303	Sarepta Therapeutics	171.643	0,04	Vietnam		617.469	0,13
239	Seagen	33.188	0,01	188.800	Hoa Phat Group	382.919	0,08
193	Sempra Energy	25.588	0,01	131.340	Vietnam Technological & Commercial Joint Stock Bank	229.952	0,05
3.487	Signature Bank	788.411	0,16	900	Vingroup	4.598	-
6.566	Skyline Champion	297.177	0,06	Summe Aktien		153.213.513	31,95
1.495	SmartFinancial	32.367	0,01	Anleihen			
166	Social Capital Hedosophia Holdings V	2.847	-	Angola		378.168	0,08
4.600	Spartan Acquisition II	48.116	0,01	400.000	Angolan Government International Bond 08/05/48, 9,38 %	378.168	0,08
5.546	Star Peak Energy Transition	147.413	0,03	Argentinien		2.511.842	0,52
3.214	Stryker	782.866	0,16	85.000	Argentina Bonar Bonds 07/05/24, 8,75 %	34.213	0,01
13.688	Synchrony Financial	556.554	0,12	241.475	Argentine Republic Government International Bond 09/07/29, 1,00 %	87.337	0,02
11.621	Syndax Pharmaceuticals	259.846	0,05				
318	Syneos Health	24.120	0,01				
15.296	Targa Resources	485.648	0,10				
6.926	TCR2 Therapeutics	152.926	0,03				

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens		
1.433.761	Argentine Republic Government International Bond 09/07/30, 0,13 %	482.819	0,10	200.000	Prosus 08/02/51, 3,83 %	175.583	0,04		
4.354.510	Argentine Republic Government International Bond 09/07/35, 0,13 %	1.308.573	0,26	340.000	Tequ Mayflower 02/03/26, ZCP	336.855	0,07		
55.965	Cia Latinoamericana de Infraestructura & Servicios 20/07/23, 9,50 %	18.891	-	515.000	Times China Holdings 14/01/27, 5,75 %	498.924	0,10		
303.600	Provincia de Cordoba 01/06/27, 3,00 %	180.642	0,04	600.000	Yuzhou Group Holdings 13/01/27, 6,35 %	500.250	0,10		
307.481	Provincia de Cordoba 01/02/29, 3,00 %	176.805	0,04	Kolumbien			334.496	0,07	
350.000	YPF 27/06/29, 8,50 %	222.562	0,05	330.000	Bancolombia 18/12/29, variabel	334.496	0,07		
Österreich			600.036	0,13	Kroatien			959.188	0,20
600.000	Oesterreichische Kontrollbank 22/11/21, variabel	600.036	0,13	440.000	Croatia Government International Bond 17/06/31, 1,50 %	544.543	0,11		
Aserbaidzhan			527.383	0,11	345.000	Croatia Government International Bond 04/03/41, 1,75 %	414.645	0,09	
445.000	Southern Gas Corridor 24/03/26, 6,88 %	527.383	0,11	Dominikanische Republik			1.144.045	0,24	
Bahrain			186.244	0,04	410.000	Dominican Republic International Bond 23/09/32, 4,88 %	419.225	0,09	
200.000	Bahrain Government International Bond 25/01/51, 6,25 %	186.244	0,04	490.000	Dominican Republic International Bond 21/01/41, 5,30 %	483.262	0,10		
Brasilien			426.106	0,09	230.000	Dominican Republic International Bond 05/06/49, 6,40 %	241.558	0,05	
200.000	MARB BondCo 29/01/31, 3,95 %	190.865	0,04	Ägypten			833.271	0,17	
220.000	Petrobras Global Finance 03/06/50, 6,75 %	235.241	0,05	140.000	Egypt Government International Bond 11/04/25, 4,75 %	170.725	0,04		
China			5.376.471	1,11	230.000	Egypt Government International Bond 16/02/26, 3,88 %	222.295	0,05	
200.000	Bank of China 12/07/21, 2,25 %	200.790	0,04	230.000	Egypt Government International Bond 29/05/32, 7,63 %	236.095	0,04		
200.000	Bank of China 20/11/21, variabel	200.220	0,04	225.000	Egypt Government International Bond 16/02/61, 7,50 %	204.156	0,04		
500.000	Bank of China 16/01/22, variabel	499.928	0,10	El Salvador			134.625	0,03	
750.000	China Construction Bank 24/09/21, variabel	750.518	0,16	150.000	El Salvador Government International Bond 20/01/50, 7,12 %	134.625	0,03		
400.000	CIFI Holdings Group 12/04/27, 4,38 %	392.436	0,08	Äthiopien			240.380	0,05	
525.000	Country Garden Holdings 12/07/26, 2,70 %	520.924	0,11	260.000	Ethiopia International Bond 11/12/24, 6,63 %	240.380	0,05		
450.000	ICBCIL Finance 15/05/21, variabel	449.909	0,09	Finnland			792.511	0,17	
650.000	Industrial & Commercial Bank of China 16/04/21, variabel	650.101	0,14	620.000	Finnair perpetual, variabel	792.511	0,17		
200.000	Industrial & Commercial Bank of China 14/06/21, variabel	200.033	0,04	Gabun			415.809	0,09	
				400.000	Gabon Government International Bond 12/12/24, 6,38 %	415.809	0,09		

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Deutschland		3.163.094	0,66
600.000	Allianz perpetual, variabel	710.100	0,15
190.000	Landeskreditbank Baden-Wuerttemberg Foerderbank 27/09/21, variabel	190.107	0,04
200.000	State of North Rhine- Westphalia Germany 27/08/21, variabel	200.106	0,04
900.000	Wintershall DeaFinance 2 Series NC5 perpetual, variabel	1.032.992	0,22
900.000	Wintershall DeaFinance 2 Series NC8 perpetual, variabel	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, variabel	328.757	0,07
Ungarn		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
Italien		671.118	0,14
600.000	Nexi 24/02/28, ZCP	671.118	0,14
Elfenbeinküste		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

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Mazedonien		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
Mexiko		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
Niederlande		1.397.320	0,29
845.000	Aegon perpetual, variabel	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
Rumänien		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

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Russland		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
Serbien		468.422	0,10
360.000	Serbia International Bond 15/05/27, 3,13 %	468.422	0,10
Südafrika		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
Südkorea		2.543.225	0,53
1.185.000	Export-Import Bank of Korea 01/06/21, variabel	1.185.812	0,25
200.000	Export-Import Bank of Korea 05/07/22, variabel	201.451	0,04
200.000	Industrial Bank of Korea 02/08/21, variabel	200.631	0,04
250.000	Korea Development Bank 12/04/21, variabel	250.029	0,05
200.000	Korea Development Bank 27/02/22, variabel	200.923	0,04
500.000	Korea Development Bank 30/10/22, variabel	504.379	0,11
Spanien		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, variabel	199.853	0,04
Supranational		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

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% des Nettovermögens
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
Schweiz		407.077	0,08
375.000	Credit Suisse Group perpetual, variabel	407.077	0,08
Türkei		203.769	0,04
250.000	Turkey Government International Bond 11/05/47, 5,75 %	203.769	0,04
Ukraine		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
Vereinigtes Königreich		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, variabel	1.421.432	0,29
785.000	Vodafone Group 27/08/80, variabel	953.065	0,20
Vereinigte Staaten		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, variabel	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
Summe Anleihen		53.019.106	11,05
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind		206.232.619	43,00

* Notleidendes Wertpapier.

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Aktien							
Russland							
30.663	Sberbank of Russia	117.713	0,02	450.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Deposit 16/04/21, ZCP	358.056	0,07
Summe Aktien							
117.713 0,02							
Anleihen							
Brasilien							
200.000	Centrais Eletricas Brasileiras 04/02/25, 3,63 %	201.756	0,04	990.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Deposit 14/05/21, ZCP	787.620	0,17
540.000	Rumo Luxembourg 18/01/25, 5,88 %	571.050	0,12	200.000	New Brunswick Municipal Finance 27/05/21, 4,25 %	160.137	0,03
Kanada							
9.850.743 2,05							
200.000	Alberta Treasury Bill 20/04/21, ZCP	159.133	0,03	200.000	Nova Scotia Treasury Bill 08/04/21, ZCP	159.142	0,03
200.000	Canadian Government Bond Coupon Strip 01/06/21, ZCP	159.193	0,03	700.000	Ontario Treasury Bill 07/04/21, ZCP	557.000	0,12
250.000	CDP Financial 25/05/21, ZCP	249.854	0,05	250.000	Ontario Treasury Bill 14/04/21, ZCP	198.923	0,04
900.000	City of Montreal Canada 01/12/21, 4,50 %	736.658	0,15	300.000	Province of Alberta Coupon Strip 01/06/21, ZCP	238.754	0,05
100.000	City of Quebec Canada 07/06/21, 4,00 %	80.330	0,02	200.000	Province of Alberta's Canadian Note 12/04/21, ZCP	159.140	0,03
346.000	City of Quebec Canada 05/03/22, 1,65 %	279.542	0,06	200.000	Province of British Columbia 19/04/21, ZCP	159.136	0,03
200.000	City of Toronto Canada 06/12/21, 3,50 %	162.683	0,03	700.000	Province of British Columbia Canada Interest Strip 04/06/21, ZCP	557.098	0,12
960.000	City of Vancouver 02/12/21, 3,45 %	780.421	0,16	250.000	Province of Manitoba Canada Treasury Bill 07/04/21, ZCP	198.928	0,04
435.000	Empire Communities 15/12/25, 7,00 %	459.469	0,10	250.000	PSP Capital 27/04/21, ZCP	198.874	0,04
300.000	Municipal Finance Authority of British Columbia 19/04/21, 1,65 %	238.904	0,05	1.250.000	Regional Municipality of York 30/06/21, 4,00 %	1.004.079	0,22
350.000	Municipal Finance Authority of British Columbia 01/06/21, 4,15 %	280.365	0,06	580.000	Shopify 01/11/25, 0,13 %	664.100	0,14
95.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 07/04/21, ZCP	75.593	0,02	250.000	Societe de Transport de Montreal 10/05/21, ZCP	198.892	0,04
250.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 21/04/21, ZCP	198.920	0,04	250.000	Societe de Transport de Montreal 17/06/21, ZCP	198.850	0,04
205.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 28/04/21, ZCP	163.103	0,03	Chile			
35.000	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 05/05/21, ZCP	27.846	0,01	1.410.000	Chile Government International Bond 15/04/53, 3,50 %	1.427.209	0,30
				China			
				400.000	Yingde Gases Investment 19/01/23, 6,25 %	413.660	0,09
				Ägypten			
				14.050.000	Egypt Treasury Bill 12/10/21, ZCP	837.561	0,17
				Frankreich			
				250.000	Electricite De France 07/06/21, ZCP	249.874	0,05

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Netto- vermö- gens
Japan				Schweiz			
129.550.000	Japan Treasury Discount Bill Series 942 12/04/21, ZCP	1.170.059	0,24	200.000	Switzerland Treasury Bill 17/06/21, ZCP	211.955	0,04
85.700.000	Japan Treasury Discount Bill Series 964 12/04/21, ZCP	774.010	0,16	Vereinigte Staaten			
137.750.000	Japan Treasury Discount Bill 19/04/21, ZCP	1.244.131	0,26	240.000	Adams Homes 15/02/25, 7,50 %	252.150	0,05
27.800.000	Japan Treasury Discount Bill 26/04/21, ZCP	251.088	0,05	1.795.000	Advantage Loyalty IP 20/04/29, 5,75 %	1.915.355	0,40
170.800.000	Japan Treasury Discount Bill 10/05/21, ZCP	1.542.712	0,32	650.000	Antero Resources 15/07/26, 8,38 %	717.844	0,15
159.300.000	Japan Treasury Discount Bill 17/05/21, ZCP	1.438.870	0,30	1.105.000	Broadcom 15/02/51, 3,75 %	1.063.105	0,22
63.500.000	Japan Treasury Discount Bill 24/05/21, ZCP	573.575	0,12	1.760.000	Community Health Systems 15/02/31, 4,75 %	1.721.544	0,36
215.200.000	Japan Treasury Discount Bill 31/05/21, ZCP	1.943.880	0,41	1.740.000	Continental Resources 15/01/31, 5,75 %	1.968.566	0,41
224.900.000	Japan Treasury Discount Bill 07/06/21, ZCP	2.031.550	0,42	1.760.000	Cornerstone Building Brands 15/01/29, 6,13 %	1.877.700	0,39
162.400.000	Japan Treasury Discount Bill 14/06/21, ZCP	1.467.005	0,31	1.785.000	DISH DBS 01/07/28, 7,38 %	1.874.786	0,39
62.400.000	Japan Treasury Discount Bill 16/06/21, ZCP	563.666	0,12	2.030.000	DraftKings 15/03/28, ZCP	2.018.834	0,42
234.700.000	Japan Treasury Discount Bill 21/06/21, ZCP	2.120.121	0,45	250.000	Electricite de France 28/06/21, ZCP	249.866	0,05
197.850.000	Japan Treasury Discount Bill 28/06/21, ZCP	1.787.315	0,37	265.000	Endeavor Energy Resources/EER Finance 15/07/25, 6,63 %	283.630	0,06
8.550.000	Japan Treasury Discount Bill 05/07/21, ZCP	77.238	0,02	1.540.000	Freedom Mortgage 01/05/26, 7,63 %	1.617.924	0,34
Mexiko		74.200	0,02	1.044.000	JetBlue Airways 01/04/26, 0,50 %	1.152.367	0,24
85.000	Petroleos Mexicanos 02/06/41, 6,50 %	74.200	0,02	1.000.000	LD Holdings Group LLC 01/11/25, 6,50 %	1.050.300	0,22
Panama		255.524	0,05	837.000	Morgan Stanley 28/04/32, variabel	786.313	0,16
240.000	Cable Onda 30/01/30, 4,50 %	255.524	0,05	472.000	OMP Finance 01/04/29, 8,00 %	486.160	0,10
Peru		494.887	0,10	1.190.000	Pebblebrook Hotel Trust 15/12/26, 1,75 %	1.398.250	0,29
275.000	Banco de Credito del Peru 01/07/30, variabel	275.492	0,05	635.000	PennyMac 15/03/26, 5,50 %	650.875	0,14
200.000	Kallpa Generacion 24/05/26, 4,88 %	219.395	0,05	920.000	Redfin 01/04/27, 0,50 %	941.850	0,20
Rusland		641.825	0,13	490.000	Scripps Escrow II 15/01/31, 5,38 %	488.616	0,10
53.255.000	Russian Federal Bond - OFZ 18/07/35, 6,10 %	641.825	0,13	10.000	United States Cash Management Bill 01/06/21, ZCP	9.999	-
Südkorea		650.084	0,14	2.060.000	United States Cash Management Bill 08/06/21, ZCP	2.059.689	0,43
250.000	Korea Development Bank 28/05/21, ZCP	249.893	0,05	500.000	United States Cash Management Bill 15/06/21, ZCP	499.956	0,10
400.000	Korea Development Bank 07/11/21, variabel	400.191	0,09				

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anlageportfolio zum 31. März 2021 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
1.370.000	United States Cash Management Bill 29/06/21, ZCP	1.369.856	0,29
2.375.000	United States Cash Management Bill 06/07/21, ZCP	2.374.704	0,50
6.610.000	United States Cash Management Bill 13/07/21, ZCP	6.609.159	1,38
1.510.000	United States Cash Management Bill 20/07/21, ZCP	1.509.748	0,31
8.020.000	United States Treasury Bill 01/04/21, ZCP	8.020.000	1,67
1.155.000	United States Treasury Bill 06/04/21, ZCP	1.154.986	0,24
3.080.000	United States Treasury Bill 08/04/21, ZCP	3.079.990	0,64
2.780.000	United States Treasury Bill 13/04/21, ZCP	2.779.962	0,58
3.310.000	United States Treasury Bill 20/04/21, ZCP	3.309.909	0,69
1.902.200	United States Treasury Bill 22/04/21, ZCP	1.902.126	0,40
4.843.000	United States Treasury Bill 27/04/21, ZCP	4.842.720	1,01
1.030.000	United States Treasury Bill 29/04/21, ZCP	1.029.985	0,21
2.878.000	United States Treasury Bill 04/05/21, ZCP	2.877.846	0,60
3.575.000	United States Treasury Bill 06/05/21, ZCP	3.574.809	0,75
567.000	United States Treasury Bill 11/05/21, ZCP	566.978	0,12
11.315.000	United States Treasury Bill 13/05/21, ZCP	11.314.563	2,36
17.837.000	United States Treasury Bill 18/05/21, ZCP	17.836.474	3,72
4.900.000	United States Treasury Bill 20/05/21, ZCP	4.899.450	1,02
4.835.000	United States Treasury Bill 25/05/21, ZCP	4.834.764	1,01
3.301.000	United States Treasury Bill 27/05/21, ZCP	3.300.602	0,69
1.180.000	United States Treasury Bill 03/06/21, ZCP	1.179.904	0,25
890.000	United States Treasury Bill 10/06/21, ZCP	889.911	0,19
2.910.000	United States Treasury Bill 17/06/21, ZCP	2.909.782	0,61
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

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% des Nettovermögens
460.000	United States Treasury Bill 12/08/21, ZCP	459.910	0,10
285.000	United States Treasury Bill 19/08/21, ZCP	284.950	0,06
2.920.000	United States Treasury Bill 26/08/21, ZCP	2.919.355	0,61
7.210.000	United States Treasury Bill 02/09/21, ZCP	7.208.305	1,50
2.560.000	United States Treasury Bill 09/09/21, ZCP	2.559.081	0,53
200.000	United States Treasury Bill 16/09/21, ZCP	199.968	0,04
500.000	United States Treasury Bill 23/09/21, ZCP	499.927	0,10
450.000	United States Treasury Bill 30/09/21, ZCP	449.915	0,09
125.000	United States Treasury Bill 04/11/21, ZCP	124.926	0,03
131.000	Vine Oil & Gas/Vine Oil & Gas Finance 15/04/23, 8,75 %	140.105	0,03
1.383.000	Vine Oil & Gas/Vine Oil & Gas Finance 15/04/23, 9,75 %	1.482.403	0,31
Venezuela		10.424	-
220.000	Petroleos de Venezuela 15/11/26, 6,00 %*	10.424	-
Summe Anleihen		171.473.385	35,75
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		171.591.098	35,77

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Optionsscheine	Marktwert USD	% des Nettovermögens
Vereinigte Staaten		23.595	-
7.865	Ribbit LEAP Warrants 09/09/25	23.595	-
Summe Optionsscheine		23.595	-
Summe Kapitalanlagen		377.847.312	78,77
Sonstiges Nettovermögen		101.816.294	21,23
Nettoinventarwert		479.663.606	100,00

* Notleidendes Wertpapier.

Die Anmerkungen auf den Seiten 53 bis 130 stellen einen wesentlichen Teil dieses Abschlusses dar.

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021

Die Gesellschaft

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

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

Anteilsklassen

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

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

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

Ausgabeaufschlag

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

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

Vertriebsgebühr

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

Swing-Pricing

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

Die Nettomittelflüsse werden von der Verwaltungsgesellschaft auf der Grundlage der letzten verfügbaren Informationen zum Zeitpunkt der Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil bestimmt. Das Ausmaß der Preisanpassung wird von der Verwaltungsgesellschaft auf eine Weise bestimmt, die Handels- und sonstige Kosten angemessen wiedergibt. Derartige Anpassungen können von Teilfonds zu Teilfonds unterschiedlich ausfallen und betragen maximal 2 % des ursprünglichen Nettoinventarwerts je Anteil.

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

Am 31. März 2021, dem letzten Berechnungstag des Berichtszeitraums, wurden Swing-Pricing-Anpassungen auf Schroder GAIA Cat Bond, Schroder GAIA Contour Tech Equity, Schroder GAIA Egerton Equity, Schroder GAIA Sirios US Equity, Schroder GAIA Two Sigma Diversified und Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund angewendet. Die nachfolgende Tabelle stellt den offiziellen Nettoinventarwert je Anteil dieser Teilfonds nach Anwendung der Swing-Pricing-Anpassung zu diesem Termin dar. Alle sonstigen in diesem Bericht aufgeführten Finanzinformationen werden vor den Swing-Pricing-Anpassungen ausgewiesen.

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Swing-Pricing (Forts.)

	Währung	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
Nettoinventarwert je Anteil* (einschließlich Swing-Pricing-Anpassung)							
zum 31. März 2021							
Klasse A Thes.	EUR	-	-	216,62	-	-	-
Klasse A Thes.	USD	1.448,89	136,38	-	146,94	-	-
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	-	127,09	-	175,57	-	-
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	-	128,73	-	132,26	-	-
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	GBP	-	-	202,46	-	-	-
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	904,08	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	SGD	-	189,13	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	USD	-	-	214,23	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	GBP	-	-	204,79	-	-	-
Klasse A1 Thes.	EUR	-	-	203,53	-	-	-
Klasse A1 Thes.	USD	-	135,94	-	-	-	-
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	USD	-	-	206,83	-	-	-
Klasse C Thes.	EUR	-	-	232,63	-	-	-
Klasse C Thes.	USD	1.455,05	140,23	-	153,36	111,41	-
Klasse C Thes.	GBP	-	-	-	-	-	111,53
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	1.149,78	132,12	-	181,01	100,78	140,98
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	1.208,79	132,07	-	137,64	102,67	126,17
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	GBP	103,44	108,31	215,78	143,16	106,48	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	-	1.095,05	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	SGD	-	193,27	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	USD	-	-	230,11	-	-	148,76
Klasse C Aussch.	EUR	-	-	232,00	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	GBP	-	-	220,30	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	GBP	-	-	-	143,07	-	-
Klasse E Thes.	EUR	-	-	230,82	-	-	-
Klasse E Thes.	USD	-	140,84	-	163,66	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	-	131,41	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	-	132,54	-	147,54	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	GBP	-	107,88	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	-	1.091,62	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	SGD	-	194,52	-	-	-	-
Klasse F Thes.	USD	1.447,61	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	1.146,73	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	1.203,12	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	USD	1.176,24	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	SGD	1.573,16	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	EUR	-	-	329,81	-	-	-
Klasse I Thes.	USD	1.628,49	160,28	-	196,01	128,80	-
Klasse I Thes.	GBP	-	-	-	-	-	117,27
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	1.385,89	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	1.459,28	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	JPY	10.408,64	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	USD	-	-	265,63	-	-	-
Klasse IF Thes.	USD	1.491,57	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	1.269,11	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	1.336,41	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	SEK	910,72	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch. QV	USD	1.399,90	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	USD	-	-	-	-	109,14	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	CHF	-	-	-	-	98,69	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	-	-	-	-	100,40	124,06
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	USD	-	-	-	-	-	146,23
Klasse R Thes.	GBP	-	-	-	-	-	111,49
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	-	-	-	-	-	126,20
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	USD	-	-	-	-	-	148,77
Klasse X Thes.	EUR	-	-	231,23	-	-	-
Klasse X Thes.	USD	-	-	-	101,41	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	EUR	-	-	-	146,48	-	-

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Mindestanlage bei Erstzeichnung, Mindestanlage bei weiteren Zeichnungen und Mindestanlagebestand

Teilfonds	Anteilklassen	Mindestanlage bei Erstzeichnung		Mindestanlage bei Folgezeich- nungen		Mindestan- lagebestand	
Schroder GAIA BlueTrend	A-, C-, E- und N-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
Schroder GAIA Cat Bond	A-, C- und F-Anteile	USD	100.000	USD	50.000	USD	100.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
	IF-Anteile	USD	1.000.000	USD	500.000	USD	1.000.000
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A-, A1-, C- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
Schroder GAIA Egerton Equity	A-, A1-, C- und E-Anteile	EUR	10.000	EUR	5.000	EUR	10.000
	I-Anteile	EUR	5.000.000	EUR	2.500.000	EUR	5.000.000
	X-Anteile	EUR	100.000.000	EUR	2.500.000	EUR	100.000.000
Schroder GAIA Helix	A-, C-, C1- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
	X-Anteile	USD	100.000.000	USD	2.500.000	USD	100.000.000
Schroder GAIA M&A*	A-, C- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
Schroder GAIA Sirios US Equity	A-, C- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
	X-Anteile	USD	100.000.000	USD	2.500.000	USD	100.000.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C- und K-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	C- und K-Anteile	GBP	10.000	GBP	5.000	GBP	10.000
	I-Anteile	GBP	5.000.000	GBP	2.500.000	GBP	5.000.000
	R-Anteile		Entfällt		Entfällt		Entfällt
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A-, A1-, C-, C1- und E-Anteile	USD	10.000	USD	5.000	USD	10.000
	I-Anteile	USD	5.000.000	USD	2.500.000	USD	5.000.000

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden

Der Abschluss wird im Einklang mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen für Investmentfonds auf der Grundlage der Unternehmensfortführung aufgestellt und dargestellt. Der Teilfonds Schroder GAIA M&A wurde nach dem Ende des Berichtszeitraums aufgelöst. Aufgelöste oder nach dem Ende des Berichtszeitraums aufzulösende Teilfonds werden nach dem Nicht-Fortführungsprinzip aufgestellt. Die Anwendung des Nicht-Fortführungsprinzips hat für die Bilanzierung nicht zu wesentlichen Anpassungen der veröffentlichten Nettoinventarwerte der Teilfonds geführt.

Nettoinventarwert

Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil

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

Bewertung des Vermögens der Gesellschaft

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

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

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

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

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

Fair-Value-Pricing

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

Zum 31. März 2021 wurde die Fair-Value-Anpassung auf das folgende Wertpapier angewandt:

Teilfonds	Wertpapiername
Schroder GAIA Cat Bond	Voussoir Re perpetual, variabel
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Butterfly Network

Besteuerung

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

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

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

Von der Gesellschaft vereinnahmte Zins- und Dividendenerträge unterliegen gegebenenfalls einer nicht erstattungsfähigen Quellensteuer in den Herkunftsländern. Die Gesellschaft kann außerdem in den Herkunftsländern zu einer Steuer auf realisierten oder nicht realisierten Kapitalzuwachs seines Vermögens veranlagt werden, und in bestimmten Ländern werden Rückstellungen dafür anerkannt.

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Managementgebühren

Die Anlageverwalter sind berechtigt, Managementgebühren für ihre Dienste zu beziehen, die auf der Grundlage der Nettoinventarwerte der Teilfonds täglich berechnet und verbucht sowie monatlich gezahlt werden. Die für den Berichtszeitraum tatsächlich anfallenden Gebühren sind in der folgenden Tabelle dargestellt:

Teilfonds	Anteilsklasse	Managementgebühren
Schroder GAIA BlueTrend	A-Anteile	1,60 %
	C-, E- und N-Anteile	1,00 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Cat Bond	A- und F-Anteile	1,50 %
	C- und IF-Anteile	1,10 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	1,00 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Egerton Equity	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C- und E-Anteile	1,25 %
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25 % (1,25 %)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Helix	A-Anteile	2,00 %
	C- und C1-Anteile	1,00 %
	E-Anteile	0,75 %
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00 % (0,60 %)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA M&A*	A-Anteile	1,50 %
	C-Anteile	0,75 %
	E-Anteile	0,50 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Sirios US Equity	A-Anteile	2,00 %
	C-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	1,00 %
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,25 % (1,25 %)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C-Anteile	1,40 %
	K-Anteile	1,90 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund	C ¹ - und R ² -Anteile	0,75 %
	K ³ -Anteile	1,25 %
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Wellington Pagosa	A- und A1-Anteile	2,00 %
	C- und C1-Anteile	1,25 %
	E-Anteile	0,75 %
	I-Anteile	Entfällt

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

¹ 1,00 % bis zum 31. Oktober 2020, 0,75 % seit dem 1. November 2020.

² 1,00 % bis zum 31. Dezember 2020, 0,75 % seit dem 1. Januar 2021.

³ 1,50 % bis zum 31. Oktober 2020, 0,75 % seit dem 1. November 2020.

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Honorare der Verwaltungsratsmitglieder

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini, Bernard Herman und Eric Bertrand erhielten für den Berichtszeitraum jeweils eine Vergütung in Höhe von 10.083 EUR. Hugh Mullan erhielt für den Berichtszeitraum eine Vergütung in Höhe von 8.000 EUR. Die verbleibenden Verwaltungsratsmitglieder verzichteten auf ihr Honorar.

Performancegebühren

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

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

Nähere Einzelheiten zur Berechnung der während des Berichtszeitraums angefallenen Performancegebühren sind in der nachfolgenden Tabelle aufgeführt. Weitere Angaben zur Berechnung der Performancegebühren sind dem aktuellen Verkaufsprospekt zu entnehmen. Die für den Berichtszeitraum zahlbaren Gebühren sind in der Nettovermögensaufstellung unter „Fällige Performancegebühren“ ausgewiesen.

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

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

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

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

Für den Schroder GAIA Cat Bond wird keine Performancegebühr erhoben.

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Wiederanlage von Barsicherheiten

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

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

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

Devisenterminkontrakte

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

Am 31. März 2021 waren die folgenden Teilfonds in Devisenterminkontrakten engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Absicherung des Portfolios					
AUD	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	07. 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	06. 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. Sept. 2021	(15)
KRW	1.319.690.500	USD	1.173.786	16. Jun. 2021	(7.787)
MXN	8.343.765	USD	405.334	05. Apr. 2021	2.884
MXN	8.283.435	USD	404.593	06. Apr. 2021	628
MXN	84.201.136	USD	4.076.367	21. Apr. 2021	35.973
NOK	1.835.796	USD	214.672	06. Apr. 2021	(38)
NOK	985.661	USD	115.511	07. 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	06. 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. Mai 2021	(42.253)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
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	07. 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	06. 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	06. 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. Sept. 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	05. Apr. 2021	(10)
USD	658	MXN	13.488	06. Apr. 2021	(2)
USD	779.001	MXN	16.118.452	21. Apr. 2021	(8.216)
USD	214.865	NOK	1.835.796	06. Apr. 2021	230
USD	6.221	NOK	53.203	07. Apr. 2021	1
USD	6.637.293	NOK	56.875.422	21. Apr. 2021	(12.430)
USD	70.161	NZD	100.000	06. 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	06. 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	06. 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	06. 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)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Absicherung der Anteilsklasse					
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					
Absicherung des Portfolios					
USD	61.259.961	EUR	50.400.001	16. Apr. 2021	2.142.431
					USD 2.142.431
Absicherung der Anteilsklasse					
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					
Absicherung des Portfolios					
AUD	7.546.940	USD	5.831.440	12. Mai 2021	(98.076)
EUR	15.516.478	USD	18.670.518	12. Mai 2021	(460.186)
GBP	4.033.060	USD	5.606.992	12. Mai 2021	(46.343)
JPY	697.458.475	USD	6.537.264	12. Mai 2021	(235.855)
NOK	74.320.144	USD	8.763.896	12. Mai 2021	(74.638)
USD	6.284.325	AUD	8.103.426	12. Mai 2021	128.204
USD	18.087.906	EUR	15.094.835	12. Mai 2021	372.421
USD	5.314.658	GBP	3.815.411	12. Mai 2021	54.096
USD	7.653.534	JPY	821.722.910	12. Mai 2021	229.418
USD	8.691.040	NOK	74.112.426	12. Mai 2021	26.067
					USD (104.892)
Absicherung der Anteilsklasse					
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)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)					
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					
Absicherung des Portfolios					
CNY	125.022.000	EUR	16.014.705	09. Apr. 2021	243.180
EUR	18.954.923	BRL	129.761.000	09. Apr. 2021	(697.080)
EUR	29.173.725	CAD	44.431.000	08. Apr. 2021	(973.391)
EUR	5.339.094	DKK	39.714.000	08. Apr. 2021	385
EUR	11.021.353	HKD	103.252.000	08. Apr. 2021	(303.655)
EUR	3.509.689	IDR	60.577.258.000	09. Apr. 2021	(45.334)
EUR	9.587.397	INR	852.032.000	09. Apr. 2021	(342.129)
EUR	3.983.885	JPY	514.714.000	08. Apr. 2021	20.004
EUR	13.310.953	RUB	1.199.366.000	08. Apr. 2021	(209.882)
EUR	3.099.353	SEK	31.469.000	08. Apr. 2021	26.824
EUR	731.565.220	USD	882.685.000	08. Apr. 2021	(21.082.564)
EUR	2.927.125	ZAR	53.346.000	08. Apr. 2021	(153.255)
USD	61.013.000	EUR	50.965.780	08. Apr. 2021	1.058.780
ZAR	53.346.000	EUR	3.009.244	08. Apr. 2021	71.135
					EUR (22.386.982)
Absicherung der Anteilsklasse					
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					
Absicherung des Portfolios					
AUD	1.748.000	USD	1.362.317	01. 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. Mai 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. Mai 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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Helix (Forts.)						
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	08. Apr. 2021	(17.318)	
GBP	16.888.650	USD	23.528.233	22. Apr. 2021	(244.236)	
GBP	624.000	USD	866.900	18. Mai 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. Mai 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. Mai 2021	(51.024)	
TRY	380.000	USD	49.599	15. Apr. 2021	(3.926)	
TRY	421.000	USD	57.056	10. Mai 2021	(7.384)	
USD	1.361.146	AUD	1.748.000	01. 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	02. 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	08. 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. Mai 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. Mai 2021	31	
					USD	(1.719.440)
Absicherung der Anteilsklasse						
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)	

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)					
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*					
Absicherung des Portfolios					
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
Absicherung der Anteilsklasse					
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					
Absicherung des Portfolios					
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
Absicherung der Anteilsklasse					
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					
Absicherung des Portfolios					
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)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)						
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
Absicherung der Anteilsklasse						
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						
Absicherung der Anteilsklasse						
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)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Absicherung des Portfolios					
AUD	1.373.736	EUR	888.000	06. Apr. 2021	2.049
AUD	1.384.851	GBP	766.000	06. Apr. 2021	(4.140)
AUD	51.300.000	USD	39.295.716	07. Apr. 2021	(330.300)
AUD	10.553.000	USD	8.035.636	06. Mai 2021	(18.759)
AUD	940.000	USD	724.056	16. Jun. 2021	(9.855)
BRL	46.665.000	USD	8.292.167	05. 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	04. Mai 2021	33.497
BRL	18.177.000	USD	3.203.772	02. 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. Sept. 2021	(1.984)
CAD	36.617.000	USD	28.969.646	07. 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	06. Mai 2021	1.801
CAD	2.000.000	USD	1.587.858	16. Jun. 2021	3.756
CHF	6.406.000	USD	6.914.024	07. Apr. 2021	(135.897)
CHF	832.000	USD	886.841	30. Apr. 2021	(5.959)
CHF	140.000	USD	148.667	06. Mai 2021	(418)
CHF	768.000	USD	823.954	16. Jun. 2021	(9.755)
CLP	11.328.200.000	USD	15.513.477	07. Apr. 2021	211.009
CLP	1.981.058.000	USD	2.702.483	06. Mai 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	07. Apr. 2021	(437.003)
CNH	36.031.000	USD	5.466.373	06. Mai 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	07. Apr. 2021	(155.271)
COP	4.736.900.000	USD	1.271.317	06. Mai 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	07. 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	06. Apr. 2021	1.593
EUR	888.000	MXN	22.232.856	06. Apr. 2021	(46.239)
EUR	2.177.000	USD	2.557.540	06. Apr. 2021	(4.518)
EUR	41.143.000	USD	49.616.983	07. 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	06. Mai 2021	(48.410)
EUR	4.424.000	USD	5.252.761	16. Jun. 2021	(56.681)
EUR	883.000	ZAR	15.942.388	06. Apr. 2021	(44.428)
GBP	766.000	AUD	1.372.289	06. Apr. 2021	13.682
GBP	14.688.000	USD	20.361.656	07. Apr. 2021	(112.652)
GBP	931.000	USD	1.276.935	06. Mai 2021	6.676

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
GBP	4.929.000	USD	6.837.075	16. Jun. 2021	(40.432)
HKD	2.174.000	USD	280.230	07. Apr. 2021	(582)
HKD	4.630.000	USD	596.447	16. Jun. 2021	(775)
HUF	1.497.944.400	USD	4.854.000	06. Apr. 2021	(3.466)
HUF	4.455.420.601	USD	14.715.967	07. Apr. 2021	(288.899)
HUF	1.222.107.000	USD	3.951.126	06. Mai 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	07. 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	07. 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	07. Apr. 2021	102.370
INR	778.647.000	USD	10.569.749	06. Mai 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	07. Apr. 2021	(361.235)
JPY	461.151.000	USD	4.182.429	06. Mai 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	07. 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	04. Mai 2021	(163)
KZT	211.350.000	USD	494.386	16. Jun. 2021	(6.929)
MXN	21.321.127	EUR	888.000	06. Apr. 2021	1.638
MXN	20.306.364	USD	969.000	05. Apr. 2021	24.486
MXN	636.040.000	USD	30.374.894	07. Apr. 2021	736.369
MXN	94.259.000	USD	4.577.815	06. Mai 2021	18.277
MXN	12.553.000	USD	612.880	10. Mai 2021	(1.080)
MXN	128.344.000	USD	6.164.905	16. Jun. 2021	63.984
NOK	8.126.844	USD	968.000	06. Apr. 2021	(17.841)
NOK	128.059.000	USD	15.013.049	07. Apr. 2021	(40.868)
NOK	33.624.217	USD	3.927.194	06. Mai 2021	4.077
NZD	24.649.000	USD	17.649.224	07. Apr. 2021	(434.357)
NZD	6.450.000	USD	4.502.895	06. Mai 2021	1.516
NZD	560.000	USD	402.268	16. Jun. 2021	(11.233)
PEN	10.965.000	USD	2.940.228	07. 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	07. Apr. 2021	(1.093)
PHP	101.190.000	USD	2.084.672	06. Mai 2021	(1.839)
PHP	58.570.000	USD	1.195.127	16. Jun. 2021	8.989
PLN	27.890.000	USD	7.426.382	07. Apr. 2021	(368.953)
PLN	5.440.000	USD	1.374.953	06. Mai 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	07. Apr. 2021	(228.762)
RUB	176.180.000	USD	2.298.964	06. Mai 2021	21.667
RUB	225.516.000	USD	3.000.053	16. Jun. 2021	(44.767)
SEK	130.379.000	USD	15.104.964	07. Apr. 2021	(175.977)
SEK	8.333.000	USD	955.099	06. Mai 2021	(674)
SGD	36.789.000	USD	27.604.603	07. Apr. 2021	(256.540)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
SGD	10.850.000	USD	8.056.922	16. Jun. 2021	6.037
THB	505.630.000	USD	16.502.912	07. 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	07. Apr. 2021	(1.743.296)
TRY	1.915.000	USD	225.931	06. Mai 2021	562
TRY	3.234.000	USD	440.810	11. Mai 2021	(59.477)
TRY	34.570.000	USD	4.226.306	16. Jun. 2021	(241.794)
TWD	439.535.000	USD	15.568.578	07. Apr. 2021	(163.941)
TWD	17.205.000	USD	606.002	06. Mai 2021	(2.918)
TWD	88.435.000	USD	3.155.414	16. Jun. 2021	(54.825)
USD	39.696.087	AUD	51.300.000	07. Apr. 2021	730.667
USD	701.243	AUD	925.000	30. Apr. 2021	(1.438)
USD	21.147.330	AUD	27.828.000	06. Mai 2021	7.024
USD	2.759.507	AUD	3.575.000	16. Jun. 2021	43.262
USD	8.376.426	BRL	46.665.000	05. Apr. 2021	85.804
USD	776.587	BRL	4.491.000	28. Apr. 2021	(20.198)
USD	779.179	BRL	4.420.000	04. Mai 2021	(4.734)
USD	4.748.553	BRL	26.550.000	02. 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	07. Apr. 2021	(27.722)
USD	160.409	CAD	200.000	08. 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	05. Mai 2021	(22)
USD	1.252.258	CAD	1.575.000	06. Mai 2021	(1.104)
USD	196.820	CAD	250.000	10. Mai 2021	(2.127)
USD	790.420	CAD	990.000	14. Mai 2021	2.591
USD	151.688	CAD	200.000	27. Mai 2021	(7.470)
USD	638.674	CAD	850.000	01. Jun. 2021	(37.744)
USD	520.839	CAD	700.000	04. Jun. 2021	(36.213)
USD	74.329	CAD	100.000	07. 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	01. Dez. 2021	(18.386)
USD	750.689	CAD	960.000	02. Dez. 2021	(13.439)
USD	157.845	CAD	200.000	06. Dez. 2021	(1.350)
USD	273.069	CAD	346.000	07. Mrz. 2022	(2.341)
USD	7.004.048	CHF	6.406.000	07. Apr. 2021	225.923
USD	642.863	CHF	602.000	30. Apr. 2021	5.494
USD	1.479.667	CHF	1.391.000	06. Mai 2021	6.701
USD	216.739	CHF	200.000	17. Jun. 2021	4.702
USD	15.734.078	CLP	11.328.200.000	07. Apr. 2021	9.593

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	5.351.328	CLP	3.890.696.000	16. Jun. 2021	(51.600)
USD	36.003.758	CNH	235.454.000	07. Apr. 2021	144.253
USD	14.320.645	CNH	94.316.000	06. Mai 2021	(11.994)
USD	438.836	CNH	2.834.000	20. Mai 2021	8.632
USD	2.574.469	CNH	16.916.000	16. Jun. 2021	11.901
USD	107.087	CNY	704.000	07. Apr. 2021	(296)
USD	12.959.254	COP	46.954.097.000	07. Apr. 2021	136.572
USD	1.360.083	COP	5.025.507.000	06. Mai 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	07. Apr. 2021	81.508
USD	2.259.897	CZK	50.280.000	06. Mai 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	06. Apr. 2021	98.040
USD	48.631.112	EUR	41.143.000	07. 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	06. Mai 2021	(2.170)
USD	15.316.836	EUR	12.851.000	16. Jun. 2021	223.068
USD	20.424.924	GBP	14.688.000	07. 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	06. Mai 2021	(8.516)
USD	523.914	GBP	379.000	16. Jun. 2021	1.308
USD	280.254	HKD	2.174.000	07. Apr. 2021	607
USD	20.969	HKD	163.000	06. Mai 2021	-
USD	183.701	HKD	1.426.000	16. Jun. 2021	239
USD	4.854.000	HUF	1.468.407.750	06. Apr. 2021	99.109
USD	14.661.851	HUF	4.455.545.918	07. Apr. 2021	234.379
USD	873.155	HUF	269.699.733	06. Mai 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	07. Apr. 2021	28.055
USD	2.504.374	IDR	36.644.000.000	06. Mai 2021	(12.687)
USD	483.560	IDR	7.056.000.000	16. Jun. 2021	461
USD	9.377.044	ILS	30.917.000	07. Apr. 2021	128.994
USD	7.636.186	ILS	25.422.000	06. Mai 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	07. Apr. 2021	(233.397)
USD	2.987.896	INR	220.940.000	06. Mai 2021	(21.406)
USD	3.027.399	INR	223.539.000	16. Jun. 2021	(304)
USD	18.479.841	JPY	1.992.575.000	07. 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	06. Mai 2021	22.705
USD	1.635.995	JPY	170.800.000	10. Mai 2021	92.872
USD	1.511.001	JPY	159.300.000	17. Mai 2021	71.698
USD	606.428	JPY	63.500.000	24. Mai 2021	32.663
USD	2.038.410	JPY	215.200.000	01. Jun. 2021	93.813
USD	2.120.998	JPY	224.900.000	07. Jun. 2021	88.637

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
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	06. Jul. 2021	1.039
USD	15.073.848	KRW	17.083.170.000	07. Apr. 2021	(20.321)
USD	9.500.776	KRW	10.778.630.000	06. Mai 2021	(21.431)
USD	4.275.148	KRW	4.802.671.000	16. Jun. 2021	31.792
USD	171.108	KZT	72.550.000	04. Mai 2021	2.016
USD	969.000	MXN	19.987.162	05. Apr. 2021	(8.869)
USD	30.739.263	MXN	636.040.000	07. Apr. 2021	(372.000)
USD	3.554.813	MXN	73.500.000	06. Mai 2021	(29.064)
USD	6.706.825	MXN	141.761.000	16. Jun. 2021	(173.227)
USD	968.000	NOK	8.285.393	06. Apr. 2021	(696)
USD	15.103.352	NOK	129.339.000	07. Apr. 2021	(18.485)
USD	4.343.778	NOK	37.188.000	06. Mai 2021	(4.162)
USD	7.593.810	NZD	10.502.000	07. 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	07. Apr. 2021	63.564
USD	1.221.536	PEN	4.600.000	06. Mai 2021	(7.248)
USD	3.274.261	PEN	12.134.000	16. Jun. 2021	33.999
USD	4.341.598	PHP	212.290.000	07. Apr. 2021	(31.877)
USD	2.078.385	PHP	101.155.000	06. Mai 2021	(3.728)
USD	3.546.061	PHP	173.630.000	16. Jun. 2021	(23.524)
USD	7.225.372	PLN	27.890.000	07. Apr. 2021	167.944
USD	394.253	PLN	1.565.000	06. Mai 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	07. Apr. 2021	309.040
USD	7.260.635	RUB	552.803.000	06. Mai 2021	(20.848)
USD	6.256.256	RUB	471.093.000	16. Jun. 2021	82.791
USD	15.499.507	SEK	130.379.000	07. Apr. 2021	570.519
USD	10.462.080	SEK	91.330.000	06. Mai 2021	1.555
USD	901.000	SEK	7.694.000	16. Jun. 2021	19.422
USD	27.501.400	SGD	36.789.000	07. Apr. 2021	153.335
USD	5.790.846	SGD	7.806.000	06. Mai 2021	(11.073)
USD	3.607.309	SGD	4.855.000	16. Jun. 2021	(587)
USD	17.506.548	THB	534.536.020	07. Apr. 2021	401.591
USD	5.974.137	THB	186.871.000	06. Mai 2021	(4.947)
USD	3.195.527	THB	98.640.000	16. Jun. 2021	39.905
USD	31.694.951	TRY	244.367.000	07. Apr. 2021	2.144.944
USD	5.208.322	TRY	45.046.000	06. Mai 2021	(119.401)
USD	314.502	TRY	2.327.000	11. Mai 2021	40.117
USD	6.370.327	TRY	53.003.000	16. Jun. 2021	261.242
USD	15.628.685	TWD	439.535.000	07. Apr. 2021	224.048
USD	10.084.482	TWD	286.843.000	06. Mai 2021	29.817
USD	1.620.642	TWD	45.605.000	16. Jun. 2021	21.700
USD	25.251.739	ZAR	376.893.000	07. Apr. 2021	(275.284)
USD	13.016.492	ZAR	195.403.000	06. Mai 2021	(166.237)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	6.779.967	ZAR	104.649.000	17. Jun. 2021	(240.422)
ZAR	15.293.560	EUR	780	06. Apr. 2021	476
ZAR	376.893.000	USD	25.067.162	07. Apr. 2021	459.861
ZAR	51.320.000	USD	3.439.123	06. Mai 2021	23.146
ZAR	24.160.000	USD	1.602.047	17. Jun. 2021	18.729
ZAR	9.198.000	USD	600.627	08. Jul. 2021	14.812
					USD 1.332.651
Absicherung der Anteilsklasse					
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)

Die Devisenterminkontrakte waren mit den folgenden Kontrahenten verbunden:

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
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)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix	Australia and New Zeland 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)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Kassageschäfte

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

Zum 31. März 2021 wies der folgende Teilfonds offene Kassageschäfte auf:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Abrechnungsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Two Sigma Diversified						
Absicherung des Portfolios						
AUD	1.000.000	JPY	84.168.278	01. Apr. 2021	(609)	
AUD	1.000.000	JPY	84.228.000	06. Apr. 2021	(1.145)	
AUD	1.000.000	NZD	1.088.460	06. Apr. 2021	(630)	
CAD	1.736.510	GBP	1.000.000	06. Apr. 2021	3.202	
CAD	1.000.000	JPY	87.634.143	01. Apr. 2021	4.278	
CAD	3.000.000	JPY	263.354.000	05. Apr. 2021	8.754	
CAD	1.260.460	USD	1.000.000	01. Apr. 2021	2.992	
EUR	4.000.000	JPY	519.086.000	06. Apr. 2021	2.735	
GBP	1.356.000	USD	1.863.239	01. Apr. 2021	6.143	
JPY	171.802.421	USD	1.549.499	01. Apr. 2021	2.114	
SGD	389.517	USD	289.000	01. Apr. 2021	561	
USD	760.125	AUD	1.000.000	01. Apr. 2021	576	
USD	2.000.000	JPY	221.293.000	02. Apr. 2021	1.417	
USD	2.049.358	THB	64.024.000	01. Apr. 2021	590	
USD	2.044.973	THB	64.024.000	02. Apr. 2021	(3.795)	
					USD	27.183

Kontrahenten von Kassageschäften

Fonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
	Citi Bank	6.652
	Deutsche Bank	12.057
	Morgan Stanley	6.704
	Newedge Group	1.770
		USD
		27.183

Terminkontrakte

Terminkontrakte wurden zum letzten verfügbaren Preis am Tag der Berechnung des NIW bewertet. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter „Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Terminkontrakten“ aufgeführt. Zum 31. März 2021 hielten die folgenden Teilfonds offene Terminkontrakte auf Rentenwerte und Währungen:

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long-Position	Marktpreis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Dez. 21	24	3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(7.074.914)	100,55	366
Mrz. 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)
Dez. 21	35	90 Days Bank Bill Future	Credit Suisse	AUD	(26.575.655)	10,00	(730)
Mrz. 22	7	90 Days Bank Bill Future	Credit Suisse	AUD	5.315.577	10,00	(692)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Dez. 21	24	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(5.985.925)	99,74	1.825
Mrz. 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
Dez. 23	4	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	988.588	98,80	(638)
Mrz. 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)
Dez. 24	5	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	1.227.175	98,13	(550)
Mrz. 25	6	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	(1.472.850)	98,00	2.850
Dez. 21	19	90 Days Sterling Future	Morgan Stanley	GBP	3.271.263	99,87	(1.344)
Mrz. 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)
Dez. 21	15	Bankers' Acceptance Future	Credit Suisse	CAD	2.969.295	99,49	(656)
Mrz. 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
Mai 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)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)								
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	
Dez. 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)	
Dez. 23	24	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	5.968.613	98,80	(40.912)	
Mrz. 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)	
Dez. 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)	

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
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
Mai 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	UD Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	(642.761)	93,24	(9.891)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Optionskontrakte

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

Zum 31. März 2021 wiesen die folgenden Teilfonds offene Optionskontrakte auf Finanzindizes und international notierte Aktien auf:

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend						
(700.087)	Put auf UBS ETC Linked to a Systematica Strategy Delta-1 Basket on Commodity Future Ausübungskurs 68,87 Läuft am 1. Apr. 2021 ab	UBS	USD	(2.757)	-	2.757
				USD	-	2.757
Schroder GAIA Contour Tech Equity						
3.100	Call auf Hitachi, Ltd. Ausübungskurs 6.000,00 Läuft am 12. Nov. 2021 ab	Morgan Stanley	JPY	621.838	466.321	(155.517)
				USD	466.321	(155.517)
Schroder GAIA Egerton Equity						
(542.700)	Put auf boohoo Group PLC Ausübungskurs 1,11 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Goldman Sachs	GBP	(121.064)	(45)	121.019
542.700	Put auf boohoo Group PLC Ausübungskurs 1,67 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Goldman Sachs	GBP	254.919	618	(254.301)
				EUR	573	(133.282)
Schroder GAIA Helix						
80	Put auf Deutsche Börse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 13.800,00 Läuft am 16. Apr. 2021 ab	Goldman Sachs	EUR	43.341	9.804	(33.537)
203	Put auf Deutsche Börse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 14.000,00 Läuft am 16. Apr. 2021 ab	Goldman Sachs	EUR	100.631	31.543	(69.088)
81	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 6.400,00 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Goldman Sachs	GBP	144.078	110.829	(33.249)
14	Put auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 1.270,00 Läuft am 16. Apr. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	16.432	7.770	(8.662)
19	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.530,00 Läuft am 16. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	67.310	5.225	(62.085)
77	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.800,00 Läuft am 16. Apr. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	218.316	97.020	(121.296)
30	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.900,00 Läuft am 16. Apr. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	74.212	75.600	1.388
				USD	337.791	(326.529)
Schroder GAIA M&A*						
2	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.530,00 Läuft am 16. Apr. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	7.085	550	(6.535)
				USD	550	(6.535)
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund						
79	Put auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 6.400,00 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Morgan Stanley	GBP	101.250	78.407	(22.843)
				GBP	78.407	(22.843)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
12	Call auf Amazon.Com, Inc. Ausübungskurs 3.550,00 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	55.008	35.550	(19.458)
3.761	Call auf ASML Holding NV Ausübungskurs 560,00 Läuft am 16. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	EUR	25.922	11.546	(14.376)
3.385	Call auf ASML Holding NV Ausübungskurs 590,00 Läuft am 21. Mai 2021 ab	Morgan Stanley	EUR	26.029	21.697	(4.332)
32.451	Call auf Bayerische Motoren Werke Aktiengesellschaft Ausübungskurs 96,00 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Goldman Sachs	EUR	50.576	73.406	22.830
194.212	Call auf BP PLC Ausübungskurs 3,20 Läuft am 17. Sep. 2021 ab	Goldman Sachs	GBP	58.362	39.099	(19.263)
(194.212)	Call auf BP PLC Ausübungskurs 4,00 Läuft am 17. Sep. 2021 ab	Goldman Sachs	GBP	(15.957)	(8.580)	7.377
2	Call auf CBOE Mini Index Ausübungskurs 404,00 Läuft am 16. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	1.015	340	(675)
52.464	Call auf Covestro AG Ausübungskurs 63,00 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Goldman Sachs	EUR	101.253	91.872	(9.381)
234	Call auf DISH Network Corp. Ausübungskurs 40,00 Läuft am 16. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	38.940	6.084	(32.856)
112.558	Call auf Engie S.A. Ausübungskurs 15,00 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	J.P. Morgan	EUR	51.413	1.813	(49.600)
122.971	Call auf Engie S.A. Ausübungskurs 15,50 Läuft am 16. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	EUR	21.992	15	(21.977)
19.487.029	Call auf Euro Stoxx 50 Index versus S&P 500 Index Ausübungskurs 2,50 % Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Goldman Sachs	USD	216.902	183.451	(33.451)
17.905.507	Call auf Euro Stoxx 50 Index versus S&P 500 Index Ausübungskurs 2,50 % Läuft am 17. Dez. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	176.846	126.091	(50.755)
16.865	Call auf Euro Stoxx Banks Index Ausübungskurs 114,85 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Goldman Sachs	EUR	45.203	2.194	(43.009)
228.465	Call auf Euro Stoxx Banks Index Ausübungskurs 120,00 Läuft am 17. Dez. 2021 ab	J.P. Morgan	EUR	345.695	220.948	(124.747)
61.046	Call auf Euro Stoxx Banks Index Ausübungskurs 120,64 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Goldman Sachs	EUR	71.265	4.210	(67.055)
(1.385.000)	Call auf Foreign Exchange AUD/USD Ausübungskurs 0,78 Läuft am 1. Apr. 2021 ab	Barclays Bank	AUD	(13.574)	-	13.574
980.000	Call auf Foreign Exchange EUR/AUD Ausübungskurs 1,54 Läuft am 22. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	10.612	8.849	(1.763)
1.014.000	Call auf Foreign Exchange EUR/AUD Ausübungskurs 1,54 Läuft am 28. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	EUR	10.670	10.000	(670)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
844.000	Call auf Foreign Exchange EUR/AUD Ausübungskurs 1,55 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	EUR	9.419	5.109	(4.310)
888.000	Call auf Foreign Exchange EUR/AUD Ausübungskurs 1,55 Läuft am 31. Mrz. 2021 ab	Citi Bank	EUR	9.520	-	(9.520)
(851.000)	Call auf Foreign Exchange EUR/BRL Ausübungskurs 6,74 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	BNP Paribas	EUR	(23.527)	(7.119)	16.408
(892.000)	Call auf Foreign Exchange EUR/BRL Ausübungskurs 6,78 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Bank of America	EUR	(24.869)	(1.620)	23.249
892.000	Call auf Foreign Exchange EUR/CAD Ausübungskurs 1,52 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Bank of America	EUR	7.735	2	(7.733)
856.000	Call auf Foreign Exchange EUR/CNH Ausübungskurs 7,75 Läuft am 22. Apr. 2021 ab	Bank of America	EUR	6.222	3.063	(3.159)
911.000	Call auf Foreign Exchange EUR/CNH Ausübungskurs 7,79 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Bank of America	EUR	7.466	344	(7.122)
1.051.000	Call auf Foreign Exchange EUR/JPY Ausübungskurs 128,92 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	10.223	10.022	(201)
1.136.000	Call auf Foreign Exchange EUR/JPY Ausübungskurs 130,12 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	10.397	5.121	(5.276)
(856.000)	Call auf Foreign Exchange EUR/MXN Ausübungskurs 24,59 Läuft am 22. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	EUR	(17.995)	(6.033)	11.962
(888.000)	Call auf Foreign Exchange EUR/MXN Ausübungskurs 25,04 Läuft am 31. Mrz. 2021 ab	J.P. Morgan	EUR	(17.894)	-	17.894
852.000	Call auf Foreign Exchange EUR/NZD Ausübungskurs 1,66 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	9.450	13.975	4.525
980.000	Call auf Foreign Exchange EUR/NZD Ausübungskurs 1,66 Läuft am 22. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	10.679	15.229	4.550
(891.000)	Call auf Foreign Exchange EUR/RUB Ausübungskurs 88,98 Läuft am 7. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	(17.832)	(5.445)	12.387
891.000	Call auf Foreign Exchange EUR/SEK Ausübungskurs 10,18 Läuft am 7. Apr. 2021 ab	Bank of America	EUR	6.939	7.619	680
1.145.000	Call auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,18 Läuft am 2. Jul. 2021 ab	Citi Bank	EUR	16.559	15.984	(575)
1.202.000	Call auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,19 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	11.274	268	(11.006)
1.177.000	Call auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,21 Läuft am 31. Mrz. 2021 ab	Morgan Stanley	EUR	10.961	-	(10.961)
1.232.000	Call auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,22 Läuft am 14. Mai 2021 ab	Bank of America	EUR	17.260	704	(16.556)
1.000.000	Call auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,23 Läuft am 31. Mrz. 2021 ab	Morgan Stanley	EUR	15.951	-	(15.951)
(883.000)	Call auf Foreign Exchange EUR/ZAR Ausübungskurs 18,05 Läuft am 31. Mrz. 2021 ab	Citi Bank	EUR	(19.604)	-	19.604
(911.000)	Call auf Foreign Exchange EUR/ZAR Ausübungskurs 18,37 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Bank of America	EUR	(20.380)	(332)	20.048

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
777.000	Call auf Foreign Exchange GBP/AUD Ausübungskurs 1,81 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Citi Bank	GBP	10.483	6.190	(4.293)
721.000	Call auf Foreign Exchange GBP/JPY Ausübungskurs 150,50 Läuft am 22. Apr. 2021 ab	Citi Bank	GBP	9.642	17.101	7.459
732.000	Call auf Foreign Exchange GBP/JPY Ausübungskurs 151,85 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	Citi Bank	GBP	10.029	9.503	(526)
735.000	Call auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,39 Läuft am 10. Mai 2021 ab	Citi Bank	GBP	14.030	7.195	(6.835)
1.080.000	Call auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 5,82 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	25.866	2.034	(23.832)
2.211.000	Call auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 6,27 Läuft am 15. Sep. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	48.730	45.819	(2.911)
3.130.000	Call auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 6,31 Läuft am 9. Jun. 2021 ab	Bank of America	USD	50.794	19.009	(31.785)
(1.066.000)	Call auf Foreign Exchange USD/CAD Ausübungskurs 1,26 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	(8.929)	(1.366)	7.563
1.236.000	Call auf Foreign Exchange USD/CHF Ausübungskurs 0,88 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	15.747	82.795	67.048
1.206.000	Call auf Foreign Exchange USD/CHF Ausübungskurs 0,90 Läuft am 26. Mai 2021 ab	Bank of America	USD	16.814	51.732	34.918
(1.011.000)	Call auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 720,40 Läuft am 4. Mai 2021 ab	Bank of America	USD	(15.570)	(16.012)	(442)
(628.000)	Call auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 737,70 Läuft am 13. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	(17.144)	(1.769)	15.375
1.066.000	Call auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,48 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	5.970	13.906	7.936
1.016.000	Call auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,52 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	Deutsche Bank	USD	5.596	8.596	3.000
1.347.000	Call auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,55 Läuft am 15. Jul. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	21.939	22.312	373
(1.347.000)	Call auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,76 Läuft am 15. Jul. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	(9.461)	(6.805)	2.656
1.073.000	Call auf Foreign Exchange USD/HUF Ausübungskurs 310,18 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Citi Bank	USD	13.158	3.192	(9.966)
2.339.000	Call auf Foreign Exchange USD/HUF Ausübungskurs 310,22 Läuft am 4. Mai 2021 ab	Morgan Stanley	USD	27.050	21.502	(5.548)
751.000	Call auf Foreign Exchange USD/IDR Ausübungskurs 14.177,00 Läuft am 6. Mai 2021 ab	Barclays Bank	USD	12.789	24.657	11.868
802.000	Call auf Foreign Exchange USD/IDR Ausübungskurs 14.610,00 Läuft am 21. Jun. 2021 ab	Barclays Bank	USD	13.722	15.911	2.189
942.000	Call auf Foreign Exchange USD/IDR Ausübungskurs 14.843,00 Läuft am 12. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	8.436	1.161	(7.275)
761.000	Call auf Foreign Exchange USD/ILS Ausübungskurs 3,18 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	9.923	37.684	27.761

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1.072.000	Call auf Foreign Exchange USD/ILS Ausübungskurs 3,30 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Barclays Bank	USD	9.316	14.931	5.615
(1.073.000)	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 73,85 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	(8.046)	(1.489)	6.557
(1.072.000)	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 73,93 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(8.930)	(733)	8.197
741.000	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 74,12 Läuft am 19. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	8.147	1.870	(6.277)
859.000	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 74,17 Läuft am 7. Jun. 2021 ab	Citi Bank	USD	11.040	7.872	(3.168)
1.643.000	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 75,20 Läuft am 14. Mai 2021 ab	Barclays Bank	USD	7.854	4.842	(3.012)
1.568.000	Call auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 75,48 Läuft am 31. Mrz. 2021 ab	Deutsche Bank	USD	8.210	-	(8.210)
1.236.000	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 103,59 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Deutsche Bank	USD	15.316	79.558	64.242
1.206.000	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 105,68 Läuft am 26. Mai 2021 ab	Morgan Stanley	USD	15.494	55.364	39.870
1.429.000	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 106,68 Läuft am 1. Apr. 2021 ab	Citi Bank	USD	11.046	52.204	41.158
(1.080.000)	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 108,60 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	(8.273)	(20.861)	(12.588)
(1.016.000)	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 108,65 Läuft am 23. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	(6.878)	(20.108)	(13.230)
1.537.000	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 109,61 Läuft am 27. Apr. 2021 ab	Citi Bank	USD	10.502	20.075	9.573
800.000	Call auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 95,99 Läuft am 17. Jun. 2024 ab	BNP Paribas	USD	55.269	99.627	44.358
2.692.000	Call auf Foreign Exchange USD/MXN Ausübungskurs 20,48 Läuft am 6. Mai 2021 ab	Barclays Bank	USD	78.283	52.388	(25.895)
(2.692.000)	Call auf Foreign Exchange USD/MXN Ausübungskurs 21,66 Läuft am 6. Mai 2021 ab	Barclays Bank	USD	(34.108)	(13.169)	20.939
992.000	Call auf Foreign Exchange USD/PHP Ausübungskurs 48,21 Läuft am 20. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	8.154	9.238	1.084
628.000	Call auf Foreign Exchange USD/PHP Ausübungskurs 48,23 Läuft am 13. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	5.458	4.878	(580)
1.002.000	Call auf Foreign Exchange USD/PHP Ausübungskurs 49,06 Läuft am 8. Jun. 2021 ab	Deutsche Bank	USD	10.327	6.303	(4.024)
1.072.000	Call auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 3,76 Läuft am 1. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	11.529	51.222	39.693
2.425.000	Call auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 3,77 Läuft am 1. Apr. 2021 ab	Barclays Bank	USD	26.505	110.410	83.905
2.417.000	Call auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 3,79 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Citi Bank	USD	26.527	102.167	75.640

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1.073.000	Call auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 3,87 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Citi Bank	USD	12.600	21.818	9.218
1.022.000	Call auf Foreign Exchange USD/RUB Ausübungskurs 76,37 Läuft am 23. Apr. 2021 ab	Barclays Bank	USD	18.713	11.877	(6.836)
805.000	Call auf Foreign Exchange USD/SEK Ausübungskurs 8,39 Läuft am 6. Mai 2021 ab	Citi Bank	USD	13.870	32.348	18.478
1.016.000	Call auf Foreign Exchange USD/SEK Ausübungskurs 8,52 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	Barclays Bank	USD	10.718	25.697	14.979
1.031.000	Call auf Foreign Exchange USD/SEK Ausübungskurs 8,71 Läuft am 4. Mai 2021 ab	Deutsche Bank	USD	10.605	12.041	1.436
866.000	Call auf Foreign Exchange USD/SGD Ausübungskurs 1,32 Läuft am 26. Mai 2021 ab	J.P. Morgan	USD	7.816	16.947	9.131
761.000	Call auf Foreign Exchange USD/SGD Ausübungskurs 1,32 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	7.610	11.981	4.371
761.000	Call auf Foreign Exchange USD/THB Ausübungskurs 30,03 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	9.242	31.188	21.946
743.000	Call auf Foreign Exchange USD/THB Ausübungskurs 30,09 Läuft am 25. Mai 2021 ab	Bank of America	USD	7.547	29.526	21.979
630.000	Call auf Foreign Exchange USD/TRY Ausübungskurs 7,64 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Citi Bank	USD	22.702	49.210	26.508
(630.000)	Call auf Foreign Exchange USD/TWD Ausübungskurs 27,43 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(6.712)	(23.011)	(16.299)
(1.073.000)	Call auf Foreign Exchange USD/TWD Ausübungskurs 28,16 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	(6.549)	(11.725)	(5.176)
(1.016.000)	Call auf Foreign Exchange USD/TWD Ausübungskurs 28,20 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	(6.553)	(9.900)	(3.347)
(1.016.000)	Call auf Foreign Exchange USD/ZAR Ausübungskurs 14,96 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(20.229)	(8.974)	11.255
2.568.000	Call auf Foreign Exchange USD/ZAR Ausübungskurs 15,31 Läuft am 6. Jul. 2021 ab	Citi Bank	USD	119.258	67.097	(52.161)
785.000	Call auf Foreign Exchange USD/ZAR Ausübungskurs 16,70 Läuft am 12. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	11.618	78	(11.540)
(2.568.000)	Call auf Foreign Exchange USD/ZAR Ausübungskurs 16,74 Läuft am 6. Jul. 2021 ab	Citi Bank	USD	(51.180)	(21.847)	29.333
188	Call auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 6.850,00 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	J.P. Morgan	GBP	37.438	24.699	(12.739)
261	Call auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 7.100,00 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Goldman Sachs	GBP	25.407	11.212	(14.195)
395	Call auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 7.200,00 Läuft am 17. Sep. 2021 ab	J.P. Morgan	GBP	53.177	34.174	(19.003)
396	Call auf FTSE 100 Index Ausübungskurs 7.300,00 Läuft am 17. Sep. 2021 ab	Goldman Sachs	GBP	43.812	25.430	(18.382)
3.072	Call auf Panasonic Corp. Ausübungskurs 1.721,39 Läuft am 9. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	JPY	480	-	(480)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
2.523	Call auf Panasonic Corp. Ausübungskurs 1.796,24 Läuft am 14. Mai 2021 ab	Morgan Stanley	JPY	448	17	(431)
513	Call auf Pfizer, Inc. Ausübungskurs 42,00 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	51.515	6.925	(44.590)
30.764	Call auf Philadelphia Gold and Silver Index Ausübungskurs 160,00 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	184.109	50.951	(133.158)
(19.305)	Call auf Philadelphia Gold and Silver Index Ausübungskurs 200,00 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(33.784)	(3.844)	29.940
6.414	Call auf Pigeon Corp. Ausübungskurs 5.660,18 Läuft am 9. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	JPY	3.901	-	(3.901)
1.154	Call auf Pigeon Corp. Ausübungskurs 5.731,38 Läuft am 9. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	JPY	711	-	(711)
596	Call auf Rohm Co., Ltd. Ausübungskurs 13.582,27 Läuft am 9. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	JPY	1.002	-	(1.002)
4.184.064	Call auf Russell 2000 Index versus NASDAQ-100 Index Ausübungskurs 5,00 % Läuft am 16. Dez. 2022 ab	Morgan Stanley	USD	103.765	160.359	56.594
23	Call auf S&P 500 Index Ausübungskurs 4.050,00 Läuft am 31. Mrz. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	34.116	115	(34.001)
(141)	Call auf S&P Biotechnology Select Industry Index Ausübungskurs 12.424,00 Läuft am 17. Sep. 2021 ab	Barclays Bank	USD	(80.511)	(26.965)	53.546
17.668	Call auf Skylark Holdings Co., Ltd. Ausübungskurs 2.059,21 Läuft am 9. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	JPY	4.054	-	(4.054)
3.067	Call auf Skylark Holdings Co., Ltd. Ausübungskurs 2.077,33 Läuft am 9. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	JPY	710	-	(710)
3.770.872	Call auf TOPIX Banks Index Ausübungskurs 159,94 Läuft am 11. Jun. 2021 ab	J.P. Morgan	JPY	187.901	101.198	(86.703)
108.708	Call auf UniCredit SpA Ausübungskurs 10,00 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Morgan Stanley	EUR	25.952	24.136	(1.816)
73.551	Call auf UniCredit SpA Ausübungskurs 10,50 Läuft am 18. Jun. 2021 ab	Morgan Stanley	EUR	22.698	9.698	(13.000)
(23.933)	Put auf Bloomberg Commodity Index Ausübungskurs 65,00 Läuft am 21. Jun. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	(5.500)	-	5.500
23.933	Put auf Bloomberg Commodity Index Ausübungskurs 73,00 Läuft am 21. Jun. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	48.582	7	(48.575)
(1.385.000)	Put auf Foreign Exchange AUD/USD Ausübungskurs 0,78 Läuft am 1. Apr. 2021 ab	Barclays Bank	AUD	(13.617)	(24.957)	(11.340)
980.000	Put auf Foreign Exchange EUR/AUD Ausübungskurs 1,54 Läuft am 22. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	10.612	7.108	(3.504)
1.014.000	Put auf Foreign Exchange EUR/AUD Ausübungskurs 1,54 Läuft am 28. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	EUR	10.670	8.857	(1.813)
844.000	Put auf Foreign Exchange EUR/AUD Ausübungskurs 1,55 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	EUR	9.419	6.087	(3.332)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(851.000)	Put auf Foreign Exchange EUR/BRL Ausübungskurs 6,74 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	BNP Paribas	EUR	(23.527)	(27.811)	(4.284)
(892.000)	Put auf Foreign Exchange EUR/BRL Ausübungskurs 6,78 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Bank of America	EUR	(24.758)	(29.154)	(4.396)
892.000	Put auf Foreign Exchange EUR/CAD Ausübungskurs 1,52 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Bank of America	EUR	7.735	33.015	25.280
856.000	Put auf Foreign Exchange EUR/CNH Ausübungskurs 7,75 Läuft am 22. Apr. 2021 ab	Bank of America	EUR	6.222	8.325	2.103
911.000	Put auf Foreign Exchange EUR/CNH Ausübungskurs 7,79 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Bank of America	EUR	7.465	12.015	4.550
1.051.000	Put auf Foreign Exchange EUR/JPY Ausübungskurs 128,92 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	10.223	1.498	(8.725)
1.136.000	Put auf Foreign Exchange EUR/JPY Ausübungskurs 130,12 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	10.397	8.109	(2.288)
(856.000)	Put auf Foreign Exchange EUR/MXN Ausübungskurs 24,59 Läuft am 22. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	EUR	(17.995)	(30.222)	(12.227)
852.000	Put auf Foreign Exchange EUR/NZD Ausübungskurs 1,66 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	9.450	1.593	(7.857)
980.000	Put auf Foreign Exchange EUR/NZD Ausübungskurs 1,66 Läuft am 22. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	10.679	3.543	(7.136)
(891.000)	Put auf Foreign Exchange EUR/RUB Ausübungskurs 88,98 Läuft am 7. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	(17.832)	(9.156)	8.676
891.000	Put auf Foreign Exchange EUR/SEK Ausübungskurs 10,18 Läuft am 7. Apr. 2021 ab	Bank of America	EUR	6.940	591	(6.349)
883.000	Put auf Foreign Exchange EUR/TRY Ausübungskurs 8,88 Läuft am 31. Mrz. 2021 ab	Citi Bank	EUR	22.773	-	(22.773)
1.145.000	Put auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,18 Läuft am 2. Jul. 2021 ab	Citi Bank	EUR	16.559	16.499	(60)
3.031.000	Put auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,19 Läuft am 7. Apr. 2021 ab	Barclays Bank	EUR	28.732	63.378	34.646
4.266.000	Put auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,19 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Citi Bank	EUR	40.250	68.487	28.237
1.232.000	Put auf Foreign Exchange EUR/USD Ausübungskurs 1,22 Läuft am 14. Mai 2021 ab	Bank of America	EUR	17.260	54.188	36.928
(911.000)	Put auf Foreign Exchange EUR/ZAR Ausübungskurs 18,37 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Bank of America	EUR	(20.380)	(64.088)	(43.708)
766.000	Put auf Foreign Exchange GBP/AUD Ausübungskurs 1,79 Läuft am 31. Mrz. 2021 ab	Bank of America	GBP	9.929	-	(9.929)
777.000	Put auf Foreign Exchange GBP/AUD Ausübungskurs 1,81 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Citi Bank	GBP	10.483	2.412	(8.071)
721.000	Put auf Foreign Exchange GBP/JPY Ausübungskurs 150,50 Läuft am 22. Apr. 2021 ab	Citi Bank	GBP	9.641	3.226	(6.415)
732.000	Put auf Foreign Exchange GBP/JPY Ausübungskurs 151,85 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	Citi Bank	GBP	10.028	4.299	(5.729)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
735.000	Put auf Foreign Exchange GBP/USD Ausübungskurs 1,39 Läuft am 10. Mai 2021 ab	Citi Bank	GBP	14.030	12.510	(1.520)
(3.130.000)	Put auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 5,52 Läuft am 9. Jun. 2021 ab	Bank of America	USD	(42.762)	(67.109)	(24.347)
(2.211.000)	Put auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 5,24 Läuft am 15. Sep. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	(39.798)	(35.585)	4.213
1.080.000	Put auf Foreign Exchange USD/BRL Ausübungskurs 5,82 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	25.866	38.362	12.496
(1.066.000)	Put auf Foreign Exchange USD/CAD Ausübungskurs 1,26 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	(8.982)	(6.650)	2.332
1.236.000	Put auf Foreign Exchange USD/CHF Ausübungskurs 0,88 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	15.747	-	(15.747)
1.206.000	Put auf Foreign Exchange USD/CHF Ausübungskurs 0,90 Läuft am 26. Mai 2021 ab	Bank of America	USD	16.814	891	(15.923)
(4.026.000)	Put auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 689,00 Läuft am 19. Jul. 2021 ab	Goldman Sachs	USD	(49.568)	(43.469)	6.099
(1.011.000)	Put auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 720,40 Läuft am 4. Mai 2021 ab	Bank of America	USD	(15.571)	(16.142)	(571)
(628.000)	Put auf Foreign Exchange USD/CLP Ausübungskurs 737,70 Läuft am 13. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	(17.144)	(16.864)	280
6.406.000	Put auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,34 Läuft am 17. Mai 2021 ab	Bank of America	USD	25.240	1.295	(23.945)
(2.135.000)	Put auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,46 Läuft am 17. Mai 2021 ab	Bank of America	USD	(23.026)	(2.211)	20.815
1.066.000	Put auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,48 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	5.970	23	(5.947)
1.016.000	Put auf Foreign Exchange USD/CNH Ausübungskurs 6,52 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	Deutsche Bank	USD	5.596	898	(4.698)
1.073.000	Put auf Foreign Exchange USD/HUF Ausübungskurs 310,18 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Citi Bank	USD	13.158	8.387	(4.771)
751.000	Put auf Foreign Exchange USD/IDR Ausübungskurs 14.177,00 Läuft am 6. Mai 2021 ab	Barclays Bank	USD	12.790	633	(12.157)
802.000	Put auf Foreign Exchange USD/IDR Ausübungskurs 14.610,00 Läuft am 21. Jun. 2021 ab	Barclays Bank	USD	13.722	9.260	(4.462)
761.000	Put auf Foreign Exchange USD/ILS Ausübungskurs 3,18 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	9.923	1	(9.922)
1.072.000	Put auf Foreign Exchange USD/ILS Ausübungskurs 3,30 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Barclays Bank	USD	9.316	162	(9.154)
(1.073.000)	Put auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 73,85 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	(8.046)	(9.743)	(1.697)
(1.072.000)	Put auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 73,93 Läuft am 6. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(8.930)	(10.879)	(1.949)
741.000	Put auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 74,12 Läuft am 19. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	8.147	9.293	1.146

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
859.000	Put auf Foreign Exchange USD/INR Ausübungskurs 74,17 Läuft am 7. Jun. 2021 ab	Citi Bank	USD	11.040	11.323	283
1.236.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 103,59 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Deutsche Bank	USD	15.317	2	(15.315)
1.206.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 105,68 Läuft am 26. Mai 2021 ab	Morgan Stanley	USD	15.494	1.003	(14.491)
1.429.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 106,68 Läuft am 1. Apr. 2021 ab	Citi Bank	USD	11.046	-	(11.046)
(1.080.000)	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 108,60 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	(8.154)	(216)	7.938
(1.016.000)	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 108,65 Läuft am 23. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	(6.878)	(1.279)	5.599
1.537.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 109,61 Läuft am 27. Apr. 2021 ab	Citi Bank	USD	10.502	4.979	(5.523)
800.000	Put auf Foreign Exchange USD/JPY Ausübungskurs 95,99 Läuft am 17. Jun. 2024 ab	BNP Paribas	USD	55.269	15.364	(39.905)
992.000	Put auf Foreign Exchange USD/PHP Ausübungskurs 48,21 Läuft am 20. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	8.154	1.048	(7.106)
628.000	Put auf Foreign Exchange USD/PHP Ausübungskurs 48,23 Läuft am 13. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	5.458	420	(5.038)
1.002.000	Put auf Foreign Exchange USD/PHP Ausübungskurs 49,06 Läuft am 8. Jun. 2021 ab	Deutsche Bank	USD	10.328	11.174	846
(1.347.000)	Put auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 3,59 Läuft am 15. Jul. 2021 ab	Citi Bank	USD	(12.446)	(1.384)	11.062
1.072.000	Put auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 3,76 Läuft am 1. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	11.529	-	(11.529)
1.073.000	Put auf Foreign Exchange USD/PLN Ausübungskurs 3,87 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	Citi Bank	USD	12.600	416	(12.184)
1.022.000	Put auf Foreign Exchange USD/RUB Ausübungskurs 76,37 Läuft am 23. Apr. 2021 ab	Barclays Bank	USD	18.713	19.773	1.060
805.000	Put auf Foreign Exchange USD/SEK Ausübungskurs 8,39 Läuft am 6. Mai 2021 ab	Citi Bank	USD	13.870	620	(13.250)
1.016.000	Put auf Foreign Exchange USD/SEK Ausübungskurs 8,52 Läuft am 15. Apr. 2021 ab	Barclays Bank	USD	10.719	495	(10.224)
1.031.000	Put auf Foreign Exchange USD/SEK Ausübungskurs 8,71 Läuft am 4. Mai 2021 ab	Deutsche Bank	USD	10.605	9.361	(1.244)
866.000	Put auf Foreign Exchange USD/SGD Ausübungskurs 1,32 Läuft am 26. Mai 2021 ab	J.P. Morgan	USD	7.816	1.189	(6.627)
761.000	Put auf Foreign Exchange USD/SGD Ausübungskurs 1,32 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	7.610	26	(7.584)
761.000	Put auf Foreign Exchange USD/THB Ausübungskurs 30,03 Läuft am 8. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	9.242	2	(9.240)
743.000	Put auf Foreign Exchange USD/THB Ausübungskurs 30,09 Läuft am 25. Mai 2021 ab	Bank of America	USD	7.547	378	(7.169)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
630.000	Put auf Foreign Exchange USD/TRY Ausübungskurs 7,64 Lläuft am 6. Apr. 2021 ab	Citi Bank	USD	22.702	71	(22.631)
(630.000)	Put auf Foreign Exchange USD/TWD Ausübungskurs 27,43 Lläuft am 6. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(6.712)	-	6.712
(1.073.000)	Put auf Foreign Exchange USD/TWD Ausübungskurs 28,16 Lläuft am 8. Apr. 2021 ab	Bank of America	USD	(6.549)	(262)	6.287
(1.016.000)	Put auf Foreign Exchange USD/TWD Ausübungskurs 28,20 Lläuft am 15. Apr. 2021 ab	J.P. Morgan	USD	(6.553)	(1.080)	5.473
(1.016.000)	Put auf Foreign Exchange USD/ZAR Ausübungskurs 14,96 Lläuft am 15. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(20.229)	(19.964)	265
(39)	Put auf Russell 2000 Index Ausübungskurs 1.910,00 Lläuft am 16. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(32.302)	(10.725)	21.577
39	Put auf Russell 2000 Index Ausübungskurs 2.065,00 Lläuft am 16. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	119.549	53.235	(66.314)
(6)	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.275,00 Lläuft am 16. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(24.610)	(690)	23.920
(29)	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.300,00 Lläuft am 18. Jun. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	(155.120)	(57.565)	97.555
6	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.675,00 Lläuft am 16. Apr. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	61.250	3.390	(57.860)
18	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.700,00 Lläuft am 18. Jun. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	215.936	101.790	(114.146)
11	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3.775,00 Lläuft am 18. Jun. 2021 ab	Morgan Stanley	USD	152.014	76.560	(75.454)
141	Put auf S&P Biotechnology Select Industry Index Ausübungskurs 10.094,00 Lläuft am 17. Sep. 2021 ab	Barclays Bank	USD	104.340	84.772	(19.568)
14	Put auf Tesla, Inc. Ausübungskurs 625,00 Lläuft am 21. Mai 2021 ab	Morgan Stanley	USD	77.338	63.000	(14.338)
				USD	2.877.006	(648.820)

Swaptions

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

Zum 31. März 2021 wiesen die folgenden Teilfonds offene Swaptions auf Finanzindizes und international notierte Aktien auf:

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 1,20 % Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR Apr 2021“, Put, 1,20 %, 23. Apr. 2021	BNP Paribas	USD	13.153	1.725.000	95.533	82.380
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 2,00 % Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR Mar 2023“, Put, 2,00 %, 03. Mrz. 2023	Bank of America	USD	226.931	6.125.000	314.487	87.556

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Swaptions (Forts.)

Schutz- position	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Prämie	Nennbetrag	Markt- wert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)								
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 2,10 % Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR Mar 2023“, Put, 2,10 %, 24. Mrz. 2023	Goldman Sachs	USD	125.469	3.065.000	145.064	19.595	
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 7,69 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2026“, Put, 7,69 %, 13. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	384.124	157.510.000	210.392	(173.732)	
Kauf	IRS „Zahlt Festzinssatz 8,50 % Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028“, Put, 8,50 %, 06. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95.925	17.150.000	41.971	(53.954)	
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 2,00 % Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR Mar 2023“, Call, 2,00 %, 03 Mrz. 2023	Bank of America	USD	226.931	6.125.000	172.910	(54.021)	
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 2,10 % Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR Mar 2023“, Call, 2,10 %, 24 Mrz. 2023	Goldman Sachs	USD	117.279	3.065.000	98.568	(18.711)	
Verkauf	IRS „Erhält Festzinssatz 4,86 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2022“, Call, 4,86 %, 23 Mrz. 2022	J.P. Morgan	MXN	(27.657)	(547.915.000)	(3.059)	24.598	
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 5,36 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2022“, Call, 5,36 %, 23 Mrz. 2022	J.P. Morgan	MXN	86.920	547.915.000	26.508	(60.412)	
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 5,93 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Sep 2021“, Call, 5,93 %, 29. Sep. 2021	J.P. Morgan	MXN	78.917	63.190.000	1.305	(77.612)	
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 5,97 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2023“, Call, 5,97 %, 30 Mrz. 2023	J.P. Morgan	MXN	69.383	46.495.000	4.528	(64.855)	
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 6,25 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Feb 2022“, Call, 6,25 %, 21. Feb. 2022	J.P. Morgan	MXN	67.565	67.710.000	5.847	(61.718)	
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 6,80 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Feb 2025“, Call, 6,80 %, 07. Feb. 2025	J.P. Morgan	MXN	541.676	228.495.000	94.568	(447.108)	
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 7,08 % Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR Nov 2021“, Call, 7,08 %, 08 Nov. 2021	J.P. Morgan	ZAR	156.324	84.425.000	53.568	(102.756)	
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 7,29 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mar 2026“, Call, 7,29 %, 05 Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	396.524	157.510.000	99.585	(296.939)	
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 7,33 % Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR Nov 2021“, Call, 7,33 %, 08 Nov. 2021	J.P. Morgan	ZAR	199.448	84.425.000	80.073	(119.375)	
Kauf	IRS „Erhält Festzinssatz 8,50 % Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Apr 2028“, Call, 8,50 %, 06. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95.924	17.150.000	34.452	(61.472)	
						USD	1.476.300	(1.378.536)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte

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

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

Zum 31. März 2021 waren folgende Teilfonds in Total-Return-Swap-Vereinbarungen engagiert:

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Markt- wert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	13.346.693	7.124.292	03. Dez. 2021	8.595.305
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	EUR	14.066.108	349.944	21. Jan. 2022	4.027.090
Kauf Long	Fluggesellschaften	Morgan Stanley	EUR	14.634.357	6.581.391	03. Dez. 2021	6.880.199
Kauf Long	Bekleidung	J.P. Morgan	EUR	8.038.183	3.201.196	06. Mai 2022	3.524.925
Kauf Long	Bekleidung	Morgan Stanley	EUR	15.013.068	2.255.089	03. Dez. 2021	2.356.518
Kauf Long	Automobilhersteller	J.P. Morgan	EUR	18.153.526	9.617.711	27. Dez. 2021	9.634.349
Kauf Long	Automobilhersteller	J.P. Morgan	EUR	11.448.470	4.592.302	16. Mrz. 2022	4.605.731
Kauf Long	Getränke	Morgan Stanley	USD	7.894.504	1.067.493	03. Aug. 2021	2.426.310
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	EUR	14.024.948	3.801.765	03. Dez. 2021	4.151.905
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	GBP	29.867.327	3.372.102	08. Dez. 2021	3.605.712
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	GBP	18.609.209	1.241.100	08. Dez. 2021	1.296.862
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	15.668.392	(1.165.838)	23. Sept. 2021	(1.016.805)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	9.759.290	(888.254)	25. Feb. 2022	(2.891.383)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	6.271.359	(159.706)	28. Feb. 2024	(155.199)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Merrill Lynch	USD	1.870.303	332.753	29. Apr. 2022	332.579
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	CAD	474.409	(119.826)	31. Dez. 2021	(144.687)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	1.529.888	(1.857.019)	26. Apr. 2023	(1.791.174)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	4.516.064	(784.317)	18. Okt. 2021	(709.627)
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	CHF	1.903.901	(105.016)	06. Mrz. 2024	(105.016)
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	DKK	3.957.336	(89.860)	13. Feb. 2024	(89.936)
Verkauf Short	Chemie	J.P. Morgan	USD	5.699.703	(679.681)	09. Mrz. 2022	(681.333)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	2.407.777	289.567	29. Apr. 2022	290.964
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	12.012.342	(822.924)	14. Jun. 2023	(854.411)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	8.292.447	2.062.163	22. Feb. 2024	2.114.487
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	2.984.721	425.616	28. Feb. 2024	439.248
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	EUR	3.431.357	122.398	03. Dez. 2021	199.549
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	JPY	8.970.364	(1.194.023)	24. Okt. 2022	(1.113.389)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.856.926	(391.791)	27. Sept. 2023	(392.893)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	ZAR	1.900.126	(63.400)	27. Jan. 2022	(62.412)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	DKK	3.506.921	(60.804)	04. Apr. 2024	(60.804)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	3.372.577	217.988	05. Mrz. 2024	219.588
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	GBP	3.173.355	(536.379)	08. Dez. 2021	(544.406)
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	919.979	(58.595)	28. Feb. 2024	(58.595)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	USD	1.489.402	(77.079)	11. Apr. 2022	(77.298)
Verkauf Short	Energie - Alternative Energiequellen	Merrill Lynch	USD	4.737.964	(740.459)	29. Apr. 2022	(732.906)
Verkauf Short	Energie - Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	USD	2.468.236	104.342	13. Jul. 2021	104.713
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	SEK	1.918.764	(73.356)	12. Feb. 2024	(73.152)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	CAD	3.142.891	(917.928)	05. Mai 2022	(761.876)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	USD	1.581.249	(2.143.019)	23. Mrz. 2022	(561.770)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Markt- wert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	4.539.190	(200.608)	16. Jan. 2024	(206.883)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	2.004.485	55.570	21. Mrz. 2024	57.003
Verkauf Short	Lebensmitteldienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	3.223.180	(286.110)	03. Dez. 2021	(286.245)
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	HKD	5.612.531	(1.786.019)	23. Dez. 2022	(1.799.452)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	SEK	1.842.116	(539.193)	26. Apr. 2023	(550.242)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	2.474.168	(18.925)	25. Apr. 2022	(18.925)
Verkauf Short	Holdingsgesellschaften - Diverse	Merrill Lynch	USD	1.481.353	(109.952)	29. Apr. 2022	(109.952)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	2.794.403	(602.426)	24. Okt. 2022	(691.356)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	USD	86.789.526	(3.557.648)	31. Jan. 2024	(3.612.788)
Verkauf Short	Versicherungen	Merrill Lynch	USD	1.019.425	(12.018)	29. Apr. 2022	(29.386)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	1.884.829	661.271	07. Feb. 2024	663.671
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	2.849.832	1.010.185	07. Mrz. 2024	1.026.239
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	4.355.858	122.001	29. Apr. 2022	122.001
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	EUR	1.445.553	(42.259)	28. Mrz. 2024	(42.224)
Verkauf Short	Freizeit	Merrill Lynch	USD	996.159	(123.963)	29. Apr. 2022	(123.963)
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	GBP	1.434.005	(661.606)	08. Dez. 2021	(848.759)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	4.935.949	(287.682)	18. Apr. 2022	(287.355)
Verkauf Short	Büro- und Geschäftsausstattung	Morgan Stanley	JPY	6.349.358	(2.876.803)	24. Okt. 2022	(2.842.282)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	GBP	308.487	121.856	08. Dez. 2021	120.792
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	4.277.478	701.489	20. Sept. 2021	487.945
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	2.164.783	(946.040)	08. Dez. 2021	(985.770)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	4.604.625	160.505	31. Dez. 2021	157.013
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1.877.132	(1.181.252)	23. Sept. 2021	(1.178.811)
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	HKD	1.888.300	89.890	23. Dez. 2022	90.237
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	EUR	1.365.788	(898.504)	03. Dez. 2021	(627.895)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	752.368	(30.086)	20. Dez. 2023	(122.882)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	817.903	(16.668)	31. Jan. 2024	(16.668)
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	2.379.775	(256.746)	31. Mrz. 2022	(254.370)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	EUR	4.778.047	(63.151)	27. Dez. 2023	(66.310)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	2.867.133	(153.035)	28. Feb. 2024	(151.044)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	2.391.766	(134.916)	22. Feb. 2024	(131.589)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	754.251	(366.966)	29. Jun. 2021	(428.952)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	4.706.056	(41.120)	11. Apr. 2022	(39.449)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	4.685.877	10.766	29. Apr. 2022	3.666
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	PLN	4.279.295	773.473	13. Jul. 2022	786.726
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	9.948.203	(499.626)	26. Apr. 2023	(382.179)
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	6.724.916	128.697	02. Okt. 2023	134.744
Verkauf Short	Diverse*	Morgan Stanley	USD	11.405.558	50.733	17. Mai 2021	(15.787)
EUR							29.725.481
Schroder GAIA Helix							
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	EUR	3.010.961	(127.539)	04. Jun. 2021	(127.539)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	EUR	94.123.744	(4.275.917)	30. Sept. 2021	(4.275.917)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	JPY	3.335.936	(112.906)	04. Jun. 2021	(112.906)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	JPY	5.914.351	(200.173)	30. Sept. 2021	(200.173)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	USD	9.504.945	(120.440)	04. Jun. 2021	(120.440)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	USD	298.337.557	10.094.268	30. Sept. 2021	10.094.268
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	JPY	149.469.423	2.747.326	30. Sept. 2021	2.747.326
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	USD	1.879.968	12.540	04. Jun. 2021	12.540
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	USD	149.869.251	2.964.773	30. Sept. 2021	2.964.773
USD							10.981.932

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Markt- wert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	7.815.817	517.675	14. Feb. 2022	517.675
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	5.341.436	480.752	12. Mai 2022	480.752
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	33.644.706	(1.816.331)	12. Mai 2022	(1.828.884)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	11.487.406	492.695	12. Aug. 2022	492.695
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	8.627.593	264.727	15. Nov. 2022	264.727
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Credit Suisse	USD	1.682.362	(12.455)	12. Mai 2021	(14.438)
Verkauf Short	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	USD	970.005	(103.290)	26. Mai 2021	(103.290)
Verkauf Short	Bekleidung	Credit Suisse	USD	1.777.471	14.818	12. Mai 2021	12.139
Verkauf Short	Automobilhersteller	Merrill Lynch	USD	1.582.323	441.869	18. Apr. 2022	443.596
Verkauf Short	Banken	Credit Suisse	USD	4.276.940	(301.181)	12. Mai 2021	(301.181)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	2.283.389	(128.447)	12. Aug. 2022	(128.447)
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	2.459.791	258.495	24. Jan. 2022	258.495
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	1.805.636	62.977	23. Mrz. 2022	53.401
Verkauf Short	Biotechnologie	Merrill Lynch	USD	1.471.016	(120.373)	24. Mai 2021	(120.373)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	3.272.520	10.899	26. Mai 2021	10.899
Verkauf Short	Computer	Credit Suisse	USD	2.642.660	(184.404)	12. Mai 2021	(180.722)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	1.791.183	(86.345)	04. Feb. 2022	(86.345)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Credit Suisse	USD	962.720	(78.658)	12. Mai 2021	(78.658)
Verkauf Short	Elektronik	Credit Suisse	USD	1.954.290	(80.738)	12. Mai 2021	(95.557)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	1.242.406	(82.392)	12. Aug. 2021	(83.285)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	1.994.259	(68.099)	15. Nov. 2021	(68.099)
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	1.880.453	(139.167)	30. Apr. 2021	(139.167)
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	4.097.353	(980.465)	24. Mrz. 2022	(980.465)
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	978.371	(34.515)	29. Apr. 2022	(34.515)
Verkauf Short	Forstprodukte und Papier	Merrill Lynch	USD	1.213.280	(91.483)	25. Mrz. 2022	(91.483)
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Credit Suisse	USD	1.089.154	(236.678)	12. Mai 2021	(236.678)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Merrill Lynch	USD	1.238.175	91.218	28. Jun. 2021	91.218
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	97.728.524	(1.731.102)	26. Mai 2021	(1.731.102)
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	11.998.714	(225.935)	29. Nov. 2021	(225.935)
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	17.427.257	1.243.323	28. Feb. 2022	1.243.323
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	7.883.749	(266.489)	06. Apr. 2022	(266.489)
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	15.553.486	(802.320)	07. Apr. 2022	(847.512)
Verkauf Short	Versicherungen	Merrill Lynch	USD	984.394	1.738	26. Apr. 2022	1.738
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	1.591.948	(59.293)	19. Apr. 2022	(59.293)
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	1.517.855	(30.497)	26. Mai 2021	(6.494)
Verkauf Short	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	934.542	3.769	15. Nov. 2021	3.769
Verkauf Short	Medien	Credit Suisse	USD	795.510	211.600	12. Mai 2021	211.600
Verkauf Short	Öl u. Gas	Merrill Lynch	USD	1.268.750	(18.176)	18. Jan. 2022	(18.176)
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Credit Suisse	USD	2.210.849	(87.010)	12. Mai 2021	(101.054)
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Goldman Sachs	USD	1.325.651	(28.995)	12. Mai 2022	(28.995)
Verkauf Short	Verpackung u. Behälter	Merrill Lynch	USD	1.312.769	(57.359)	24. Mai 2021	(57.359)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	1.033.263	68.775	25. Okt. 2021	68.775
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	1.446.107	164.881	07. Feb. 2022	164.881
Verkauf Short	REITS	Credit Suisse	USD	4.562.614	(326.107)	12. Mai 2021	(326.107)
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	841.924	10.424	27. Dez. 2021	10.424
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	819.864	(95.784)	28. Mrz. 2022	(95.784)
Verkauf Short	Einzelhandel	Barclays Bank	USD	17.800.953	39.338	15. Apr. 2021	(118.301)
Verkauf Short	Einzelhandel	Credit Suisse	USD	1.081.368	(109.160)	12. Mai 2021	(109.160)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Markt- wert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1.674.935	96.454	12. Mai 2022	96.454
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	631.094	(74.988)	25. Mrz. 2022	(74.988)
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	987.356	(21.455)	29. Apr. 2022	(21.455)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	7.246.445	(1.162.564)	26. Mai 2021	(1.162.564)
Verkauf Short	Halbleiter	Credit Suisse	USD	675.301	(58.971)	12. Mai 2021	(58.971)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	601.234	51.501	26. Mai 2021	51.501
Verkauf Short	Software	Credit Suisse	USD	1.241.657	(64.909)	12. Mai 2021	(61.131)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	3.022.166	214.282	14. Feb. 2022	265.012
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	2.562.480	24.679	19. Apr. 2022	24.679
Verkauf Short	Telekommunikation	Credit Suisse	USD	3.053.880	(61.121)	12. Mai 2021	(35.957)
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	USD	5.086.238	(348.949)	27. Apr. 2022	(348.949)
USD							(5.559.610)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	903.550.364	18.587.592	21. Okt. 2021	18.587.592
USD							18.587.592
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	115.428	(926)	24. Mai 2023	(926)
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	EUR	225.542	(5.712)	09. Mai 2023	(5.712)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	GBP	583.155	(21.606)	24. Mai 2023	(21.606)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	J.P. Morgan	GBP	16.368	(329)	09. Mai 2023	(329)
Kauf Long	Automobilhersteller	Goldman Sachs	EUR	197.575	7.088	24. Mai 2023	7.088
Kauf Long	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	79.207	(2.865)	24. Mai 2023	(2.865)
Kauf Long	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	30.807	993	15. Mai 2023	993
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	USD	615.839	(31.614)	25. Mai 2023	(31.614)
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	191.874	(10.506)	15. Mai 2023	(10.506)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	CZK	287.562	5.929	24. Mai 2023	5.929
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	171.328	(1.354)	06. Jan. 2023	(1.354)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	1.917.160	31.044	24. Mai 2023	31.044
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	GBP	265.176	7.265	20. Dez. 2022	7.265
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	GBP	630.362	16.704	24. Mai 2023	16.704
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	JPY	887.679	(82.836)	19. Okt. 2022	(82.836)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	SEK	10.057	(460)	09. Jan. 2023	(460)
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	679.667	5.673	12. Mai 2022	5.673
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	4.442.761	31.642	24. Mai 2023	31.642
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	CZK	778.880	31.969	09. Mai 2023	31.969
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	206.494	9.898	09. Mai 2023	9.898
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	GBP	139.938	(633)	22. Jun. 2022	(633)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	GBP	359.899	3.793	20. Jan. 2023	3.793
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	GBP	517.499	31.705	09. Mai 2023	31.705
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	ILS	259.151	11.886	09. Mai 2023	11.886
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	USD	566.506	26.998	22. Jun. 2021	26.998
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	USD	1.437.555	(70.364)	09. Mai 2023	(70.364)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	EUR	208.089	3.025	15. Mai 2023	3.025
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	JPY	491.868	(18.423)	15. Mai 2023	(18.423)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	2.402.197	(50.888)	15. Mai 2023	(50.888)
Kauf Long	Getränke	Goldman Sachs	USD	815.299	63.912	24. Mai 2023	63.912
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	CHF	51.192	(1.502)	24. Mai 2023	(1.502)

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Markt- wert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	233.480	(880)	24. Mai 2023	(880)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	227.726	(5.987)	24. Mai 2023	(5.987)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	116.998	1.002	06. Jan. 2023	1.002
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	6.249.506	(328.083)	24. Mai 2023	(328.083)
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	CHF	470.490	53.395	09. Mai 2023	53.395
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	343.010	11.129	22. Jun. 2021	11.129
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1.694.693	(41.694)	09. Mai 2023	(41.694)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	285.548	540	15. Mai 2023	540
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	5.031.925	(346.926)	15. Mai 2023	(346.926)
Kauf Long	Chemie	J.P. Morgan	EUR	339.604	44.397	22. Jun. 2022	44.397
Kauf Long	Chemie	J.P. Morgan	EUR	522.079	(33.039)	09. Mai 2023	(33.039)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.872.352	(78.406)	24. Mai 2023	(78.406)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	484.145	4.601	22. Jun. 2022	4.601
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.059.348	(28.213)	09. Mai 2023	(28.213)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	137.340	(6.221)	15. Mai 2023	(6.221)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	141.179	(1.458)	27. Dez. 2021	(1.458)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1.704.636	(108.560)	15. Mai 2023	(108.560)
Kauf Long	Computer	Goldman Sachs	USD	27.495	233	24. Mai 2023	233
Kauf Long	Computer	Goldman Sachs	USD	10.003	487	25. Mai 2023	487
Kauf Long	Computer	J.P. Morgan	USD	706.718	(3.341)	09. Mai 2023	(3.341)
Kauf Long	Computer	Morgan Stanley	GBP	198.560	1.124	15. Mai 2023	1.124
Kauf Long	Computer	Morgan Stanley	USD	52.976	556	15. Mai 2023	556
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	AUD	2.724	(204)	24. Mai 2023	(204)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	278.517	946	23. Jan. 2023	946
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	2.968.163	(77.664)	24. Mai 2023	3.612
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.200.500	29.354	09. Mai 2023	29.354
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	1.101.830	(16.571)	15. Mai 2023	(16.571)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	180.066	3.621	15. Mai 2023	3.621
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	EUR	12.676	42	24. Mai 2023	42
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	USD	495.006	4.980	24. Mai 2023	4.980
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	EUR	24.082	1.395	22. Feb. 2023	1.395
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	USD	582.784	60.900	09. Mai 2023	60.900
Kauf Long	Elektrik	Morgan Stanley	USD	453.610	13.341	15. Mai 2023	13.341
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	288.683	11.124	25. Mai 2023	11.124
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	J.P. Morgan	EUR	287.588	17.870	22. Jun. 2022	17.870
Kauf Long	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley	USD	93.238	(4.770)	15. Mai 2023	(4.770)
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	567.077	16.615	24. Mai 2023	16.615
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	8.749	38	25. Mai 2023	38
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	USD	596.495	56.496	22. Jun. 2021	56.496
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	USD	8.804	(736)	09. Mai 2023	(736)
Kauf Long	Elektronik	Morgan Stanley	USD	486.748	13.454	15. Mai 2023	13.454
Kauf Long	Energie - Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	165.103	4.096	25. Mai 2023	4.096
Kauf Long	Energie - Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	NOK	167.237	10.795	09. Mai 2023	10.795
Kauf Long	Energie - Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	NOK	57.951	1.364	15. Mai 2023	1.364
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	46.714	1.952	24. Mai 2023	1.952
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	JPY	5.156	(221)	01. Jul. 2021	(221)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	602.125	52.753	24. Mai 2023	52.753

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Markt- wert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	EUR	22.412	2.973	09. Mai 2023	2.973
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	91.200	9.006	15. Mai 2023	9.006
Kauf Long	Unterhaltung	Goldman Sachs	USD	242.270	(35.097)	24. Mai 2023	(35.097)
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	USD	5.304	(268)	15. Mai 2023	(268)
Kauf Long	Gas	Morgan Stanley	EUR	274.338	(2.652)	15. Mai 2023	(2.652)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	EUR	675.321	6.714	24. Mai 2023	6.714
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	GBP	82.229	844	07. Feb. 2023	844
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	GBP	22.557	232	24. Mai 2023	232
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	HKD	3.928	78	24. Mai 2023	78
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	7.712.521	(28.898)	24. Mai 2023	7.714
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	183.311	5.063	25. Mai 2023	5.063
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	EUR	6.413	507	09. Mai 2023	507
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	GBP	86.789	1.698	22. Feb. 2023	1.698
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	2.431.811	115.846	22. Jun. 2021	65.241
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	2.311.759	(32.015)	09. Mai 2023	(32.015)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	CHF	136.292	14.699	15. Mai 2023	14.699
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	EUR	32.424	1.083	15. Mai 2023	1.083
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	GBP	672.527	(7.797)	15. Mai 2023	(7.797)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	HKD	210.246	13.126	15. Mai 2023	13.126
Kauf Long	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	USD	1.174.962	(18.887)	15. Mai 2023	(18.887)
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	6.558.561	108.195	24. Mai 2023	108.195
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	620.268	44.621	22. Jun. 2021	44.621
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	2.530.166	163.629	09. Mai 2023	163.629
Kauf Long	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	2.402.087	59.063	15. Mai 2023	59.063
Kauf Long	Holdinggesellschaften - Diverse	Goldman Sachs	USD	441.952	1.633	24. Mai 2023	1.633
Kauf Long	Holdinggesellschaften - Diverse	J.P. Morgan	USD	107.302	(2.824)	09. Mai 2023	(2.824)
Kauf Long	Holdinggesellschaften - Diverse	Morgan Stanley	USD	995.159	4.448	15. Mai 2023	4.448
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	JPY	4.745	(264)	01. Mrz. 2023	(264)
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	588.217	(12.266)	24. Mai 2023	(12.266)
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	J.P. Morgan	JPY	655	29	09. Mai 2023	29
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	J.P. Morgan	USD	224.997	15.245	09. Mai 2023	15.245
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	227.466	28.241	15. Mai 2023	28.241
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	CAD	399.183	7.114	25. Mai 2023	7.114
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	GBP	183.725	3.295	24. Mai 2023	3.295
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	GBP	313.421	2.770	09. Mrz. 2026	2.770
Kauf Long	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	4.969.944	(107.016)	24. Mai 2023	(107.016)
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	USD	326.930	17.978	09. Mai 2023	17.978
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	GBP	148.745	(1.165)	15. Mai 2023	(1.165)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	360.122	8.836	15. Mai 2023	8.836
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	USD	281.299	(51.349)	24. Mai 2023	(51.349)
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	USD	111.145	(1.831)	22. Jun. 2021	(1.831)
Kauf Long	Internet	J.P. Morgan	USD	421.806	(16.671)	09. Mai 2023	(16.671)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	HKD	113.220	(3.242)	15. Mai 2023	(3.242)
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	1.612.847	(24.304)	15. Mai 2023	(24.304)
Kauf Long	Eisen / Stahl	Goldman Sachs	JPY	601.512	(22.488)	17. Jan. 2023	(22.488)
Kauf Long	Eisen / Stahl	Goldman Sachs	JPY	12.874	(294)	09. Mrz. 2026	(294)
Kauf Long	Eisen / Stahl	Goldman Sachs	USD	566.838	(37.337)	25. Mai 2023	(37.337)
Kauf Long	Eisen / Stahl	J.P. Morgan	HKD	121.168	(929)	09. Mai 2023	(929)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Markt- wert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Eisen / Stahl	J.P. Morgan	JPY	5.156	620	23. Mrz. 2023	620
Kauf Long	Eisen / Stahl	J.P. Morgan	USD	18.587	154	09. Mai 2023	154
Kauf Long	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	JPY	712.941	3.177	15. Mai 2023	3.177
Kauf Long	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	USD	610.635	(56.612)	15. Mai 2023	(56.612)
Kauf Long	Freizeit	Goldman Sachs	USD	349.005	(3.088)	24. Mai 2023	(3.088)
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	GBP	320.844	9.345	31. Mrz. 2023	9.345
Kauf Long	Beherbergungsunternehmen	Goldman Sachs	USD	358.044	(26.119)	06. Jan. 2023	(26.119)
Kauf Long	Maschinen - Bau u. Bergbau	Goldman Sachs	EUR	119.003	4.694	24. Mai 2023	4.694
Kauf Long	Maschinen - Bau u. Bergbau	J.P. Morgan	USD	251.189	26.023	09. Mai 2023	26.023
Kauf Long	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	958.900	6.525	24. Mai 2023	6.525
Kauf Long	Maschinen - Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	724.466	525	22. Aug. 2023	525
Kauf Long	Maschinen - Diversifiziert	J.P. Morgan	USD	91.754	(519)	09. Mai 2023	(519)
Kauf Long	Maschinen - Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	444.639	(14.383)	15. Mai 2023	(14.383)
Kauf Long	Medien	J.P. Morgan	USD	517.327	36.569	22. Jun. 2021	36.569
Kauf Long	Medien	Morgan Stanley	USD	283.668	(18.539)	27. Dez. 2021	(18.539)
Kauf Long	Metallprodukte/Eisenwaren	Goldman Sachs	USD	230.252	(5.256)	24. Mai 2023	(5.256)
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	GBP	317.569	5.452	24. Mai 2023	5.452
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	USD	90.573	(2.506)	24. Mai 2023	(2.506)
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	GBP	546.519	(5.630)	22. Feb. 2023	(5.630)
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	NOK	486.633	57.033	09. Mai 2023	57.033
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	ZAR	101.933	(11.753)	09. Mai 2023	(11.753)
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	USD	328.090	(15.376)	15. Mai 2023	(15.376)
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	166.092	4.909	24. Mai 2023	4.909
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	SEK	660.809	(14.416)	22. Mrz. 2023	(14.416)
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	CAD	351.373	(686)	25. Mai 2023	(686)
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	EUR	510.694	139.035	16. Dez. 2022	139.035
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	GBP	376.836	(15.447)	24. Mai 2023	(15.447)
Kauf Long	Öl u. Gas	Goldman Sachs	USD	600.108	(18.998)	24. Mai 2023	(18.998)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	CAD	537.055	(57.939)	09. Mai 2023	(57.939)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	EUR	154.597	(7.824)	22. Feb. 2023	(7.824)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	GBP	131.109	(11.375)	09. Mai 2023	(11.375)
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	JPY	7.679	152	09. Mai 2023	152
Kauf Long	Öl u. Gas	J.P. Morgan	USD	2.187.848	(178.046)	09. Mai 2023	(178.046)
Kauf Long	Öl u. Gas	Morgan Stanley	USD	2.021.066	(237.153)	15. Mai 2023	(237.153)
Kauf Long	Öl- u. Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	129.117	(13.914)	15. Mai 2023	(13.914)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	1.520.596	14.447	24. Mai 2023	14.447
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	974.476	(12.274)	24. Mai 2023	(12.274)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	2.406.244	(26.400)	24. Mai 2023	(26.400)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	4.167.822	(42.773)	24. Mai 2023	(42.773)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	344.124	2.199	12. Aug. 2022	2.199
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	3.456.410	(48.580)	24. Mai 2023	(48.580)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	11.258	562	09. Mai 2023	562
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	130.906	(4.715)	09. Mai 2023	(4.715)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	8.815	333	09. Mai 2023	333
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	HUF	447.931	44.814	09. Mai 2023	44.814
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1.017.240	(77.653)	22. Jun. 2021	(77.653)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	5.459.505	160.603	09. Mai 2023	160.603
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	CHF	696.778	20.189	15. Mai 2023	20.189

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Markt- wert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	172.460	3.395	15. Mai 2023	3.395
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	GBP	693.036	20.298	15. Mai 2023	20.298
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	HKD	341.340	(5.904)	15. Mai 2023	(5.904)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	873.243	4.049	15. Mai 2023	4.049
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2.697.656	(31.449)	15. Mai 2023	(31.449)
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	2.032.317	(65.173)	09. Mai 2023	(65.173)
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	1.445.438	(97.483)	15. Mai 2023	(97.483)
Kauf Long	Private Equity	Goldman Sachs	GBP	1.044.937	(21.112)	24. Jan. 2023	(21.112)
Kauf Long	Private Equity	J.P. Morgan	USD	450.275	26.568	09. Mai 2023	26.568
Kauf Long	Private Equity	Morgan Stanley	GBP	120.126	(3.760)	15. Mai 2023	(3.760)
Kauf Long	Immobilien	Morgan Stanley	USD	2.807	(100)	15. Mai 2023	(100)
Kauf Long	REITS	Goldman Sachs	USD	596.418	(3.344)	24. Mai 2023	(3.344)
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	USD	429.367	809	09. Mai 2023	809
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	JPY	383.640	4.281	17. Jan. 2023	4.281
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	1.157.280	(21.570)	24. Mai 2023	(21.570)
Kauf Long	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	49.549	2.710	09. Mai 2023	2.710
Kauf Long	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	168.199	(12.815)	15. Mai 2023	(12.815)
Kauf Long	Spar- und Darlehensgeschäft	Goldman Sachs	USD	309.084	(23.094)	24. Mai 2023	(23.094)
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	EUR	851.402	12.078	14. Feb. 2023	12.078
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	HKD	360.693	(3.780)	07. Sept. 2022	(3.780)
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	293.275	3.341	24. Mai 2023	3.341
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	1.287.739	34.702	09. Mai 2023	34.702
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	170.651	9.750	15. Mai 2023	9.750
Kauf Long	Software	Goldman Sachs	USD	839.174	(3.388)	24. Mai 2023	(3.388)
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	1.000.293	24.269	09. Mai 2023	24.269
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	2.859.460	(126.056)	15. Mai 2023	(126.056)
Kauf Long	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	279.655	14.530	09. Mai 2023	14.530
Kauf Long	Spielwaren / Spiele / Hobbys	Goldman Sachs	JPY	3.219	(21)	14. Feb. 2023	(21)
Kauf Long	Transport	Goldman Sachs	GBP	85.497	672	24. Mai 2023	672
Kauf Long	Transport	Goldman Sachs	USD	407.742	14.910	24. Mai 2023	14.910
Kauf Long	Transport	Goldman Sachs	USD	96.924	474	25. Mai 2023	474
Kauf Long	Transport	J.P. Morgan	DKK	27.312	3.409	09. Mai 2023	3.409
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	DKK	538.333	39.385	15. Mai 2023	39.385
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	EUR	397.583	22.975	15. Mai 2023	22.975
Kauf Long	Diverse*	Morgan Stanley	USD	28.169.884	130.507	27. Mrz. 2023	130.507
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	HKD	37.804	347	13. Jan. 2023	347
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	431.419	42.291	24. Mai 2023	42.291
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	689.546	(49.853)	28. Feb. 2024	(49.853)
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	HKD	144.430	2.952	09. Mai 2023	2.952
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	USD	322.619	41.337	09. Mai 2023	41.337
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	343.966	43.755	15. Mai 2023	43.755
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	J.P. Morgan	USD	100.159	5.683	09. Mai 2023	5.683
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	AUD	923.980	(6.681)	24. Mai 2023	(6.681)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CHF	675.418	102.728	24. Mai 2023	102.728
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	DKK	1.048.460	(10.400)	24. Mai 2023	(10.400)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	3.490.372	(83.921)	24. Mai 2023	(83.921)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	727.650	(763)	31. Jan. 2024	(763)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	HKD	432.631	18.391	30. Jan. 2023	18.391

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Markt- wert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	HKD	325.818	(216)	24. Mai 2023	(216)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	JPY	729.150	41.217	01. Mrz. 2023	41.217
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	NOK	291.398	1.988	06. Jan. 2023	1.988
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	PLN	290.611	(2.120)	19. Jan. 2023	(2.120)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	PLN	256.723	3.465	24. Mai 2023	3.465
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SEK	1.514.405	29.396	24. Mai 2023	29.396
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	801.322	6.243	06. Jan. 2023	6.243
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	8.958.984	40.445	24. Mai 2023	40.445
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	AUD	131.792	(3.999)	09. Mai 2023	(3.999)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	835.068	(40.545)	09. Mai 2023	(40.545)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	HKD	33.615	331	09. Mai 2023	331
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	JPY	221.481	9.688	09. Mai 2023	9.688
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	NOK	4.784	(32)	22. Jun. 2022	(32)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	2.832.953	(4.009)	22. Jun. 2021	(4.009)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	1.797.833	(1.462)	09. Mai 2023	(1.462)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	AUD	8.581	(95)	15. Mai 2023	(95)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	EUR	288.547	(10.853)	15. Mai 2023	(10.853)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	HKD	83.808	1.041	15. Mai 2023	1.041
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	287.654	10.889	15. Mai 2023	10.889
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	MXN	529.542	20.774	17. Sept. 2030	20.774
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	NOK	105.787	1.840	15. Mai 2023	1.840
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	1.783.551	2.315	15. Mai 2023	2.315
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	GBP	274.187	2.914	18. Jan. 2023	2.914
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	GBP	149.331	12.622	07. Mai 2023	12.622
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	HKD	3.396	(127)	22. Jun. 2022	(127)
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	HKD	3.987	(314)	15. Mai 2023	(314)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	CHF	236.220	11.045	24. Mai 2023	11.045
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	352.845	(10.474)	24. Mai 2023	(10.474)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	4.061.268	61.282	24. Mai 2023	61.282
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	CHF	23.306	(333)	22. Feb. 2023	(333)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	HKD	207.677	(18.574)	09. Mai 2023	(18.574)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	1.060.307	(6.068)	22. Jun. 2021	(6.068)
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	5.735.283	(17.801)	09. Mai 2023	(17.801)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	CHF	413.111	15.071	15. Mai 2023	15.071
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	HKD	234.531	(5.085)	15. Mai 2023	(5.085)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	1.417.286	22.236	15. Mai 2023	22.236
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	EUR	57.840	(523)	27. Mrz. 2023	(523)
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	EUR	64.581	(1.322)	24. Mai 2023	(1.322)
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	USD	-	(970)	19. Apr. 2021	(970)
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	USD	90.962	1.699	24. Mai 2023	1.699
Verkauf Short	Chemie	Morgan Stanley	EUR	305.318	(3.766)	15. Mai 2023	(3.766)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	107.756	(2.556)	24. Mai 2023	(2.556)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	99.053	(2.023)	14. Dez. 2022	(2.023)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	633.612	29.200	24. Mai 2023	31.737
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	180.687	(8.816)	22. Feb. 2023	(8.816)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	190.004	(10.162)	22. Jun. 2022	(10.162)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	216.091	(502)	15. Mai 2023	(502)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	328.072	(6.810)	14. Jun. 2023	(6.810)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Markt- wert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Computer	J.P. Morgan	USD	94.529	(5.374)	09. Mai 2023	(5.374)
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	1.191.643	31.141	15. Mai 2023	31.141
Verkauf Short	Rentenfonds	Goldman Sachs	USD	379.939	(1.110)	05. Mai 2022	(1.110)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	366.412	6.149	24. Mai 2023	6.149
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	1.782.035	(922)	18. Jan. 2023	(922)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	349.258	5.103	24. Jan. 2023	5.103
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	657.312	24.250	24. Mai 2023	24.250
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.439.327	12.514	24. Mai 2023	12.514
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	357.891	3.425	27. Sept. 2023	3.425
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	239.177	(24.672)	09. Mai 2023	(24.672)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	270.064	29.870	09. Mai 2023	29.870
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	918.987	20.488	09. Mai 2023	20.488
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	159.503	(6.397)	15. Mai 2023	(6.397)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	GBP	663.195	31.666	15. Mai 2023	31.666
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	72.682	58	15. Mai 2023	58
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	DKK	93.494	(3.624)	04. Apr. 2024	(3.624)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	HKD	3.281	71	24. Mai 2023	71
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	HKD	40.116	(2.304)	09. Mai 2023	(2.304)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	1.128.229	(94.803)	09. Mai 2023	(94.803)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	HKD	104.524	(674)	15. Mai 2023	(674)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	3.942	94	15. Mai 2023	94
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	244.448	(33.018)	28. Feb. 2024	(33.018)
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	J.P. Morgan	USD	157.312	(44.571)	09. Mai 2023	(44.571)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	HKD	219.905	18.266	24. Mai 2023	18.266
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	JPY	746.617	(17.796)	24. Mai 2023	(17.796)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	JPY	329.424	(11.297)	22. Aug. 2022	(11.297)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	USD	1.359.377	(90.458)	22. Jun. 2021	(90.458)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	283.434	(13.515)	15. Mai 2023	(13.515)
Verkauf Short	Energie - Alternative Energiequellen	Goldman Sachs	USD	705.179	12.031	24. Mai 2023	12.031
Verkauf Short	Energie - Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	NOK	97.758	(5.113)	22. Feb. 2023	(5.113)
Verkauf Short	Energie - Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	SEK	162.111	4.906	09. Mai 2023	4.906
Verkauf Short	Energie - Alternative Energiequellen	J.P. Morgan	USD	105.125	(13.586)	09. Mai 2023	(14.637)
Verkauf Short	Energie - Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	SEK	4.568	324	15. Mai 2023	324
Verkauf Short	Energie - Alternative Energiequellen	Morgan Stanley	USD	153.189	(15.393)	15. Mai 2023	(15.393)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	CHF	188.062	(2.668)	24. Mai 2023	(2.668)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	375.566	(15.737)	06. Jun. 2023	(15.737)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	NZD	4.476	(171)	24. Mai 2023	(171)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	J.P. Morgan	NZD	168.391	(16.148)	09. Mai 2023	(16.148)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	MXN	4.372	142	15. Mai 2023	142
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	181.968	2.044	15. Mai 2023	2.044
Verkauf Short	Unterhaltung	J.P. Morgan	EUR	277.319	35.327	22. Feb. 2023	35.327
Verkauf Short	Umweltschutz	Morgan Stanley	NOK	50.080	(131)	15. Mai 2023	(131)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	EUR	180.041	(2.265)	24. Mai 2023	(2.265)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	404.487	5.946	24. Mai 2023	5.946
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	346.163	(2.261)	22. Nov. 2022	(2.261)
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	USD	7.796	(477)	22. Jun. 2021	(477)
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	HKD	46.103	(2.197)	15. Mai 2023	(2.197)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	CHF	669.204	(18.718)	24. Mai 2023	(18.718)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Markt- wert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	DKK	416.037	(27.222)	22. Feb. 2023	(27.222)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	DKK	93.132	(6.902)	24. Mai 2023	(6.902)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	SEK	853.231	(16.966)	26. Apr. 2023	(16.966)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Goldman Sachs	USD	3.267.118	35.576	24. Mai 2023	35.576
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	DKK	530.122	(86.016)	22. Feb. 2023	(86.016)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	SEK	396.647	(11.869)	22. Feb. 2023	(11.869)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	277.872	(9.498)	22. Jun. 2021	(9.498)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	J.P. Morgan	USD	1.498.544	(55.673)	09. Mai 2023	(55.673)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	CHF	266.363	(7.395)	15. Mai 2023	(7.395)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	DKK	318.724	(13.408)	15. Mai 2023	(13.408)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	HKD	226.477	15.734	15. Mai 2023	15.734
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	SEK	282.308	13.418	15. Mai 2023	13.418
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Produkte	Morgan Stanley	USD	726.098	(43.103)	15. Mai 2023	(43.103)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	273.993	(467)	24. Mai 2023	(467)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	JPY	282.247	773	24. Mai 2023	773
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1.627.554	45.509	24. Mai 2023	45.509
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	294.260	2.627	22. Jun. 2022	2.627
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	126.437	(424)	22. Feb. 2023	(424)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	JPY	98.508	(1.236)	09. Mai 2023	(1.236)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	270.921	(5.724)	22. Jun. 2021	(5.724)
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.968.115	135	09. Mai 2023	135
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	302.148	8.352	15. Mai 2023	8.352
Verkauf Short	Gesundheitswesen - Dienstleistungen	Morgan Stanley	JPY	274.291	(379)	15. Mai 2023	(379)
Verkauf Short	Holdinggesellschaften - Diverse	Goldman Sachs	USD	184.334	(1.773)	24. Mai 2023	(1.773)
Verkauf Short	Holdinggesellschaften - Diverse	J.P. Morgan	USD	440.782	12.086	09. Mai 2023	12.086
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Goldman Sachs	USD	94.398	(3.172)	24. Mai 2023	(3.172)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	J.P. Morgan	USD	175.832	(16.251)	22. Jun. 2021	(16.251)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	USD	1.078	(58)	15. Mai 2023	(58)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	EUR	1.133.332	(24.928)	24. Mai 2023	(24.928)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	HKD	330.849	(2.406)	24. Mai 2023	(2.406)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	USD	240.023	(2.382)	04. Feb. 2022	(2.382)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	USD	3.961.056	(17.396)	24. Mai 2023	(17.396)
Verkauf Short	Index	Goldman Sachs	USD	1.022.840	5.453	25. Mai 2023	5.453
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	HKD	31.118	(831)	09. Mai 2023	(831)
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	USD	3.650.000	140.778	17. Mai 2021	140.778
Verkauf Short	Index	J.P. Morgan	USD	6.519.479	274.844	09. Mai 2023	274.844
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	EUR	2.130.718	(17.991)	15. Mai 2023	(17.991)
Verkauf Short	Index	Morgan Stanley	USD	28.385.305	551.887	15. Mai 2023	590.978
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	DKK	14.376	(310)	24. Mai 2023	(310)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	EUR	1.071.670	(11.427)	24. Mai 2023	(11.427)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	GBP	741.287	(19.062)	06. Jan. 2023	(19.062)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	2.595.251	(34.247)	24. Mai 2023	(34.247)
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	AUD	415.546	4.295	22. Jun. 2022	4.295
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	EUR	171.291	998	22. Feb. 2023	998
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	USD	384.260	12.813	22. Jun. 2021	12.813
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	USD	1.204.691	(33.723)	09. Mai 2023	(33.723)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	DKK	366.673	(11.207)	15. Mai 2023	(11.207)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	617.567	10.200	15. Mai 2023	10.200

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Markt- wert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	1.060.593	(17.141)	15. Mai 2023	(17.141)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	GBP	14.677	676	10. Jan. 2022	676
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	1.503.686	44.398	24. Mai 2023	44.398
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	65.225	7.233	09. Mai 2023	7.233
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	GBP	118.030	1.789	15. Mai 2023	1.789
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	95.651	10.006	27. Dez. 2021	10.006
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	1.198.946	42.523	15. Mai 2023	42.523
Verkauf Short	Investmentgesellschaften	Goldman Sachs	USD	906.828	9.361	24. Mai 2023	9.361
Verkauf Short	Eisen / Stahl	J.P. Morgan	AUD	4.729	447	09. Mai 2023	447
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	268.659	715	26. Mai 2021	715
Verkauf Short	Maschinen - Bau u. Bergbau	Goldman Sachs	USD	241.838	(4.684)	24. Mai 2023	(4.684)
Verkauf Short	Maschinen - Bau u. Bergbau	J.P. Morgan	USD	101.672	(5.717)	09. Mai 2023	(5.717)
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	USD	1.006.645	18.540	24. Mai 2023	18.540
Verkauf Short	Medien	J.P. Morgan	USD	85.162	1.534	09. Mai 2023	1.534
Verkauf Short	Metallprodukte/Eisenwaren	Goldman Sachs	USD	282.615	(8.203)	24. Mai 2023	(8.203)
Verkauf Short	Bergbau	J.P. Morgan	USD	325.164	17.663	23. Feb. 2023	17.663
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	AUD	216.711	6.440	24. Mai 2023	6.440
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	AUD	455.234	13.111	14. Nov. 2025	13.111
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	EUR	326.971	(11.078)	14. Nov. 2025	(11.078)
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	JPY	82.464	5.113	17. Jan. 2023	5.113
Verkauf Short	Öl u. Gas	Goldman Sachs	USD	725.270	552	24. Mai 2023	552
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	CAD	1.900.586	90.518	09. Mai 2023	90.518
Verkauf Short	Öl u. Gas	J.P. Morgan	USD	5.572.233	521.148	09. Mai 2023	521.148
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	AUD	384.649	14.074	15. Mai 2023	14.074
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	CAD	108.327	15.575	15. Mai 2023	15.575
Verkauf Short	Öl u. Gas	Morgan Stanley	USD	801.747	51.861	15. Mai 2023	51.861
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	252.932	8.026	24. Mai 2023	8.026
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	167.666	24.043	22. Jun. 2021	24.043
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	9.302	602	22. Mrz. 2023	602
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1.029.279	151.152	09. Mai 2023	151.152
Verkauf Short	Öl- u. Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	306.626	44.827	15. Mai 2023	44.827
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	40.422	(662)	24. Mai 2023	(662)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	DKK	624.136	18.702	24. Mai 2023	18.702
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	126.133	(2.845)	06. Jan. 2023	(2.845)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	1.395.017	(8.713)	24. Mai 2023	(8.713)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	49.907	660	24. Feb. 2031	660
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	1.312.190	(6.548)	24. Mai 2023	(6.548)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	76.882	2.233	09. Feb. 2026	2.233
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	2.362.607	19.958	24. Mai 2023	19.958
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	49.677	(1.840)	25. Mai 2023	(1.840)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	273.596	(27.098)	09. Mai 2023	(27.098)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	193.433	(23.144)	22. Jun. 2022	(23.144)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	351.480	(9.668)	09. Mai 2023	(9.668)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	HKD	681.165	(13.565)	09. Mai 2023	(13.295)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	375.597	(25.794)	09. Mai 2023	(25.794)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	3.216.572	(129.538)	09. Mai 2023	(129.538)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	DKK	202.191	7.540	15. Mai 2023	7.540
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	488.591	(10.555)	15. Mai 2023	(10.555)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Total-Return-Swap-Kontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Markt- wert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	229.506	(2.553)	01. Apr. 2021	(2.553)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	2.082.739	(103.221)	15. Mai 2023	(103.221)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	436.653	(55.652)	23. Sept. 2021	(55.652)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1.044.201	120.391	15. Mai 2023	120.391
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	218.336	339	24. Mai 2023	339
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	282.778	(15.590)	06. Mrz. 2026	(15.590)
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	727.282	(6.094)	09. Mai 2023	(6.094)
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	USD	174.878	(3.427)	15. Mai 2023	(3.427)
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	USD	271.875	1.909	24. Mai 2023	1.909
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	HKD	60.746	181	24. Mai 2023	181
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	HKD	15.239	(905)	09. Mai 2023	(905)
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	USD	7.291	473	09. Mai 2023	473
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	HKD	75.874	227	15. Mai 2023	227
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	EUR	50.770	(340)	24. Mai 2023	(340)
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	USD	3.600	(703)	09. Mai 2023	(703)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	EUR	111.739	740	24. Mai 2023	740
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	HKD	265.568	4.020	24. Mai 2023	4.020
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	JPY	4.184	295	01. Mrz. 2023	295
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	169.450	(3.943)	24. Mai 2023	(3.943)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	HKD	56.670	3.590	09. Mai 2023	3.590
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	1.447.860	(236.198)	22. Jun. 2021	(236.198)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	589.532	(28.934)	09. Mai 2023	(28.934)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	JPY	1.998	101	15. Mai 2023	101
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	471.559	16.093	15. Mai 2023	16.093
Verkauf Short	Spar- und Darlehensgeschäft	Goldman Sachs	USD	518.994	6.489	24. Mai 2023	6.489
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	67.237	3.343	24. Mai 2023	3.343
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	165.172	(2.429)	09. Mai 2023	(2.429)
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	402.804	(12.122)	15. Mai 2023	(12.122)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	CHF	1.315.806	(14.968)	24. Mai 2023	(14.968)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	EUR	3.686	(32)	27. Dez. 2023	(32)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	GBP	128.636	10.387	24. Mai 2023	10.387
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	483.226	16.597	24. Mai 2023	23.936
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	CHF	79.053	(3.642)	09. Mai 2023	(3.642)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	1.158.076	(45.977)	09. Mai 2023	(45.977)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	CHF	511.066	(21.496)	15. Mai 2023	(21.496)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	EUR	424.084	(7.168)	15. Mai 2023	(7.168)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	109.934	68.160	31. Mrz. 2021	68.160
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	1.056.063	73.024	15. Mai 2023	73.024
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	JPY	174.615	(3.000)	22. Jun. 2022	(3.000)
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	379.862	(15.616)	09. Mai 2023	(15.616)
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	195.589	(8.968)	27. Dez. 2021	(8.968)
USD							533.487

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Differenzkontrakte

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

Zum 31. März 2021 wiesen die folgenden Teilfonds Differenzkontrakte auf Finanzindizes und Futures-Kontrakte auf:

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD auf den Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Credit Suisse	270	206.493	29.883
CFD auf den Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Credit Suisse	1.411	213.305	1.672
CFD auf den Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Credit Suisse	167	111.242	(979)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Credit Suisse	315	443.886	40.339
CFD auf den Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Credit Suisse	688	446.194	40.026
CFD auf den Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Credit Suisse	432	326.336	3.637
CFD auf den Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Credit Suisse	897	764.214	24.910
CFD auf den Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Credit Suisse	419	435.371	4.976
CFD auf den Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Index	Credit Suisse	438	352.991	19.770
CFD auf den Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Credit Suisse	1.128	414.620	31.787
CFD auf den Stoxx Europe 600 Media Price Index	Credit Suisse	824	301.613	18.321
CFD auf den Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Credit Suisse	1.111	339.137	(504)
CFD auf den Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Credit Suisse	544	618.772	43.808
CFD auf den Stoxx Europe 600 Retail Price Index	Credit Suisse	664	327.081	18.237
CFD auf den Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Credit Suisse	449	355.758	17.908
CFD auf den Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Credit Suisse	1.312	353.920	20.794
CFD auf den Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Credit Suisse	559	174.505	11.197
CFD auf den Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Credit Suisse	311	139.202	4.945
CFD auf den S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	448	600.730	14.644
CFD auf den S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	1.707	1.193.982	41.958
CFD auf den S&P 500 Energy Sector Index	Goldman Sachs	1.200	443.864	(8.167)
CFD auf den S&P 500 Financials Sector Index	Goldman Sachs	868	491.047	26.111
CFD auf den S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	743	1.010.736	36.462
CFD auf den S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	891	741.291	60.077
CFD auf den S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	244	568.779	6.533
CFD auf den S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	1.260	623.337	42.338
CFD auf den 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 auf argentinische Aktien	Morgan Stanley	(28.245)	167.068	167.068
CFD auf australische Aktien	Morgan Stanley	(146.764)	298.525	298.525
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	(997.400)	122.570	122.570
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	(1.289.220)	(217.167)	(217.167)
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	163.120	(627.998)	(627.998)
CFD auf deutsche Aktien	Morgan Stanley	717.851	1.085.317	1.092.343
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	(79.749)	430.993	430.993
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	(471.486)	577.166	577.166
CFD auf japanische Aktien	Morgan Stanley	246.000	(517.197)	(517.197)
CFD auf norwegische Aktien	Morgan Stanley	745.708	167.522	167.522
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	(86.697)	(312.140)	(312.140)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(1.415.305)	12.989.676	12.990.614
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(2.619.055)	(1.918.129)	(1.799.583)
			USD 12.246.206	12.372.716

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix				
CFD auf argentinische Aktien	Goldman Sachs	934	(16.187)	(16.192)
CFD auf argentinische Aktien	J.P. Morgan	4.613	21.008	21.008
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	2.049.501	(249.012)	(249.012)
CFD auf australische Aktien	J.P. Morgan	615.551	103.883	103.883
CFD auf österreichische Aktien	Goldman Sachs	36.995	(46.189)	(46.189)
CFD auf österreichische Aktien	J.P. Morgan	552	(1.730)	(1.730)
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	75.007	122.359	122.359
CFD auf belgische Aktien	J.P. Morgan	84.408	21.384	21.384
CFD auf brasilianische Aktien	Goldman Sachs	17.153	34.293	34.293
CFD auf brasilianische Aktien	J.P. Morgan	38.144	35.231	35.231
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	18.310.050	237.114	532.139
CFD auf britische Aktien	J.P. Morgan	1.446.091	301.513	301.513
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	2.698.050	(309.091)	(309.091)
CFD auf kanadische Aktien	J.P. Morgan	284.147	(13.053)	(13.053)
CFD auf chilenische Aktien	J.P. Morgan	5.931	(6.132)	(6.132)
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	19.755.101	(4.291.033)	(4.323.166)
CFD auf chinesische Aktien	J.P. Morgan	6.005.161	(1.528.373)	(1.528.373)
CFD auf dänische Aktien	Goldman Sachs	(16.942)	(10.706)	(10.712)
CFD auf dänische Aktien	J.P. Morgan	4.354	367.324	367.324
CFD auf niederländische Aktien	Goldman Sachs	488.104	624.396	624.394
CFD auf niederländische Aktien	J.P. Morgan	180.871	782.307	782.307
CFD auf finnische Aktien	Goldman Sachs	74.867	(142.007)	(142.007)
CFD auf finnische Aktien	J.P. Morgan	73.278	(55.789)	(55.789)
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	253.682	533.482	534.031
CFD auf französische Aktien	J.P. Morgan	249.489	151.055	151.055
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	262.138	1.159.623	1.159.943
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	173.190	124.472	124.472
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	3.094.467	(73.241)	(73.241)
CFD auf Aktien aus Hongkong	J.P. Morgan	2.062.400	(330.408)	(330.408)
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	87.582	(51.731)	(51.731)
CFD auf indische Aktien	J.P. Morgan	68.161	(7.498)	(7.498)
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	265.373	136.179	136.179
CFD auf irische Aktien	J.P. Morgan	27.167	51.644	51.644
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	82.000	25.842	25.842
CFD auf italienische Aktien	J.P. Morgan	192.590	16.057	16.057
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	3.362.680	1.329.390	1.334.406
CFD auf japanische Aktien	J.P. Morgan	5.907.291	(2.259.120)	(2.259.120)
CFD auf Aktien aus Jersey	Goldman Sachs	5.515	(1.026)	(1.026)
CFD auf kuwaitische Aktien	J.P. Morgan	(477.067)	39.632	39.632
CFD auf luxemburgische Aktien	Goldman Sachs	31.187	141.537	141.537
CFD auf luxemburgische Aktien	J.P. Morgan	71.071	85.599	85.599
CFD auf Aktien aus Macau	Goldman Sachs	670.800	(29.329)	(29.329)
CFD auf Aktien aus Macau	J.P. Morgan	104.000	(85.618)	(85.618)
CFD auf mexikanische Aktien	J.P. Morgan	48.592	124.881	124.881
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	55.836	21.058	21.058
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P. Morgan	(169.616)	53.956	53.956
CFD auf norwegische Aktien	Goldman Sachs	157.179	84.161	84.155
CFD auf norwegische Aktien	J.P. Morgan	156.620	(15.217)	(15.217)
CFD auf philippinische Aktien	Goldman Sachs	(165.360)	30.474	30.474

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf polnische Aktien	Goldman Sachs	(86.354)	291.932	291.932
CFD auf portugiesische Aktien	Goldman Sachs	(48.811)	(80.137)	(80.137)
CFD auf portugiesische Aktien	J.P. Morgan	1.031.417	(6.669)	(6.669)
CFD auf russische Aktien	Goldman Sachs	4.078.134	276.940	277.369
CFD auf russische Aktien	J.P. Morgan	(20.847)	52.743	52.743
CFD auf saudi-arabische Aktien	Goldman Sachs	(85.360)	(44.171)	(44.171)
CFD auf saudi-arabische Aktien	J.P. Morgan	10.981	84.297	84.297
CFD auf Aktien aus Singapur	Goldman Sachs	1.313.899	180.530	180.564
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	886.800	(4.271)	(4.271)
CFD auf südafrikanische Aktien	Goldman Sachs	(16.411)	27.252	27.252
CFD auf südafrikanische Aktien	J.P. Morgan	57.929	(16.261)	(16.261)
CFD auf spanische Aktien	Goldman Sachs	(108.388)	(79.997)	(79.966)
CFD auf spanische Aktien	J.P. Morgan	(193.482)	(170.279)	(170.279)
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	631.110	117.075	117.280
CFD auf schwedische Aktien	J.P. Morgan	581.161	315.796	315.796
CFD auf Schweizer Aktien	Goldman Sachs	69.821	36.595	36.595
CFD auf Schweizer Aktien	J.P. Morgan	274.504	(8.549)	(8.549)
CFD auf taiwanische Aktien	Goldman Sachs	(12.324)	(52.371)	(52.522)
CFD auf taiwanische Aktien	J.P. Morgan	(213.830)	56.291	56.291
CFD auf Aktien aus den Vereinigten Arabischen Emiraten	Goldman Sachs	(100.115)	(1.932)	(1.932)
CFD auf Aktien aus den Vereinigten Arabischen Emiraten	J.P. Morgan	125.984	(18.410)	(18.410)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	999.632	476.149	471.913
CFD auf US-Aktien	J.P. Morgan	653.432	357.356	357.356
CFD auf FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(332)	(29.306)	(29.306)
CFD auf MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(25.281)	2.506.724	2.506.724
CFD auf 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 auf australische Aktien	Goldman Sachs	74.041	4.590	4.590
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	(1.020)	(4.676)	(3.994)
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	184.944	(21.059)	(21.059)
CFD auf kanadische Aktien	J.P. Morgan	17.626	1.823	1.823
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	787.000	2.414	2.414
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	24	1.949	1.949
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	187	(885)	(885)
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	(370)	651	651
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	24.041	1.202	1.202
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	18.242	(535)	(535)
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	2.500	3.274	3.274
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	(2.203)	(3.217)	(3.217)
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	13.352	29.960	29.960
			USD	15.491
				16.173
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	6.342.493	74.998	74.998
CFD auf Aktien aus den Vereinigten Arabischen Emiraten	Morgan Stanley	(112.989)	(1.582)	(1.582)
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(20.805)	15.500	15.500
CFD auf FTSE 250 Index	Bank of America	(316)	(20.436)	(20.436)
CFD auf ML Custom Index	Bank of America	(17.684)	7.493	6.424
			GBP	75.973
				74.904

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Credit-Default-Index

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

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

Am 31. März 2021 waren die folgenden Teilfonds Credit-Default-Index-Kontrakte auf Finanzindizes eingegangen:

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/erhalten %	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 35 20/06/2026	J.P. Morgan	EUR	8.000.000	2,00	20. Jun. 2026	988.465
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 35 20/06/2026	J.P. Morgan	EUR	41.000.000	3,00	20. Jun. 2026	1.069.416
Verkauf	CDX North America High Yield Series 35 20/12/2025	J.P. Morgan	USD	13.946.330	4,00	20. Dez. 2025	830.888
Verkauf	CDX North America High Yield Series 36 20/06/2026	J.P. Morgan	USD	4.946.330	4,00	20. Jun. 2026	6.668
Verkauf	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							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 35 20/06/2026	Citi Bank	EUR	54.000.000	1,00	20. Jun. 2026	(64.540)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 35 20/06/2026	Citi Bank	EUR	10.000.000	1,00	20. Jun. 2026	(20.674)
Verkauf	CDX North America High Yield Series 36 20/06/2026	Citi Bank	USD	20.000.000	5,00	20. Jun. 2026	74.968
Verkauf	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							
Verkauf	CDX North America High Yield Series 32 20/06/2024	Morgan Stanley	USD	2.670.000	1,00	20. Jun. 2024	(29.623)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 34 20/12/2025	Morgan Stanley	EUR	13.890.000	1,00	20. Dez. 2025	(21.765)
Verkauf	CDX Emerging Markets Series 35 20/06/2026	Morgan Stanley	USD	7.628.000	1,00	20. Jun. 2026	10.371
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 35 20/06/2026	Morgan Stanley	EUR	6.720.000	1,00	20. Jun. 2026	(53.629)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 35 20/06/2026	Morgan Stanley	EUR	6.675.000	1,00	20. Jun. 2026	(12.328)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 35 20/06/2026	Morgan Stanley	EUR	13.455.000	1,00	20. Jun. 2026	(29.016)
Verkauf	CDX North America High Yield Series 36 20/06/2026	Morgan Stanley	USD	7.775.000	1,00	20. Jun. 2026	(35.891)
Verkauf	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)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Credit Default Swaps

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

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

Zum 31. März 2021 war der folgende Teilfonds Credit-Default-Swap-Kontrakte eingegangen:

Schutz- position	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	Australien	Bergbau	Morgan Stanley	EUR	600.000	20. Jun. 2026	8.368
Verkauf	Österreich	Telekommunikation	Morgan Stanley	EUR	4.175.000	20. Jun. 2026	(1.415)
Verkauf	Brasilien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	545.000	20. Jun. 2025	3.129
Verkauf	Brasilien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	596.000	20. Dez. 2025	(1.174)
Verkauf	Brasilien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2.380.000	20. Jun. 2026	3.567
Verkauf	Chile	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.103.000	20. Jun. 2026	291
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	978.000	20. Dez. 2025	1.443
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	600.000	20. Jun. 2026	405
Verkauf	Kolumbien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.500.000	20. Dez. 2025	(2.479)
Verkauf	Kolumbien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.775.000	20. Jun. 2026	1.697
Verkauf	Frankreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1.225.000	20. Jun. 2026	(5.990)
Kauf	Frankreich	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	300.000	20. Dez. 2022	(1.927)
Verkauf	Frankreich	Gewerbliche Dienstleistungen	Credit Suisse	EUR	300.000	20. Dez. 2025	9.054
Verkauf	Frankreich	Elektrik	Morgan Stanley	EUR	2.625.000	20. Jun. 2026	(10.199)
Verkauf	Frankreich	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	2.925.000	20. Jun. 2026	(1.141)
Verkauf	Frankreich	Beherbergungsunter- nehmen	Morgan Stanley	EUR	2.230.000	20. Jun. 2026	(14.974)
Kauf	Frankreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	1.470.000	20. Jun. 2026	15.470
Kauf	Frankreich	Medien	Credit Suisse	EUR	735.000	20. Jun. 2026	(586)
Verkauf	Frankreich	Telekommunikation	Credit Suisse	EUR	325.000	20. Dez. 2025	(3.134)
Verkauf	Deutschland	Banken	Morgan Stanley	EUR	1.550.000	20. Jun. 2026	1.242
Verkauf	Deutschland	Freizeit	Morgan Stanley	EUR	725.000	20. Dez. 2025	(24.137)
Verkauf	Indonesien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.140.000	20. Dez. 2025	2.500
Kauf	Italien	Banken	Barclays Bank	EUR	1.100.000	20. Jun. 2026	(2.100)
Verkauf	Luxemburg	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	EUR	1.075.000	20. Jun. 2026	(4.077)
Kauf	Luxemburg	Medien	Barclays Bank	EUR	525.000	20. Dez. 2024	26.639
Kauf	Malaysia	Öffentliche Hand	Citi Bank	USD	550.000	20. Jun. 2026	50
Verkauf	Mexiko	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	730.000	20. Dez. 2024	(5.628)
Verkauf	Mexiko	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	574.000	20. Dez. 2025	(376)
Verkauf	Mexiko	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	11.984.210	20. Jun. 2026	2.547
Verkauf	Niederlande	Medien	J.P. Morgan	EUR	300.000	20. Dez. 2025	(3.104)
Verkauf	Niederlande	Telekommunikation	Morgan Stanley	EUR	1.125.000	20. Jun. 2026	(11.827)
Verkauf	Peru	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.077.000	20. Jun. 2025	3.955
Verkauf	Peru	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.744.000	20. Dez. 2025	(13.164)
Verkauf	Philippinen	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.555.000	20. Dez. 2025	(4.331)
Verkauf	Russische Föderation	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	522.000	20. Dez. 2025	4.569

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Credit Default Swaps (Forts.)

Schutz- position	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nenn- betrag	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf	Russische Föderation	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.071.000	20. Jun. 2026	322
Verkauf	Saudi-Arabien	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2.155.000	20. Dez. 2025	7.296
Verkauf	Südafrika	Bergbau	Morgan Stanley	EUR	900.000	20. Jun. 2026	6.482
Verkauf	Südafrika	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.189.000	20. Jun. 2025	44.924
Verkauf	Südafrika	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	1.105.000	20. Dez. 2025	(238)
Verkauf	Südafrika	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2.080.000	20. Jun. 2026	(950)
Verkauf	Südkorea	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	2.855.000	20. Dez. 2024	5.524
Verkauf	Südkorea	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	551.000	20. Dez. 2025	(547)
Verkauf	Schweiz	Baustoffe	Morgan Stanley	EUR	1.750.000	20. Dez. 2025	402
Verkauf	Türkei	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	585.000	20. Dez. 2025	8.423
Kauf	Türkei	Öffentliche Hand	Goldman Sachs	USD	490.000	20. Jun. 2026	7.589
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	950.000	20. Jun. 2023	(86.018)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	410.000	20. Dez. 2025	(44.436)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Banken	Morgan Stanley	EUR	5.400.000	20. Jun. 2026	6.316
Kauf	Vereinigtes Königreich	Gewerbliche Dienstleistungen	Barclays Bank	EUR	175.000	20. Jun. 2026	746
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Unterhaltung	Morgan Stanley	EUR	350.000	20. Dez. 2025	6.083
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Bank of America	EUR	150.000	20. Dez. 2022	642
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	BNP Paribas	EUR	175.000	20. Dez. 2022	748
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	460.000	20. Dez. 2025	6.749
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Credit Suisse	EUR	455.000	20. Dez. 2025	7.917
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	750.000	20. Jun. 2026	842
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	300.000	20. Dez. 2025	(262)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	2.020.000	20. Jun. 2026	(4.913)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	650.000	20. Dez. 2025	1.192
Verkauf	Vereinigte Staaten	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1.700.000	20. Jun. 2026	23.631
Verkauf	Vereinigte Staaten	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	825.000	20. Jun. 2026	(2.062)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	930.000	20. Jun. 2026	(7.049)
Kauf	Vereinigte Staaten	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	500.000	20. Dez. 2024	3.874
Verkauf	Vereinigte Staaten	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	910.000	20. Jun. 2025	(40.235)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Eisen / Stahl	Morgan Stanley	USD	995.000	20. Dez. 2024	(131.674)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Medien	Morgan Stanley	USD	1.155.000	20. Dez. 2024	(24.733)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Verpackung u. Behälter	Bank of America	EUR	300.000	20. Dez. 2025	(2.985)
Kauf	Vereinigte Staaten	Immobilien	J.P. Morgan	USD	705.000	20. Jun. 2024	(60.355)
Verkauf	Vereinigte Staaten	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	1.920.000	20. Jun. 2025	32.529
USD							(261.063)

Cross-Currency-Swap-Kontrakte

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

Zum 31. März 2021 war der folgende Teilfonds in Cross-Currency-Swap-Kontrakten engagiert:

Kontrahent	Zu zahlende Währung	Nennwert	Erhaltene Währung	Nennwert	Fälligkeits- datum	Zu zahlender Satz	Erhaltener Satz	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Cross-Currency-Swap-Kontrakte (Forts.)

Kontrahent	Zu zahlende Währung	Nennwert	Erhaltene Währung	Nennwert	Fälligkeitsdatum	Zu zahlender Satz	Erhaltener Satz	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)								
Bank of America	RUB	62.814.000	USD	850.562	16. Jun. 2026	5,50 %	USD LIBOR 3 Months	32.329
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	04. Jun. 2031	USD LIBOR 1 Month	MXN TIIE 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. Sept. 2023	5,41 %	USD LIBOR 3 Months	110.944
J.P. Morgan	RUB	75.162.000	USD	1.071.218	21. Dez. 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. Sept. 2023	15,40 %	USD LIBOR 3 Months	305.220
J.P. Morgan	TRY	10.191.000	USD	1.244.930	15. Sept. 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	04. Jun. 2031	USD LIBOR 1 Month	MXN TIIE 28 Days	102.572
Morgan Stanley	RUB	53.995.000	USD	731.640	16. Jun. 2023	5,02 %	USD LIBOR 3 Months	26.711

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Cross-Currency-Swap-Kontrakte (Forts.)

Kontrahent	Zu zahlende Währung	Nennwert	Erhaltene Währung	Nennwert	Fälligkeitsdatum	Zu zahlender Satz	Erhaltener Satz	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)								
Morgan Stanley	USD	8.209.606	AUD	10.721.000	16. Jun. 2026	USD LIBOR 3 Months	AUD BBR 6 Months	(61.011)
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

Zins-Swaps

Zur Absicherung gegen Zinsschwankungen kann die Gesellschaft Zins-Swap-Geschäfte abschließen, sofern

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

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

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

Zum 31. März 2021 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Zinssätze engagiert:

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Erhält Festzinssatz 6,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	40.000.000	BRL	02. Jan. 2024	(237.454)
Zahlt Festzinssatz 7,09 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	40.000.000	BRL	02. Jan. 2024	165.659
Zahlt Festzinssatz 1,72 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	500.000	USD	16. Jun. 2046	48.442
Zahlt Festzinssatz 6,54 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	77.402.588	BRL	02. Jan. 2023	130.631
Erhält Festzinssatz 6,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	77.402.588	BRL	02. Jan. 2023	(159.187)
Erhält Festzinssatz 5,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	100.000.000	MXN	10. Jun. 2026	(245.659)
Zahlt Festzinssatz 1,61 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	500.000	USD	16. Jun. 2046	59.526
Zahlt Festzinssatz 1,82 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	1.000.000	USD	16. Jun. 2046	59.337

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 1,91 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	500.000	USD	16. Jun. 2046	29.447
Zahlt Festzinssatz 5,34 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	100.000.000	MXN	10. Jun. 2026	183.102
Zahlt Festzinssatz 1,93 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	1.000.000	USD	16. Jun. 2041	41.867
Zahlt Festzinssatz 2,13 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	500.000	USD	16. Jun. 2046	7.127
Zahlt Festzinssatz 4,80 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	181.132.075	MXN	14. Jun. 2023	80.484
Erhält Festzinssatz 4,54 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	181.132.075	MXN	14. Jun. 2023	(125.296)
Zahlt Festzinssatz 1,50 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	3.492.692	USD	16. Jun. 2028	1.089
Zahlt Festzinssatz 0,62 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	2.039.606	USD	16. Jun. 2025	20.274
Erhält Festzinssatz 0,74 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	10.000.000	NZD	16. Jun. 2023	30.292
Erhält Festzinssatz 0,30 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	5.039.606	USD	16. Jun. 2025	(114.062)
Erhält Festzinssatz -0,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz CHF LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	938.501	CHF	16. Jun. 2031	(41.126)
Zahlt Festzinssatz 6,32 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	41.525.424	ZAR	16. Jun. 2026	(15.087)
Erhält Festzinssatz 0,61 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	1.492.692	USD	16. Jun. 2028	(90.559)
Zahlt Festzinssatz 1,72 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	2.000.000	NZD	16. Jun. 2031	39.587
Zahlt Festzinssatz 0,23 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	3.938.501	CHF	16. Jun. 2031	(79.075)
Zahlt Festzinssatz 0,45 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	800.000.000	JPY	16. Jun. 2041	(12.616)
Zahlt Festzinssatz 0,41 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	2.679.012	USD	16. Jun. 2023	(4.512)
Zahlt Festzinssatz -0,21 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	2.000.000	CHF	16. Jun. 2026	(18.609)
Zahlt Festzinssatz -0,21 %					
Erhält variablen Zinssatz CHF LIBOR 6 Months	J.P. Morgan	4.000.000	CHF	16. Jun. 2026	(37.218)
Erhält Festzinssatz 5,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	41.525.424	ZAR	16. Jun. 2026	(127.167)
Erhält Festzinssatz 0,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	J.P. Morgan	2.679.012	USD	16. Jun. 2023	(10.657)
Erhält Festzinssatz 3,78 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	72.222.222	ZAR	16. Jun. 2023	(80.190)
Zahlt Festzinssatz 4,50 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	72.222.222	ZAR	16. Jun. 2023	14.125
Zahlt Festzinssatz 0,54 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	28.664.807	SEK	16. Jun. 2026	(29.496)
Erhält Festzinssatz 0,29 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	14.756.443	SEK	16. Jun. 2031	(87.262)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 0,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	28.664.807	SEK	16. Jun. 2026	(53.116)
Erhält Festzinssatz -0,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	71.000.000	SEK	16. Jun. 2023	(25.455)
Erhält Festzinssatz -0,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	29.000.000	SEK	16. Jun. 2023	(10.397)
Zahlt Festzinssatz 0,97 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	24.756.443	SEK	16. Jun. 2031	(41.202)
Erhält Festzinssatz -0,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	13.108.893	EUR	16. Jun. 2023	(43.997)
Zahlt Festzinssatz -0,35 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	3.108.893	EUR	16. Jun. 2023	(9.857)
				USD	(788.267)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Zahlt Festzinssatz 9,44 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	1.290.325	BRL	02. Jan. 2025	(20.357)
Zahlt Festzinssatz 6,71 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Goldman Sachs	3.571.494	BRL	02. Jan. 2025	35.109
Zahlt Festzinssatz 1,11 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	1.812.875.000	KRW	18. Mrz. 2031	59.783
Zahlt Festzinssatz 4,80 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	BNP Paribas	7.322.414	BRL	02. Jan. 2023	14.069
Zahlt Festzinssatz 4,70 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Goldman Sachs	9.784.783	BRL	02. Jan. 2023	23.236
Zahlt Festzinssatz 4,98 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	9.187.996	BRL	02. Jan. 2023	18.806
Zahlt Festzinssatz 2,95 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	3.815.000	CNY	16. Jun. 2026	(4.064)
Erhält Festzinssatz 4,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	167.511.000	INR	16. Jun. 2026	(44.185)
Erhält Festzinssatz 0,99 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.443.000	NZD	16. Jun. 2031	(96.690)
Erhält Festzinssatz 4,50 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	132.117.000	MXN	15. Mrz. 2023	(66.254)
Erhält Festzinssatz 0,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.261.000	GBP	15. Jun. 2023	(5.507)
Zahlt Festzinssatz 4,24 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	295.544.000	MXN	15. Jun. 2022	74.488
Erhält Festzinssatz 3,57 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	4.141.638.000	COP	16. Jun. 2026	(49.222)
Zahlt Festzinssatz 0,13 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	14.025.000	ILS	16. Jun. 2023	10.624
Erhält Festzinssatz 1,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.806.000	CZK	17. Jun. 2031	(7.722)
Erhält Festzinssatz 3,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Citi Bank	1.982.841.000	COP	16. Jun. 2026	(29.179)
Zahlt Festzinssatz 4,35 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Bank of America	74.119.000	INR	16. Jun. 2026	34.992
Erhält Festzinssatz 3,26 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Citi Bank	3.484.003.000	COP	16. Jun. 2026	(54.716)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 5,07 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	BNP Paribas	9.444.681	BRL	02. Jan. 2023	24.051
Zahlt Festzinssatz 5,07 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	6.513.178	BRL	02. Jan. 2023	17.018
Zahlt Festzinssatz 6,63 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	5.544.725	BRL	04. Jan. 2027	90.926
Erhält Festzinssatz 5,02 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Goldman Sachs	38.136.000	INR	16. Jun. 2026	(2.909)
Zahlt Festzinssatz 6,74 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	5.752.072	BRL	04. Jan. 2027	88.323
Zahlt Festzinssatz 6,72 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	1.893.760	BRL	04. Jan. 2027	29.463
Zahlt Festzinssatz 2,03 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	28.481.000	MYR	16. Jun. 2023	43.254
Zahlt Festzinssatz 6,89 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	3.680.828	BRL	04. Jan. 2027	51.009
Erhält Festzinssatz 4,55 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	67.338.000	ZAR	15. Jun. 2023	(27.159)
Zahlt Festzinssatz 3,85 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	93.516.000	ZAR	16. Jun. 2022	16.450
Erhält Festzinssatz 5,30 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	176.605.000	INR	16. Jun. 2026	16.487
Zahlt Festzinssatz 1,39 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	353.000	NZD	17. Mrz. 2031	13.044
Zahlt Festzinssatz 0,32 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	5.733.000	SGD	16. Jun. 2023	19.976
Erhält Festzinssatz 1,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	23.321.000	CZK	17. Jun. 2031	(18.606)
Zahlt Festzinssatz 0,91 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.165.802.000	HUF	16. Jun. 2022	23.672
Zahlt Festzinssatz 7,10 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	12.664.953	BRL	04. Jan. 2027	150.150
Erhält Festzinssatz 2,96 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	J.P. Morgan	8.790.000	CNY	17. Mrz. 2026	11.501
Zahlt Festzinssatz 7,71 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	11.711.490	BRL	04. Jan. 2027	67.102
Zahlt Festzinssatz 3,24 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	513.061.000	CLP	16. Jun. 2031	17.411
Zahlt Festzinssatz 3,23 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	J.P. Morgan	176.115.000	CLP	16. Jun. 2031	6.146
Zahlt Festzinssatz 1,96 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.680.000	NZD	16. Jun. 2031	6.927
Zahlt Festzinssatz 1,96 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.668.000	NZD	16. Jun. 2031	7.094
Zahlt Festzinssatz 2,56 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Bank of America	8.006.000	MYR	16. Jun. 2026	26.238
Erhält Festzinssatz 2,84 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	6.141.000	AUD	17. Jun. 2031	(19.012)
Erhält Festzinssatz 1,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Deutsche Bank	850.000	ILS	17. Jun. 2031	(1.080)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 8,01 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	11.560.570	BRL	04. Jan. 2027	30.557
Zahlt Festzinssatz 8,07 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	11.522.847	BRL	04. Jan. 2027	22.779
Zahlt Festzinssatz 7,75 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	2.818.214	BRL	04. Jan. 2027	15.540
Zahlt Festzinssatz 5,56 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	8.909.918	BRL	02. Jan. 2023	14.019
Zahlt Festzinssatz 4,54 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	184.821.000	INR	16. Jun. 2023	(16.473)
Erhält Festzinssatz 5,57 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	86.404.000	INR	16. Jun. 2026	21.952
Zahlt Festzinssatz 4,52 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Deutsche Bank	121.016.000	INR	16. Jun. 2023	(10.162)
Erhält Festzinssatz 5,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Citi Bank	135.348.000	INR	15. Sep. 2026	23.439
Zahlt Festzinssatz 2,52 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	2.185.240.000	CLP	16. Jun. 2026	1.607
Erhält Festzinssatz 1,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	67.054.000	INR	16. Jun. 2023	48.393
Zahlt Festzinssatz 4,90 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	228.477.000	INR	15. Sept. 2023	(28.216)
Zahlt Festzinssatz 7,74 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	1.332.503	BRL	04. Jan. 2027	7.828
Erhält Festzinssatz 4,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	137.875.000	MXN	14. Mrz. 2023	(65.357)
Zahlt Festzinssatz 5,43 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	113.505.000	INR	16. Jun. 2026	(19.379)
Zahlt Festzinssatz 4,63 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	J.P. Morgan	200.450.000	INR	16. Jun. 2026	61.822
Erhält Festzinssatz 4,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	4.816.626.000	COP	15. Sep. 2026	(17.356)
Erhält Festzinssatz 4,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	J.P. Morgan	3.951.104.000	COP	15. Sep. 2026	(14.237)
Zahlt Festzinssatz 5,30 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	19.150.000	INR	16. Jun. 2026	(1.759)
Zahlt Festzinssatz 5,39 %					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	J.P. Morgan	27.220.000	INR	16. Jun. 2026	(4.040)
Erhält Festzinssatz 4,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Goldman Sachs	9.530.664.000	COP	16. Jun. 2026	(21.694)
Erhält Festzinssatz 4,57 %					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	4.281.893.000	COP	15. Sep. 2026	(10.271)
Zahlt Festzinssatz 6,65 %					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	3.085.385	BRL	02. Jan. 2023	(4.863)
Zahlt Festzinssatz 3,57 %					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	J.P. Morgan	5.835.286.000	COP	15. Sept. 2023	(4.638)
Erhält Festzinssatz 7,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	13.215.040	MXN	16. Sep. 2026	3.115
Erhält Festzinssatz 3,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Credit Suisse	830.706.000	CLP	18. Mrz. 2031	(52.804)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 0,96 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Citi Bank	1.059.594.000	KRW	16. Jun. 2023	3.361
Zahlt Festzinssatz 0,66 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.576.000	GBP	15. Jun. 2025	13.808
Erhält Festzinssatz 1,09 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	1.844.000	CAD	15. Jun. 2025	(22.025)
Zahlt Festzinssatz 0,34 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	11.107.000	SEK	21. Sept. 2025	1.602
Zahlt Festzinssatz 1,12 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	1.514.755.000	KRW	17. Sept. 2030	49.386
Zahlt Festzinssatz 0,78 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	28.576.000	SEK	17. Dez. 2030	46.954
Erhält Festzinssatz 3,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	1.268.566.000	CLP	17. Dez. 2030	(68.355)
Erhält Festzinssatz 0,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.933.000	NZD	21. Dez. 2025	(58.372)
Zahlt Festzinssatz -0,03 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.335.000	EUR	17. Dez. 2030	64.241
Zahlt Festzinssatz 6,73 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	12.042.800	MXN	11. Dez. 2030	22.231
Zahlt Festzinssatz 1,05 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	2.051.546.000	KRW	17. Dez. 2030	72.450
Zahlt Festzinssatz 1,24 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	2.017.758.000	KRW	17. Dez. 2030	56.265
Zahlt Festzinssatz 1,20 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	168.121.000	KRW	17. Dez. 2030	4.905
Erhält Festzinssatz 2,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	BNP Paribas	62.404.000	CNY	16. Dez. 2025	1.879
Erhält Festzinssatz 1,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	3.032.000	ILS	17. Dez. 2030	(33.234)
Erhält Festzinssatz 0,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	2.291.000	AUD	15. Mrz. 2026	(42.401)
Erhält Festzinssatz 0,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	4.651.068.000	KRW	16. Mrz. 2023	(12.979)
Erhält Festzinssatz 0,47 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.047.000	USD	15. Mrz. 2026	(89.274)
Zahlt Festzinssatz 1,11 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.354.506.000	KRW	18. Mrz. 2031	44.932
Erhält Festzinssatz 1,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	492.000	ILS	18. Mrz. 2031	(5.966)
Zahlt Festzinssatz 0,55 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.749.000	SEK	18. Mrz. 2031	6.766
Zahlt Festzinssatz 0,72 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	539.000	GBP	18. Mrz. 2031	26.631
Zahlt Festzinssatz 0,60 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	15.032.000	SEK	18. Mrz. 2031	54.118
Erhält Festzinssatz 1,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	2.916.000	AUD	18. Mrz. 2031	(147.505)
Erhält Festzinssatz 0,96 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	424.000	NZD	18. Mrz. 2031	(25.385)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 6,71 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	5.913.000	MXN	12. Mrz. 2031	11.441
Zahlt Festzinssatz 7,58 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	76.505.000	ZAR	08. Nov. 2031	202.270
Erhält Festzinssatz 1,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.609.000	AUD	18. Mrz. 2031	(85.161)
Erhält Festzinssatz 4,55 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	51.395.000	MXN	07. Nov. 2023	(49.800)
Zahlt Festzinssatz 1,33 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	1.378.254.000	KRW	18. Mrz. 2031	33.620
Erhält Festzinssatz 1,57 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	969.000	AUD	18. Mrz. 2031	(42.857)
Zahlt Festzinssatz 4,56 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	184.140.000	MXN	15. Nov. 2022	49.865
Erhält Festzinssatz 1,54 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.355.000	AUD	18. Mrz. 2031	(61.349)
Erhält Festzinssatz 1,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5.572.000	NZD	18. Mrz. 2031	(268.572)
Erhält Festzinssatz 1,48 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	2.214.000	AUD	18. Mrz. 2031	(104.958)
Zahlt Festzinssatz 1,33 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	976.073.000	KRW	18. Mrz. 2031	23.733
Zahlt Festzinssatz 0,31 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	14.398.000	ILS	16. Jun. 2026	93.259
Zahlt Festzinssatz 1,82 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.301.000	PLN	18. Mrz. 2031	48.014
Erhält Festzinssatz 0,83 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	160.394.000	CZK	16. Jun. 2023	(45.204)
Zahlt Festzinssatz 0,14 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	74.911.000	JPY	18. Mrz. 2031	5.134
Erhält Festzinssatz 0,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	6.734.000	SGD	15. Jun. 2023	(16.091)
Erhält Festzinssatz 4,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	712.123.000	CLP	18. Mrz. 2031	(17.242)
Erhält Festzinssatz 1,68 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.323.000	AUD	18. Mrz. 2031	(53.862)
Zahlt Festzinssatz -0,44 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.660.000	EUR	16. Jun. 2026	26.972
Zahlt Festzinssatz -0,22 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	253.000	EUR	16. Jun. 2031	10.848
Zahlt Festzinssatz -0,03 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	314.319.000	JPY	21. Jun. 2026	6.339
Zahlt Festzinssatz 0,19 %					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.070.000	AUD	15. Jun. 2023	6.658
Erhält Festzinssatz 1,09 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	2.655.000	AUD	16. Jun. 2031	(91.902)
Zahlt Festzinssatz 0,66 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	49.952.000	NOK	15. Jun. 2023	30.447
Erhält Festzinssatz 0,59 %					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	32.197.000	NOK	16. Jun. 2023	(25.935)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 0,94 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	41.516.000	NOK	16. Jun. 2026	163
Zahlt Festzinssatz 0,16 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	37.062.000	SEK	16. Jun. 2026	33.724
Zahlt Festzinssatz 0,41 %					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	6.163.000	SEK	16. Jun. 2031	29.406
Zahlt Festzinssatz 0,56 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.884.000	GBP	16. Jun. 2031	76.393
Erhält Festzinssatz 0,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	5.940.000	CAD	15. Jun. 2023	(8.881)
Erhält Festzinssatz 0,97 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	6.352.000	CAD	16. Jun. 2026	(152.296)
Zahlt Festzinssatz 0,53 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	4.597.000	USD	16. Jun. 2026	50.673
Zahlt Festzinssatz 0,32 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	20.007.000	NZD	15. Jun. 2023	46.954
Erhält Festzinssatz 4,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	87.455.000	MXN	16. Dez. 2021	(4.502)
Zahlt Festzinssatz 5,45 %					
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Morgan Stanley	67.493.000	RUB	16. Jun. 2023	21.210
Zahlt Festzinssatz 0,26 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	16.016.000	PLN	16. Jun. 2022	2.113
Zahlt Festzinssatz 0,64 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.313.000	NZD	16. Jun. 2026	25.082
Zahlt Festzinssatz 0,58 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	3.863.000	NZD	16. Jun. 2026	81.486
Zahlt Festzinssatz 0,58 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.325.000	NZD	16. Jun. 2026	48.204
Zahlt Festzinssatz 0,66 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.292.000	GBP	17. Jun. 2031	113.576
Zahlt Festzinssatz 0,25 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7.395.000	GBP	16. Jun. 2026	239.439
Erhält Festzinssatz 0,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	7.515.000	USD	16. Jun. 2023	(11.496)
Erhält Festzinssatz 0,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	4.174.000	AUD	16. Jun. 2026	(86.143)
Erhält Festzinssatz 1,18 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	3.890.801.000	CLP	15. Jun. 2023	(64.478)
Erhält Festzinssatz 1,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	4.008.043.000	CLP	16. Mrz. 2023	(63.286)
Erhält Festzinssatz 1,01 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Bank of America	3.890.476.000	CLP	17. Mrz. 2023	(62.801)
Erhält Festzinssatz 3,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.348.000	CLP	18. Mrz. 2031	(162)
Erhält Festzinssatz 3,71 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	6.005.000	CLP	18. Mrz. 2031	(252)
Erhält Festzinssatz 4,40 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	66.925.000	MXN	04. Jan. 2024	(87.215)
Erhält Festzinssatz 1,77 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	2.275.000	AUD	18. Mrz. 2031	(85.696)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 4,32 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	65.809.810	MXN	15. Mrz. 2023	(38.266)
Erhält Festzinssatz 4,31 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	132.341.190	MXN	15. Mrz. 2023	(77.653)
Zahlt Festzinssatz 1,45 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	957.824.000	KRW	18. Mrz. 2031	18.880
Erhält Festzinssatz 0,22 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	10.545.000	PLN	16. Mrz. 2023	(10.185)
Zahlt Festzinssatz 1,70 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.795.000	PLN	18. Mrz. 2031	25.179
Zahlt Festzinssatz 1,49 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	1.516.016.000	KRW	18. Mrz. 2031	27.516
Zahlt Festzinssatz 0,93 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.790.495.000	HUF	16. Jun. 2023	71.857
Zahlt Festzinssatz 1,81 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.075.000	PLN	17. Jun. 2031	40.602
Zahlt Festzinssatz 0,98 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	686.068.000	HUF	16. Jun. 2023	25.771
Zahlt Festzinssatz 0,69 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Bank of America	854.353.000	CLP	16. Jun. 2022	4.863
Zahlt Festzinssatz 1,20 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	839.682.000	KRW	16. Jun. 2026	11.974
Zahlt Festzinssatz 0,14 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	J.P. Morgan	9.649.000	ILS	16. Jun. 2023	6.878
Erhält Festzinssatz 4,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29.295.000	MXN	17. Jan. 2022	(3.296)
Zahlt Festzinssatz 0,15 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	11.919.000	ILS	16. Jun. 2023	7.892
Zahlt Festzinssatz 4,04 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	99.478.000	ZAR	16. Jun. 2023	76.708
Zahlt Festzinssatz 0,99 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	722.293.000	HUF	16. Jun. 2023	26.443
Zahlt Festzinssatz 0,78 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.380.000	PLN	16. Jun. 2026	31.871
Zahlt Festzinssatz 1,01 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Bank of America	851.028.000	CLP	16. Jun. 2023	17.024
Zahlt Festzinssatz 0,19 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	53.036.000	PLN	16. Jun. 2022	17.336
Zahlt Festzinssatz 4,85 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	34.090.000	MXN	10. Jun. 2026	98.327
Zahlt Festzinssatz 1,20 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1.057.352.000	KRW	16. Jun. 2026	15.191
Zahlt Festzinssatz 1,51 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	780.855.000	KRW	17. Jun. 2031	13.859
Zahlt Festzinssatz 6,58 %					
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Barclays Bank	33.718.000	RUB	16. Jun. 2031	27.330
Zahlt Festzinssatz 0,19 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	11.383.000	PLN	16. Jun. 2022	3.629
Zahlt Festzinssatz 0,32 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	5.230.000	SGD	16. Jun. 2023	18.417

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 0,69 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	491.000	NZD	16. Jun. 2026	8.599
Zahlt Festzinssatz 1,33 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9.082.000	NOK	21. Jun. 2026	16.792
Zahlt Festzinssatz 5,23 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10.682.000	ZAR	16. Jun. 2026	29.999
Zahlt Festzinssatz 5,25 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10.926.000	ZAR	16. Jun. 2026	29.971
Zahlt Festzinssatz 1,04 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.763.000	PLN	21. Jun. 2026	17.407
Erhält Festzinssatz 1,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	574.000	AUD	17. Jun. 2031	(21.529)
Zahlt Festzinssatz 1,21 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	649.829.000	KRW	16. Jun. 2026	9.129
Zahlt Festzinssatz 6,59 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	4.454.000	MXN	11. Jun. 2031	9.696
Zahlt Festzinssatz 1,55 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	680.982.000	KRW	17. Jun. 2031	11.104
Zahlt Festzinssatz 0,97 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	1.397.404.000	KRW	16. Jun. 2023	4.311
Zahlt Festzinssatz 5,20 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	3.252.000	ZAR	16. Jun. 2026	9.374
Zahlt Festzinssatz 1,84 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.185.000	PLN	17. Jun. 2031	85.794
Erhält Festzinssatz 2,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.834.000	AUD	17. Jun. 2031	(54.633)
Erhält Festzinssatz 2,04 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.835.000	AUD	17. Jun. 2031	(54.643)
Erhält Festzinssatz 2,01 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	3.241.000	NZD	17. Jun. 2031	(92.065)
Erhält Festzinssatz 2,13 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	3.285.000	AUD	17. Jun. 2031	(87.568)
Zahlt Festzinssatz 6,47 %					
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Barclays Bank	49.189.000	RUB	16. Jun. 2031	44.925
Zahlt Festzinssatz 1,06 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.474.953.000	CLP	16. Jun. 2023	27.414
Zahlt Festzinssatz 1,11 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	J.P. Morgan	1.802.721.000	CLP	16. Jun. 2023	31.081
Zahlt Festzinssatz 1,94 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.183.000	PLN	17. Jun. 2031	27.443
Zahlt Festzinssatz 0,48 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.065.000	PLN	16. Jun. 2023	4.910
Zahlt Festzinssatz 4,16 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	26.137.000	ZAR	16. Jun. 2023	16.236
Zahlt Festzinssatz 1,04 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.583.268.000	HUF	16. Jun. 2023	85.949
Zahlt Festzinssatz 1,06 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.120.326.000	CLP	16. Jun. 2023	20.646
Zahlt Festzinssatz 4,88 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	12.180.000	MXN	10. Jun. 2026	34.245

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 0,97 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Bank of America	5.522.328.000	KRW	16. Jun. 2023	16.989
Zahlt Festzinssatz 0,98 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Deutsche Bank	5.522.328.000	KRW	16. Jun. 2023	16.315
Erhält Festzinssatz 2,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.511.000	AUD	17. Jun. 2031	(41.724)
Zahlt Festzinssatz 0,89 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.037.069.000	HUF	16. Jun. 2022	23.669
Erhält Festzinssatz 4,52 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	115.645.000	ZAR	15. Jun. 2023	(48.790)
Zahlt Festzinssatz 3,85 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	132.623.000	ZAR	16. Jun. 2022	23.329
Erhält Festzinssatz 1,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.838.000	USD	17. Jun. 2031	(30.138)
Erhält Festzinssatz 6,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Barclays Bank	76.885.000	RUB	16. Jun. 2031	(55.587)
Erhält Festzinssatz 6,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	BNP Paribas	76.885.000	RUB	16. Jun. 2031	(56.079)
Zahlt Festzinssatz 5,72 %					
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Barclays Bank	287.720.000	RUB	16. Jun. 2023	71.620
Zahlt Festzinssatz 5,70 %					
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	BNP Paribas	287.725.000	RUB	16. Jun. 2023	73.014
Zahlt Festzinssatz 5,35 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	21.751.000	ZAR	16. Jun. 2026	53.128
Zahlt Festzinssatz 1,56 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	402.000	NZD	17. Mrz. 2031	10.442
Zahlt Festzinssatz 1,14 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.957.000	PLN	16. Jun. 2026	16.720
Zahlt Festzinssatz 0,57 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.882.000	PLN	16. Jun. 2023	1.600
Zahlt Festzinssatz 4,43 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	84.191.000	ZAR	16. Jun. 2023	23.418
Zahlt Festzinssatz 5,61 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	52.766.000	ZAR	16. Jun. 2026	89.592
Erhält Festzinssatz 4,12 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	85.695.000	MXN	16. Feb. 2022	(15.046)
Zahlt Festzinssatz 0,97 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.817.000	NZD	16. Jun. 2026	22.255
Erhält Festzinssatz 1,79 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.546.000	NZD	16. Jun. 2031	(23.133)
Erhält Festzinssatz 1,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2.020.000	NZD	16. Jun. 2031	(49.623)
Erhält Festzinssatz 0,23 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.600.000	USD	16. Jun. 2023	(6.157)
Zahlt Festzinssatz 0,78 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	1.200.000	USD	16. Jun. 2026	19.697
Erhält Festzinssatz 2,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.230.000	AUD	17. Jun. 2031	(22.075)
Erhält Festzinssatz 2,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.995.000	AUD	17. Jun. 2031	(36.274)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 2,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	2.640.000	AUD	17. Jun. 2031	(47.602)
Erhält Festzinssatz 1,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	995.000	NZD	16. Jun. 2031	(24.443)
Zahlt Festzinssatz 0,97 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.940.000	NZD	16. Jun. 2026	15.160
Erhält Festzinssatz 1,65 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	990.000	NZD	16. Jun. 2031	(24.320)
Zahlt Festzinssatz 1,03 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.940.000	NZD	16. Jun. 2026	11.676
Erhält Festzinssatz 1,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	995.000	NZD	16. Jun. 2031	(21.528)
Zahlt Festzinssatz 5,84 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	24.910.000	ZAR	16. Jun. 2026	25.662
Erhält Festzinssatz 7,44 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	26.975.000	ZAR	16. Jun. 2031	(50.629)
Erhält Festzinssatz 2,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.072.000	AUD	17. Jun. 2031	(15.696)
Erhält Festzinssatz 1,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	4.562.000	AUD	16. Jun. 2031	(101.484)
Zahlt Festzinssatz 2,15 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	13.980.000	NOK	17. Jun. 2031	8.202
Zahlt Festzinssatz 1,81 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	3.997.245.000	KRW	17. Jun. 2031	23.607
Zahlt Festzinssatz 5,39 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	56.169.000	MXN	10. Jun. 2026	96.000
Erhält Festzinssatz 2,62 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.435.000	NZD	17. Jun. 2031	(13.728)
Erhält Festzinssatz 2,58 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.432.000	NZD	17. Jun. 2031	(15.469)
Zahlt Festzinssatz 2,96 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Citi Bank	16.432.000	CNY	16. Jun. 2026	(18.961)
Erhält Festzinssatz 1,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	1.830.000	SGD	21. Jun. 2026	(12.638)
Erhält Festzinssatz 1,80 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	2.850.000	ILS	17. Jun. 2031	(9.118)
Zahlt Festzinssatz 2,06 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.125.000	NZD	17. Mrz. 2031	(7.404)
Zahlt Festzinssatz 1,96 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	500.000	USD	08. Feb. 2033	11.047
Erhält Festzinssatz 6,35 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	6.505.000	MXN	14. Feb. 2031	(11.776)
Zahlt Festzinssatz 0,34 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.397.000	EUR	18. Mrz. 2031	4.705
Zahlt Festzinssatz 4,61 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	47.430.000	ZAR	16. Jun. 2023	2.527
Zahlt Festzinssatz 4,67 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	60.535.000	ZAR	16. Jun. 2023	(1.620)
Erhält Festzinssatz 4,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	46.585.000	ZAR	16. Jun. 2022	(396)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 4,16 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	59.185.000	ZAR	16. Jun. 2022	1.637
Erhält Festzinssatz 5,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	56.080.000	ZAR	16. Jun. 2024	(5.928)
Erhält Festzinssatz 5,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	17.955.000	ZAR	16. Jun. 2024	1.286
Zahlt Festzinssatz 1,96 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	65.000	NZD	16. Jun. 2031	260
Zahlt Festzinssatz 1,96 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	870.000	NZD	16. Jun. 2031	3.672
Zahlt Festzinssatz 1,95 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	870.000	NZD	16. Jun. 2031	3.842
Zahlt Festzinssatz 1,93 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	870.000	NZD	16. Jun. 2031	5.116
Zahlt Festzinssatz 1,80 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	43.861.000	NOK	16. Jun. 2031	29.076
Zahlt Festzinssatz 1,91 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	1.329.000	CAD	16. Jun. 2031	20.559
Zahlt Festzinssatz 1,89 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	2.690.000	CAD	16. Jun. 2031	47.977
Zahlt Festzinssatz 1,92 %					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	2.710.000	CAD	16. Jun. 2031	42.305
Erhält Festzinssatz 1,37 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	5.365.000	CAD	16. Jun. 2026	(32.818)
Erhält Festzinssatz 1,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	5.580.000	CAD	16. Jun. 2026	(34.312)
Erhält Festzinssatz 1,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	5.365.000	CAD	16. Jun. 2026	(29.367)
Erhält Festzinssatz 1,95 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Goldman Sachs	6.125.000	ILS	17. Jun. 2031	(6.950)
Erhält Festzinssatz 1,39 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	5.153.000	CAD	16. Jun. 2026	(29.077)
Zahlt Festzinssatz 2,59 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	4.625.000	MYR	16. Jun. 2026	13.359
Zahlt Festzinssatz 2,91 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	J.P. Morgan	13.863.000	CNY	16. Jun. 2026	(10.842)
Erhält Festzinssatz 2,06 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	2.351.000	ILS	17. Jun. 2031	973
Zahlt Festzinssatz 4,37 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	50.117.000	MXN	15. Jun. 2022	9.976
Zahlt Festzinssatz 7,43 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	13.925.000	MXN	11. Jun. 2031	13.016
Erhält Festzinssatz 2,86 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.725.000	NZD	17. Jun. 2031	(3.861)
Erhält Festzinssatz 1,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	755.000	AUD	16. Jun. 2026	848
Zahlt Festzinssatz 0,37 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	11.765.000	PLN	16. Jun. 2022	(1.793)
Zahlt Festzinssatz 2,41 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5.096.000	PLN	17. Jun. 2031	6.453

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 0,72 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.596.000	PLN	16. Jun. 2023	(2.904)
Zahlt Festzinssatz 1,36 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.818.000	PLN	16. Jun. 2026	88
Zahlt Festzinssatz 0,27 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	6.455.000	ILS	16. Jun. 2023	(209)
Zahlt Festzinssatz 0,70 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	3.610.000	ILS	16. Jun. 2026	2.588
Zahlt Festzinssatz 1,42 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.445.071.000	HUF	16. Jun. 2023	13.824
Zahlt Festzinssatz 1,13 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	525.536.000	HUF	16. Jun. 2022	2.067
Zahlt Festzinssatz 4,60 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	45.007.000	ZAR	16. Jun. 2023	2.655
Zahlt Festzinssatz 4,12 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	41.824.000	ZAR	16. Jun. 2022	137
Zahlt Festzinssatz 1,77 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	2.710.398.000	KRW	17. Jun. 2031	19.954
Zahlt Festzinssatz 1,06 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	J.P. Morgan	2.870.272.000	KRW	16. Jun. 2023	4.224
Erhält Festzinssatz 1,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.897.825.000	HUF	15. Jun. 2023	(28.339)
Zahlt Festzinssatz 1,43 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Goldman Sachs	1.491.823.000	KRW	16. Jun. 2025	1.078
Erhält Festzinssatz 1,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4.510.000	PLN	16. Jun. 2026	(1.323)
Zahlt Festzinssatz 1,92 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.515.000	PLN	16. Jun. 2031	(625)
Erhält Festzinssatz 6,72 %					
Zahlt variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	J.P. Morgan	65.715.000	RUB	16. Jun. 2026	(15.431)
Erhält Festzinssatz 7,14 %					
Zahlt variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Barclays Bank	80.315.000	RUB	16. Jun. 2031	(20.543)
Zahlt Festzinssatz 1,09 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	615.355.000	CZK	16. Jun. 2023	26.664
Erhält Festzinssatz 1,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	524.865.000	CZK	16. Jun. 2026	(141.256)
Zahlt Festzinssatz 1,76 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	140.325.000	CZK	16. Jun. 2031	61.753
Zahlt Festzinssatz 1,42 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.170.265.000	HUF	16. Jun. 2023	56.594
Erhält Festzinssatz 1,92 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.292.945.000	HUF	16. Jun. 2026	(256.252)
Zahlt Festzinssatz 2,43 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2.374.520.000	HUF	16. Jun. 2031	188.909
Zahlt Festzinssatz 1,73 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10.730.000	PLN	16. Jun. 2031	47.092
Zahlt Festzinssatz 6,10 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	60.635.000	ZAR	16. Jun. 2026	16.873
Erhält Festzinssatz 7,67 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	54.220.000	ZAR	16. Jun. 2031	(42.527)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 10,01 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	26.480.000	ZAR	17. Jun. 2031	(14.062)
Zahlt Festzinssatz 2,24 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14.122.000	NOK	17. Jun. 2031	1.692
Zahlt Festzinssatz 2,22 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	17.260.000	NOK	17. Jun. 2031	3.914
Erhält Festzinssatz 0,43 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Bank of America	24.462.000	ILS	15. Jun. 2023	3.424
Erhält Festzinssatz 0,42 %					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	27.038.000	ILS	15. Jun. 2023	2.658
Erhält Festzinssatz 1,11 %					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	122.400.000	CZK	16. Jun. 2023	(3.313)
Zahlt Festzinssatz -0,47 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14.720.000	EUR	16. Jun. 2023	(5.227)
Erhält Festzinssatz -0,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8.530.000	EUR	16. Jun. 2026	(1.945)
Zahlt Festzinssatz 0,06 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.345.000	EUR	16. Jun. 2031	7.759
Erhält Festzinssatz 0,28 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	3.335.000	USD	16. Jun. 2023	(1.167)
Zahlt Festzinssatz 1,69 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	355.000	USD	16. Jun. 2031	5.904
Erhält Festzinssatz 7,94 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	11.722.000	ZAR	16. Jun. 2031	6.049
Erhält Festzinssatz 1,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.890.000	PLN	16. Jun. 2026	(22.715)
Erhält Festzinssatz 1,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	26.266.000	PLN	16. Jun. 2031	(91.697)
Zahlt Festzinssatz 7,44 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	11.120.052	MXN	11. Jun. 2031	9.868
Zahlt Festzinssatz 6,39 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	21.591.000	MXN	04. Jun. 2031	44.553
Zahlt Festzinssatz 3,12 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	153.851.000	HUF	17. Jun. 2031	3.512
Zahlt Festzinssatz 4,73 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	76.356.000	MXN	14. Jun. 2023	39.203
Zahlt Festzinssatz 1,53 %					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Deutsche Bank	1.934.505.000	KRW	15. Sep. 2026	5.149
Zahlt Festzinssatz 2,95 %					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	9.006.000	CNY	15. Sep. 2026	(7.872)
Erhält Festzinssatz 2,54 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.670.850.000	CLP	16. Jun. 2026	(33.955)
Zahlt Festzinssatz 1,39 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2.302.290.000	CLP	16. Jun. 2023	21.612
Zahlt Festzinssatz 1,42 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	3.051.870.000	CLP	16. Jun. 2023	26.060
Zahlt Festzinssatz 3,43 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	757.795.000	CLP	16. Jun. 2031	8.601
Zahlt Festzinssatz 3,43 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	595.415.000	CLP	16. Jun. 2031	6.586

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 5,49 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	82.035.000	MXN	04. Mrz. 2026	97.947
Erhält Festzinssatz 6,70 %					
Zahlt variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Citi Bank	52.425.000	RUB	16. Jun. 2026	(12.749)
Zahlt Festzinssatz 6,09 %					
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Citi Bank	317.355.000	RUB	16. Jun. 2023	50.587
Zahlt Festzinssatz 1,13 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	10.610.887.000	CLP	15. Sept. 2022	54.630
Zahlt Festzinssatz 6,52 %					
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	J.P. Morgan	536.389.000	RUB	15. Sept. 2023	50.629
Zahlt Festzinssatz 0,31 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	BNP Paribas	7.100.000	ILS	15. Sept. 2023	513
Zahlt Festzinssatz 1,64 %					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	16.254.000	CZK	15. Sep. 2026	6.137
Zahlt Festzinssatz 2,37 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.985.000	PLN	16. Sept. 2031	25.593
Erhält Festzinssatz 1,93 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	4.403.991.000	CLP	15. Jun. 2023	(27.828)
Erhält Festzinssatz 0,38 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	786.000	GBP	15. Sept. 2023	(807)
Zahlt Festzinssatz -0,25 %					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	485.000	EUR	15. Sep. 2026	481
Erhält Festzinssatz 1,09 %					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	1.524.000	AUD	15. Sep. 2026	(4.077)
Zahlt Festzinssatz 0,69 %					
Erhält variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	277.000	GBP	15. Sep. 2026	1.734
Erhält Festzinssatz 0,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz GBP LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.425.000	GBP	21. Sept. 2023	(1.122)
Erhält Festzinssatz 2,46 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4.784.645.000	CLP	16. Jun. 2026	(84.326)
Zahlt Festzinssatz 1,34 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	5.645.230.000	CLP	16. Jun. 2023	60.447
Zahlt Festzinssatz 3,35 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1.329.735.000	CLP	16. Jun. 2031	26.764
Erhält Festzinssatz 2,92 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	J.P. Morgan	5.370.000	CNY	16. Jun. 2026	4.580
Zahlt Festzinssatz 1,60 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.073.904.000	HUF	15. Sept. 2023	8.941
Erhält Festzinssatz 0,81 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	5.601.000	CAD	15. Sept. 2023	240
Zahlt Festzinssatz 0,19 %					
Erhält variablen Zinssatz JPY LIBOR 6 Months	Morgan Stanley	47.918.000	JPY	15. Sept. 2031	432
Zahlt Festzinssatz 1,71 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6.070.000	PLN	16. Jun. 2031	30.222
Erhält Festzinssatz 1,18 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.590.000	PLN	16. Jun. 2026	(26.217)
Zahlt Festzinssatz 0,47 %					
Erhält variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	5.048.000	USD	21. Sept. 2023	1.247
Erhält Festzinssatz 0,34 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	6.530.000	USD	15. Sept. 2023	(2.844)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 1,63 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	5.760.000	USD	15. Sept. 2031	(102.338)
Erhält Festzinssatz 2,45 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	J.P. Morgan	973.918.000	CLP	16. Jun. 2026	(17.861)
Zahlt Festzinssatz 2,21 %					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	22.420.000	NOK	17. Jun. 2031	7.014
Zahlt Festzinssatz 0,81 %					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	J.P. Morgan	6.191.000	ILS	15. Sep. 2026	1.097
Erhält Festzinssatz 2,10 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	391.542.000	HUF	16. Jun. 2026	(5.562)
Zahlt Festzinssatz 1,58 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Bank of America	5.125.549.000	CLP	15. Sept. 2023	56.785
Zahlt Festzinssatz 4,19 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Goldman Sachs	882.600.000	ZAR	17. Jan. 2022	(21.805)
Erhält Festzinssatz 2,01 %					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	225.155.000	HUF	16. Jun. 2026	(6.010)
Erhält Festzinssatz 4,17 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	105.510.000	ZAR	16. Jun. 2022	3.262
Erhält Festzinssatz 4,21 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	63.305.000	ZAR	16. Jun. 2022	3.504
Zahlt Festzinssatz 4,63 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	107.760.000	ZAR	16. Jun. 2023	3.277
Zahlt Festzinssatz 4,68 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	64.660.000	ZAR	16. Jun. 2023	(2.552)
Erhält Festzinssatz 5,20 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	22.145.000	ZAR	16. Jun. 2024	1.483
Zahlt Festzinssatz 4,75 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	163.590.000	MXN	16. Mrz. 2023	48.560
Zahlt Festzinssatz 5,63 %					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	96.130.000	MXN	12. Mrz. 2026	87.267
Zahlt Festzinssatz 1,47 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	6.122.000	NZD	15. Sep. 2026	(33.725)
Erhält Festzinssatz 1,69 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	8.609.000	CAD	15. Sep. 2026	24.316
Erhält Festzinssatz 2,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz USD LIBOR 3 Months	Morgan Stanley	2.553.000	USD	16. Sept. 2031	1.719
Zahlt Festzinssatz 1,49 %					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1.735.995.000	HUF	16. Jun. 2023	8.085
Erhält Festzinssatz 2,91 %					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	3.883.000	CAD	16. Sept. 2031	5.870
Erhält Festzinssatz 2,87 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	436.147.000	CLP	15. Sep. 2026	(1.460)
Erhält Festzinssatz 2,60 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	1.205.090.000	CLP	16. Jun. 2026	(10.296)
Zahlt Festzinssatz 1,49 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	1.416.980.000	CLP	16. Jun. 2023	9.516
Zahlt Festzinssatz 3,45 %					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Citi Bank	336.430.000	CLP	16. Jun. 2031	2.749
Zahlt Festzinssatz 7,29 %					
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Goldman Sachs	52.390.000	RUB	15. Sep. 2026	(1.844)

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zins-Swaps (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 7,50 %					
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Goldman Sachs	54.390.000	RUB	15. Sep. 2026	(8.177)
Zahlt Festzinssatz 7,14 %					
Erhält variablen Zinssatz RUB MOSPRIME 3 Months	Barclays Bank	54.389.000	RUB	15. Sep. 2026	2.610
Zahlt Festzinssatz 2,45 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.425.000	PLN	16. Jun. 2031	9.787
Zahlt Festzinssatz 1,80 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	11.470.000	PLN	20. Sep. 2026	15.764
Zahlt Festzinssatz 1,29 %					
Erhält variablen Zinssatz SGD SOR 6 Months	Morgan Stanley	2.112.000	SGD	15. Sep. 2026	2.213
Erhält Festzinssatz 0,49 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	6.899.000	NZD	15. Sept. 2023	(10.505)
Erhält Festzinssatz 1,33 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.525.000	NZD	21. Jun. 2025	(9.594)
Erhält Festzinssatz 1,18 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7.689.000	NZD	21. Jun. 2025	(25.693)
Erhält Festzinssatz 1,15 %					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	22.422.000	NZD	21. Jun. 2025	(82.901)
Erhält Festzinssatz 2,66 %					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Citi Bank	21.983.000	CNY	15. Sept. 2023	1.223
Zahlt Festzinssatz 1,86 %					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1.109.000	NZD	16. Jun. 2031	11.987
Erhält Festzinssatz 4,56 %					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Goldman Sachs	1.066.645.000	CLP	16. Sept. 2031	3.764
Erhält Festzinssatz 0,64 %					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	20.627.000	PLN	21. Sept. 2023	(13.464)
Erhält Festzinssatz 8,05 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	9.300.000	ZAR	15. Sept. 2031	978
Erhält Festzinssatz 8,03 %					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	6.025.000	ZAR	15. Sept. 2031	133
Zahlt Festzinssatz 4,10 %					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Goldman Sachs	1.297.445.000	ZAR	31. Jan. 2022	(5.318)
Erhält Festzinssatz 6,76 %					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19.940.000	MXN	18. Mrz. 2031	(6.800)
Zahlt Festzinssatz 2,86 %					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	8.705.000	MYR	15. Sep. 2026	5.589
Zahlt Festzinssatz 0,69 %					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12.105.000	PLN	15. Sept. 2023	1.590
				USD	1.103.554

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

Zum 31. März 2021 gestaltete sich die Exponierung bei in Bezug auf Derivatkontrakte zu erhaltenden Sicherheiten je Kontrahent folgendermaßen:

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA BlueTrend				
	Credit Suisse	Barmittel	USD	5.132.752
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	1.653.399
	J.P. Morgan	Barmittel	NZD	73.590
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	2.471.143
			USD	9.594.231
Schroder GAIA Egerton Equity				
	HSBC	Barmittel	EUR	9.184.503
	Merrill Lynch	Barmittel	CAD	2
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	3
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	13.530.443
			EUR	22.714.950
Schroder GAIA Helix				
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	2.248.114
	Goldman Sachs	Barmittel	GBP	2.522.217
	Goldman Sachs	Barmittel	HKD	967.140
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	15.125.590
	J.P. Morgan	Barmittel	CAD	12.484
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	4.358.560
	J.P. Morgan	Barmittel	HKD	2.545.691
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	75.158.628
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	10.281.034
			USD	37.771.981
Schroder GAIA M&A*				
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	8.944
			USD	8.944
Schroder GAIA Sirius US Equity				
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	320.000
			USD	320.000
Schroder GAIA Two Sigma Diversified				
	Credit Suisse	Barmittel	EUR	5.234.230
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	1.721.469
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	20.427.431
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	416.675.698
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	25.012.467
	Societe Generale	Barmittel	AUD	6.597.457
	Societe Generale	Barmittel	GBP	7.421.329
	Societe Generale	Barmittel	SEK	9.867.123
	Societe Generale	Barmittel	SGD	553.631
	Societe Generale	Barmittel	USD	49
			USD	77.022.446
Schroder GAIA UK Dynamic Absolute Return Fund				
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	148.635
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	10
			GBP	148.642
Schroder GAIA Wellington Pagosa				
	Barclays Bank	Barmittel	USD	680.000
	BNP Paribas	Barmittel	USD	260.000
	Citi Bank	Barmittel	USD	354.000

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)	Credit Suisse	Barmittel	USD	90.000
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	2.340.024
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	3.838.000
	Merrill Lynch	Barmittel	USD	684.529
	Morgan Stanley	Barmittel	AUD	260
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	39.965
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	302.781
	Morgan Stanley	Barmittel	HUF	7.967
	Morgan Stanley	Barmittel	NOK	4.019.866
	Morgan Stanley	Barmittel	NZD	9.024
	Morgan Stanley	Barmittel	PLN	12.898
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	5.106
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	2.325.943
	Standard Chartered Bank	Barmittel	USD	320.000
			USD	11.840.349

Ausweis von Transaktionskosten

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

Die Transaktionskosten für den Berichtszeitraum fielen wie folgt aus:

Teilfonds	Währung	Provisionen
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

Während des Berichtszeitraums haben die folgenden Teilfonds Dividendenausschüttungen vorgenommen:

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Brutto-ausschüttung	Währung	Aus-schüttung pro Anteil
9. Okt. 2020	16. Okt. 2020	23. Okt. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	226,18	USD	1,020023
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	428,54	SGD	1,349634
13. Nov. 2020	20. Nov. 2020	27. Nov. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	901,52	USD	4,065662
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.710,72	SGD	5,387570
11. Dez. 2020	18. Dez. 2020	28. Dez. 2020	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	850,70	USD	3,836475
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.105,06	SGD	5,099957
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch. QV	64.179,91	USD	11,740972

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

Anmerkungen zum Abschluss zum 31. März 2021 (Forts.)

Dividenden (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Brutto- ausschüttung	Währung	Aus- schüttung pro Anteil
8. Jan. 2021	15. Jan. 2021	22. Jan. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	599,65	USD	2,704293
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.484,78	SGD	3,596859
12. Feb. 2021	19. Feb. 2021	26. Feb. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	728,12	USD	3,283666
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	2.366,42	SGD	4,387777
12. Mrz. 2021	19. Mrz. 2021	26. Mrz. 2021	Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch.	619,67	USD	2,794579
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	1.793,74	SGD	3,762040
			Schroder GAIA Cat Bond Klasse IF Aussch. QV	157.508,93	USD	11,870498

Gegenseitige Anlagen der Teilfonds

Zum 31. März 2021 belaufen sich die gegenseitigen Anlagen der Teilfonds auf insgesamt 5.108.723 EUR, daher würde der kombinierte Gesamt-NIW am Ende des Berichtszeitraums ohne gegenseitige Anlagen 5.175.712.309 EUR betragen. Die Einzelheiten zu den gegenseitigen Anlagen der Teilfonds sind in der folgenden Tabelle angegeben:

Anlage	Währung des Teilfonds	Markt- wert	% des Netto- vermögens
Schroder GAIA Helix			
Schroder GAIA M&A		5.991.000	1,21
	USD	5.991.000	1,21

Wechselkurs

Der folgende Wechselkurs wurde für die Berechnung des im Abschluss zum 31. März 2021 in EUR ausgewiesenen Gesamtbetrags verwendet:

1 Euro = 1,17270 US-Dollar

1 Euro = 0,85065 Pfund Sterling

Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Am 28. April 2021 wurde der Teilfonds Schroder GAIA M&A aufgelöst.

Am 12. Mai 2021 wurde der folgende Teilfonds aufgelegt: Schroder GAIA Oaktree Credit.

Gesamtkostenquote („TER“)

für den Berichtszeitraum zum 31. März 2021

Anteilsklasse	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 Fund	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse A Thes.	2,00 %	1,80 %	2,46 %	2,45 %	2,50 %	1,41 %	2,45 %	-	-	2,45 %
Klasse A Thes. (in CHF abgesichert)	2,03 %	-	2,51 %	-	2,50 %	1,72 %	2,48 %	-	-	2,48 %
Klasse A Thes. (in EUR abgesichert)	2,03 %	-	2,49 %	-	2,54 %	1,72 %	2,48 %	-	-	2,48 %
Klasse A Thes. (in GBP abgesichert)	-	-	-	2,48 %	-	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SEK abgesichert)	-	1,77 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse A Thes. (in SGD abgesichert)	2,03 %	-	2,48 %	-	2,49 %	-	-	-	-	2,48 %
Klasse A Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	2,48 %	-	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	2,45 %	-	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	2,95 %	2,95 %	-	-	-	-	-	2,81 %
Klasse A1 Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	2,98 %	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	1,40 %	1,40 %	1,71 %	1,70 %	1,41 %	0,75 %	1,69 %	1,85 %	1,20 %	1,70 %
Klasse C Thes. (in BRL abgesichert)	1,56 %	-	-	-	-	-	-	-	-	1,74 %
Klasse C Thes. (in CHF abgesichert)	1,43 %	1,42 %	1,75 %	-	1,44 %	1,00 %	1,73 %	1,89 %	1,22 %	1,69 %
Klasse C Thes. (in EUR abgesichert)	1,43 %	1,48 %	1,74 %	-	1,45 %	0,78 %	1,73 %	1,88 %	1,22 %	1,72 %
Klasse C Thes. (in GBP abgesichert)	1,43 %	1,42 %	1,74 %	1,73 %	1,45 %	1,00 %	1,73 %	1,89 %	-	1,73 %
Klasse C Thes. (in JPY abgesichert)	-	-	-	1,71 %	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	1,73 %	-	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	1,73 %	-	1,45 %	-	-	-	-	1,74 %
Klasse C Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	1,73 %	-	-	-	-	1,22 %	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	1,70 %	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	1,70 %	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. (in GBP abgesichert)	1,43 %	-	-	-	-	-	1,73 %	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	1,32 %	-	-	-	-	1,59 %
Klasse C1 Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	1,44 %	-	-	-	-	1,73 %
Klasse C1 Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	1,43 %	-	-	-	-	1,73 %
Klasse E Thes.	1,40 %	-	1,45 %	1,70 %	1,00 %	0,47 %	1,40 %	-	-	1,20 %
Klasse E Thes. CHF	1,30 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in CHF abgesichert)	1,43 %	-	1,48 %	-	1,00 %	0,76 %	-	-	-	1,23 %
Klasse E Thes. (in EUR abgesichert)	1,43 %	-	1,48 %	-	1,00 %	0,75 %	1,43 %	-	-	1,23 %
Klasse E Thes. GBP	1,39 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in GBP abgesichert)	1,43 %	-	1,48 %	-	1,00 %	0,76 %	-	-	-	1,23 %
Klasse E Thes. (in SEK abgesichert)	-	-	1,48 %	-	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes. (in SGD abgesichert)	-	-	1,48 %	-	1,00 %	-	-	-	-	1,24 %
Klasse E Aussch. (in GBP abgesichert)	1,43 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	1,75 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in CHF abgesichert)	-	1,76 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes. (in EUR abgesichert)	-	1,75 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	1,75 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch. (in SGD abgesichert)	-	1,75 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	0,05 %	0,17 %	0,06 %	0,12 %	0,17 %	0,25 %	0,15 %	0,07 %	0,06 %	0,07 %
Klasse I Thes. (in CHF abgesichert)	-	0,18 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in EUR abgesichert)	-	0,21 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes. (in JPY abgesichert)	-	0,19 %	-	-	0,19 %	-	-	-	-	-

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

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

Gesamtkostenquote („TER“)

für den Berichtszeitraum zum 31. März 2021 (Forts.)

Anteilsklasse	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 Fund	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse I Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	0,19 %	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	1,35 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in CHF abgesichert)	-	1,36 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in EUR abgesichert)	-	1,36 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes. (in SEK abgesichert)	-	1,36 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch. QV	-	1,35 %	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-	-	2,35 %	-	-
Klasse K Thes. (in CHF abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	2,39 %	-	-
Klasse K Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	2,38 %	1,74 %	-
Klasse K Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	1,75 %	-
Klasse N Thes. (in GBP abgesichert)	1,43 %	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-	-	-	1,29 %	-
Klasse R Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	1,30 %	-
Klasse R Thes. (in USD abgesichert)	-	-	-	-	-	-	-	-	1,32 %	-
Klasse X Thes.	-	-	-	1,60 %	-	-	1,53 %	-	-	-
Klasse X Thes. (in EUR abgesichert)	-	-	-	-	0,78 %	-	1,63 %	-	-	-

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

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Die Teilfonds gehen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte ein (Securities Financing Transactions, SFT) (gemäß Definition in Artikel 3 der EU-Verordnung 2015/2365; hiernach umfassen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte unter anderem Pensionsgeschäfte, das Ver- oder Entleihen von Wertpapieren oder Rohstoffen, Buy-Sell-Back-Geschäfte oder Sell-Buy-Back-Geschäfte sowie Lombardgeschäfte). Gemäß Artikel 13 der Verordnung ist die Beteiligung der Teilfonds in Verbindung mit ihrem Engagement in Total Return Swaps für den Berichtszeitraum zum 31. März 2021 nachfolgend detailliert aufgeführt:

Schroder GAIA Egerton Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte - Long-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
44.370.223	4,39 %
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen EUR	% des verwalteten Vermögens
34.947.599	3,46 %
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt EUR	% des verwalteten Vermögens
79.317.822	7,85 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2021 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen EUR
Morgan Stanley	38.904.324
J.P. Morgan	24.667.613
Goldman Sachs	13.417.751
Merrill Lynch	2.328.134
	79.317.822

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert EUR
Barmittel	13.530.443
	13.530.443

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Laufzeit	Marktwert EUR
weniger als 1 Tag	13.530.443
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	13.530.443

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert EUR
EUR	13.530.443
	13.530.443

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Laufzeit	Long-Positionen EUR	Short-Positionen EUR	Summe EUR
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	417.699	417.699
3 bis 12 Monate	41.169.027	10.655.724	51.824.751
mehr als 1 Jahr	3.201.196	23.874.176	27.075.372
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	44.370.223	34.947.599	79.317.822

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert EUR
Morgan Stanley	13.530.443
	13.530.443

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert EUR
Getrennt	59.489.090
Gepoolt	-
Sonstige	-
	59.489.090

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

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2021 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite EUR*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettoverlust	87,05 %	106.006.687
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	12,95 %	15.765.553
	100,00 %	121.772.240

* Absolut ausgedrückt.

Die oben angegebene Rendite auf Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung unter „Nettozinsen auf Swaps“ angegeben.

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Helix

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte - Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
–	–
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
22.705.790	4,59 %
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
22.705.790	4,59 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2021 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Goldman Sachs	16.816.469
J.P. Morgan	5.889.321
	22.705.790

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	14.240.000
	14.240.000

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Laufzeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	14.240.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	14.240.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	14.240.000
	14.240.000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Laufzeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	497.287	497.287
3 bis 12 Monate	-	22.208.503	22.208.503
mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	-	22.705.790	22.705.790

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Goldman Sachs	11.600.000
J.P. Morgan	2.640.000
	14.240.000

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Gestellte Sicherheiten

Zum 31. März 2021 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

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

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2021 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettoverlust	96,66 %	108.822.802
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	3,34 %	3.755.966
	100,00 %	112.578.768

* Absolut ausgedrückt.

Die oben angegebene Rendite auf Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung unter „Nettozinsen auf Swaps“ angegeben.

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Sirios US Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
3.572.180	0,90 %
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
11.537.308	2,89 %
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
15.109.488	3,79 %

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2021 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	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

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	320.000
	320.000

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Laufzeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	320.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	320.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	320.000
	320.000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Laufzeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	142.678	142.678
1 bis 3 Monate	-	5.377.900	5.377.900
3 bis 12 Monate	517.675	3.750.593	4.268.268
mehr als 1 Jahr	3.054.505	2.266.137	5.320.642
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	3.572.180	11.537.308	15.109.488

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	320.000
	320.000

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	2.550.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	2.550.000

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

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

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2021 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	-	-
Realisierter Nettoverlust	84,90 %	48.715.545
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	15,10 %	8.662.289
	100,00 %	57.377.834

* Absolut ausgedrückt.

Die oben angegebene Rendite auf Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung unter „Nettozinsen auf Swaps“ angegeben.

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte - Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
18.587.592	1,73 %
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
-	-
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
18.587.592	1,73 %

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2021 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	18.587.592
	18.587.592

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	14.300.000
	14.300.000

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Laufzeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	14.300.000
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	14.300.000

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	14.300.000
	14.300.000

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Laufzeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	18.587.592	-	18.587.592
mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	18.587.592	-	18.587.592

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
Morgan Stanley	USA

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	14.300.000
	14.300.000

Gestellte Sicherheiten

Zum 31. März 2021 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps gestellt worden.

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

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

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2021 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	-	-
Realisierter Nettoverlust	83,66 %	114.900.932
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses	16,34 %	22.434.784
	100,00 %	137.335.716

* Absolut ausgedrückt.

Die oben angegebene Rendite auf Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung unter „Nettozinsen auf Swaps“ angegeben.

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
6.568.173	1,37 %
Höhe der Vermögenswerte - Short-Positionen USD	% des verwalteten Vermögens
7.781.085	1,62 %
Höhe der Vermögenswerte - insgesamt USD	% des verwalteten Vermögens
14.349.258	2,99 %

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2021 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn größten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
J.P. Morgan	5.837.555
Goldman Sachs	4.357.937
Morgan Stanley	4.153.766
	14.349.258

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

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

Art	Marktwert USD
Barmittel	3.015.562
	3.015.562

Fälligkeitsprofil von Sicherheiten

Laufzeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	3.015.562
1 bis 7 Tage	-
1 bis 4 Wochen	-
1 bis 3 Monate	-
3 bis 12 Monate	-
mehr als 1 Jahr	-
Unbegrenzte Laufzeit	-
	3.015.562

Währung von Sicherheiten

Währung	Marktwert USD
USD	3.015.562
	3.015.562

Fälligkeitsprofil von Total Return Swaps

Laufzeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	68.160	68.160
1 bis 7 Tage	-	2.553	2.553
1 bis 4 Wochen	-	970	970
1 bis 3 Monate	371.364	547.674	919.038
3 bis 12 Monate	19.997	77.684	97.681
mehr als 1 Jahr	6.176.812	7.084.044	13.260.856
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	6.568.173	7.781.085	14.349.258

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
J.P. Morgan	1.595.000
Morgan Stanley	964.000
Goldman Sachs	456.562
	3.015.562

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	189.000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	189.000

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

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

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2021 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite USD*
Nettozinsen auf Swaps	-	-
Realisierter Nettoverlust	92,43 %	28.488.617
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	7,57 %	2.331.790
	100,00 %	30.820.407

* Absolut ausgedrückt.

Die oben angegebene Rendite auf Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung unter „Nettozinsen auf Swaps“ angegeben.

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.



EST. 1804

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

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

GAIA 31. März 2021 DEDE