



Schroder GAIA

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Halbjahresbericht

31. März 2023

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

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

Inhalt

Schroder GAIA	5
Zusätzliche Informationen für Investoren in der Schweiz	6
Verwaltungsrat	7
Verwaltung	8
Bericht des Verwaltungsrats	9
Bericht des Anlageverwalters	10
Nettovermögensaufstellung	12
Erfolgsrechnung	22
Aufstellung der Veränderung des Nettovermögens	24
Aufteilung der Vermögensinvestitionen nach Branchen	26
Investitionsportfolio	30
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *	30
Schroder GAIA BlueTrend	31
Schroder GAIA Cat Bond	32
Schroder GAIA Contour Tech Equity	37
Schroder GAIA Egerton Equity	38
Schroder GAIA Helix	39
Schroder GAIA Oaktree Credit	43
Schroder GAIA Sirios US Equity	50
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *	51
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	52
Schroder GAIA Wellington Pagosa	53
Anmerkungen zum Finanzbericht	62
Gesamtkostenquote («TER»)	139
Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte	141
Anhang II – Wertentwicklung der Fonds	152

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors 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 2022 bis zum 31. März 2023. Der Finanzbericht wurde im Einklang mit den Luxemburger Verordnungen in Bezug auf Organismen für gemeinsame Investitionen erstellt. Der letzte Termin, an dem die Anteilsurse berechnet wurden, war der 31. März 2023, der letzte Arbeitstag im Berichtszeitraum. Zum Zeitpunkt dieses Berichts stehen elf Teilfonds innerhalb der Gesellschaft für Investitionen zur Verfügung (die «Teilfonds»).

Die Investitionsziele der Teilfonds sowie Einzelheiten zu Investitionsbeschränkungen finden Sie im aktuellen Verkaufsprospekt. Den Bericht des Anlageverwalters für den jeweiligen Teilfonds finden Sie in den vierteljährlichen Investitionsberichten, 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: 4R1MT7.00000.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 Fondsverbands (Association of the Luxembourg Fund Industry, «ALFI») veröffentlichten Verhaltenskodex für luxemburgische Investmentfonds, dessen Grundsätze die Gesellschaft freiwillig übernommen hat.

Interne Kontroll- und Risikomanagementsysteme

Das Board of Directors 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.

Das Board of Directors 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 Board of Directors 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 Finanzberichte müssen von unabhängigen Abschlussprüfern geprüft werden, die dem Board of Directors ihre Feststellungen melden.

Das Board of Directors 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 Schweiz

Schweizer Vertreter:

Schroder Investment Management (Switzerland) AG
Central 2
CH-8001 Zürich
Schweiz

Schweizer Zahlstelle:

Schroder & Co Bank AG
Central 2
CH-8001 Zürich
Schweiz

Ort, an dem die relevanten Dokumente erhältlich sind

Der Prospekt für die Schweiz, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung der Gesellschaft, die Jahres- und Halbjahresberichte sowie die Liste der Käufe und Verkäufe während des Berichtszeitraums sind kostenlos beim Schweizer Vertreter erhältlich.

Verwaltungsrat

Vorsitzender des Board of Directors

- **Eric Bertrand**

Non-Executive Director

Vaults 13-16
Valletta Waterfront
1914 FRN
Malta

Weitere Mitglieder

- **Carla Bergareche Garcia-Minaur**

Head of Iberian Business

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

- **Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini**

Independent Director

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

- **Bernard Herman**

Independent Director

BH Consulting S.à.r.l.
26 rue Glesener
L-1630 Luxembourg
Grossherzogtum Luxemburg

- **Hugh Mullan**

Independent Director

5, rue Höhenhof
L-1736 Senningerberg
Grossherzogtum Luxemburg

- **Alexander Prawitz**

Country Head Germany, Austria & CEEMED

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

- **Neil Walton**

Head of OCIO and Client Specialist Solutions

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

Verwaltung

Eingetragener Sitz

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg
Grossherzogtum Luxemburg

Verwaltungsgesellschaft, Registerführer und Domizilierungsstelle

Schroder Investment Management (Europe) S.A.

5, rue Höhenhof, L-1736 Senningerberg
Grossherzogtum Luxemburg

Hauptbuchstelle, Registerführer und Transferstelle

HSBC Continental Europe, Luxembourg¹

18, Boulevard de Kockelscheuer, L-1821 Luxembourg
Grossherzogtum Luxemburg

Verwahrstelle und Verwaltungsstelle

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

80, route d'Esch, 1470 Luxembourg
Grossherzogtum Luxemburg

Leitender Rechtsberater

Arendt & Medernach S.A.

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

Unabhängiger Wirtschaftsprüfer

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative

2, rue Gerhard Mercator, 2182 Luxembourg
Grossherzogtum Luxemburg

Anlageverwalter

Contour Asset Management, LLC

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

Egerton Capital (UK) LLP

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

Egerton Capital (UK) LLP hat den folgenden Sub-Anlageverwalter für Schroder GAIA Egerton Equity bestellt:

- Egerton Capital (US), LP.

Oaktree Capital Management, L.P.

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

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

- Oaktree Capital Management (UK) LLP

Schroder Investment Management Limited

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

Schroder Investment Management Limited hat den folgenden Sub-Anlageverwalter für Schroder GAIA Helix bestellt:

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

Schroder Investment Management (Singapore) Ltd

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

Schroder Investment Management (Switzerland) AG

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

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 Sub-Anlageverwalter für Schroder GAIA BlueTrend bestellt:

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

Tellworth Investments LLP²

Eagle House, 3rd Floor, 108-110 Jermyn Street, London, SW1Y 6EE,
Vereinigtes Königreich
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *

Two Sigma Advisers LP

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

Wellington Management International Limited

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

Wellington Management International Limited hat den folgenden Sub-Anlageverwalter für Schroder GAIA Wellington Pagosa bestellt:

- Wellington Management Company LLP.

*Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

¹ Am 1. November 2022 hat sich die Adresse von HSBC Continental Europe, Luxembourg, zu «18 Boulevard de Kockelscheuer, L-1821 Luxembourg, Grand Duchy of Luxembourg» geändert.

² Der Anlageverwalter für Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * und ein Sub-Anlageverwalter für Schroder GAIA Helix wurden mit Wirkung zum 5. Dezember 2022 von «BennBridge Ltd» an «Tellworth Investments LLP» übergeben.

Bericht des Verwaltungsrats

Einleitung

Die Direktoren der Gesellschaft legen hiermit ihren Bericht und den Finanzbericht für den Zeitraum bis 31. März 2023 vor.

Aktivitäten während des Berichtszeitraums

Zum 31. März 2023 belief sich das Nettovermögen der Gesellschaft insgesamt auf 4 945 980 935 EUR, was im Vergleich zu 5 333 186 258 EUR zum 30. September 2022 einem Rückgang um 7,26% entspricht.

1. Neue Teilfonds

Während des Berichtszeitraums wurde ein neuer Teilfonds für Kapitalinvestitionen innerhalb der Gesellschaft zur Verfügung gestellt:

Teilfonds	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Asian Equity Long Short	USD	21. Dezember 2022

2. Neue Anteilsklassen

Während des Berichtszeitraums wurden die folgenden Anteilsklassen nutzbar gestellt:

Teilfonds und Anteilsklassen	Währung der Anteilsklasse	Basiswährung des Teilfonds	Auflegungsdatum
Schroder GAIA Asian Equity Long Short			
Klasse A Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Klasse C Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Klasse I Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Klasse IZ Thes.	USD	USD	21. Dezember 2022
Schroder GAIA Cat Bond			
Klasse Y2 Thes.	USD	USD	11. November 2022
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	CHF	USD	11. November 2022
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	EUR	USD	11. November 2022
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	GBP	USD	11. November 2022

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

Das Board of Directors

Schroder GAIA
31. März 2023

Bericht des Anlageverwalters

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

Wirtschaftlicher Rückblick

Da die Inflation über dem Ziel blieb, stiegen während des sechsmonatigen Berichtszeitraums die Zinssätze in den entwickelten Märkten. Gegen Ende des Berichtszeitraums kamen jedoch Hoffnungen auf, dass die Zinssätze im Zuge des Abflauens des Inflationsdrucks bereits auf oder nahe an ihrem Höchststand liegen könnten. In den USA ging die Inflationsrate von 7,7% im Oktober 2022 auf 5,0% im März 2023 zurück. Die Kerninflation, in die Preise für Lebensmittel und Energie nicht mit eingehen, fiel jedoch langsamer. Der Kern-PCE(Personal consumption expenditures)-Preisindex in den USA, das von der US-Notenbank bevorzugte Mass zum Messen der Inflation, fiel von 5,1% im Oktober 2022 auf 4,6% im März 2023.

Zudem verstärkten Bedenken über den Zustand des Bankensystems die Hoffnung, dass die Zinssätze ihren Höchststand nahezu erreicht haben könnten. Der Zusammenbruch der US-Regionalbank «Silicon Valley Bank» im März sowie zwei weiterer kleiner US-Banken sorgten an den globalen Märkten für Volatilität. Fallende Einlagen zwangen die Silicon Valley Bank, die Verluste in ihrem Anleiheportfolio zu realisieren. Befürchtungen bezüglich der Liquidität der Bank breiteten sich rapide aus, was dazu führte, dass mehr und mehr Anleger ihre Geldmittel abzogen. Die Nervosität bezüglich der Banken weitete sich auch auf Europa aus. Die Schweizer Behörden vermittelten eilig eine Übereinkunft mit der UBS zur Rettung der in Schieflage geratenen Konkurrentin Credit Suisse, die ebenfalls mit Abflüssen von Einlagen zu kämpfen hatte.

Während des Berichtszeitraums hoben die Zentralbanken der Industrieländer die Zinssätze an. Die sich daraus für den Bankensektor ergebenden Belastungen führten zu keinem Ende dieser Erhöhungen. Die Federal Funds Rate in den USA lag zu Beginn des Berichtszeitraums bei 3,00–3,25% und wurde im März 2023 auf 4,75–5,00% angehoben. Der Hauptrefinanzierungssatz der Europäischen Zentralbank stieg von 1,25% im März 2023 auf 3,50% im September 2022. Die Official Bank Rate der Bank of England lag im März 2023 bei 4,25%, im Gegensatz zu 2,25% im September 2022. Unter den grossen Industrieländern blieb Japan die grosse Ausnahme und nahm keine Erhöhungen der Zinssätze vor. Im Dezember änderte die Bank of Japan (BoJ) jedoch ihre Politik zur Steuerung der Zinsstruktur und weitete die Spanne aus, in der sie die Renditen 10-jähriger Anleihen gehalten hat. Der Berichtszeitraum markierte auch das Ende der Amtszeit von BoJ-Präsident Haruhiko Kuroda, und im April 2023 übernahm Kazuo Ueda das Ruder.

Da in Europa und im Vereinigten Königreich die Inflation trotz rückläufiger Energiepreise anhaltend stark blieb, kam es in diesen Regionen zu Zinsanstiegen. Insbesondere die Erdgaspreise fielen, da die Kombination aus aussergewöhnlich mildem Winterwetter und Massnahmen zur Senkung des Verbrauchs die Ängste vor Erdgasengpässen linderte. Sinkende Erdgaspreise führten zudem zu einer über den Befürchtungen liegenden Wirtschaftsaktivität, und in beiden Regionen konnte eine Rezession über die Wintermonate abgewendet werden.

In China war das wichtigste politische Ereignis im Berichtszeitraum die Aufhebung der Null-Covid-Politik Mitte Dezember. Dies stellte einen raschen Politikwechsel dar, der die Wiedereröffnung der Binnenwirtschaft sowie die Aufhebung der Reisebeschränkungen befeuerte. Nach der Aufhebung der Beschränkungen erholte sich die Wirtschaft Chinas mit einem BIP-Wachstum von 2,2% im 1. Quartal 2023 gegenüber dem vorhergehenden 4. Quartal 2022 mit einem Wachstum von 0,6%.

Überblick zur Entwicklung am Aktienmarkt

Aktien legten im Verlauf des sechsmonatigen Berichtszeitraums stark zu. Der MSCI World Index kam auf 18,3%, da die Anleger der Ansicht waren, dass die grossen Industrieländer eine tiefe Rezession vermeiden und die Zinssätze bald ihren Höhepunkt erreichen könnten. In den Equity Styles dominierte das Wachstum den Substanzwert, wobei der Bankensektor gegen Ende des Berichtszeitraums unter Druck geriet. Unter den globalen Aktiensektoren schnitten IT-Aktien am besten ab, Immobilien hingegen hinkten hinterher.

Der US-amerikanische S&P 500 erzielte eine Rendite von 15,3% (in US-Dollar), wobei der Sektor der Informationstechnologie die höchsten Gewinne verzeichnete. Aktien der Eurozone verzeichneten einen sehr starken Anstieg, und der MSCI EMU-Index stieg um 26,5% (in Euro). Die Gewinne wurden erzielt, als die Anleger nach einer vorsichtigen Zeit nach der Invasion Russlands in die Ukraine im Februar 2022 in die Region zurückkehrten. Zudem wurden die Aktien von sich mildernden Sorgen über mögliche Stromengpässe beflügelt. An der Spitze der Gewinne stand der Sektor der Nicht-Basiskonsumgüter, und Nachrichten aus China über eine Aufhebung der Null-Covid-Politik waren den Luxusgüteraktien und dem IT-Sektor zuträglich. Im Vereinigten Königreich zeichnete sich ein ähnliches Bild, da auch hier Aktien der Nicht-Basiskonsumgüter die Gewinne für den FTSE All-Share Index anführten.

Die Gewinne der Schwellenmärkte waren verhaltener als die der Industrieländer. Der MSCI EM(Emerging Markets)-Index verbuchte eine Steigerung von 14,0% (in US-Dollar). Wie in den Industrieländern auch, verzeichnete der Sektor der Informationstechnologien robuste Renditen, neben den Kommunikationsdiensten. Nach Ländern betrachtet verzeichneten einige der osteuropäischen Märkte die stärksten Gewinne, darunter Polen, die Tschechische Republik und Ungarn. Zu Beginn des Jahres 2022 wurden diese Märkte durch ihre geografische Nähe zum Russland/Ukraine-Krieg sowie aufgrund höherer Erdgaspreise hart getroffen. Das Nachgeben der Erdgaspreise im Verlauf des Winters in Europa wirkte sich daher positiv auf die Stimmung in diesen Volkswirtschaften aus.

Schwächere Rohstoffpreise während des Berichtszeitraums belasteten die Renditen rohstoffexportierender Länder. Zu den Ländern, die negative Renditen verzeichneten, gehörten Brasilien, ebenso Katar, Saudi-Arabien und die Vereinigten Arabischen Emirate. Auch indische Aktien zeigten sich während des Berichtszeitraums schwächer.

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

Gegen Ende des Sechsmonatszeitraums fielen weltweit die Renditen von Staatsanleihen. Der Zusammenbruch der Silicon Valley Bank im März löste eine starke Kurserholung an den Märkten für Staatsanleihen und Bedenken über eine erneute Beschleunigung der Inflation aus.

Innerhalb weniger Tage nach der Marktreaktion auf die Bankenkrise schwenkten die Märkte für Staatsanleihen in einigen Märkten von der Einpreisung von Zinserhöhungen zu einer Einpreisung von beträchtlichen Zinssenkungen um. Unterdessen intervenierte die US-Regierung und führte eine «Ausnahmeregelung aufgrund systemischer Risiken» ein, die den Einlegern den Zugriff auf ihr Geld garantieren und in Panik geratene Kunden beruhigen sollte.

Angesichts der sich verändernden Marktdynamik setzten die Zentralbanken ihre Zinserhöhungen fort, wenngleich einige ihren Standpunkt korrigierten. In den vergangenen sechs Monaten kündigte die US-Notenbank (Fed) vier Zinsanhebungen an, wobei es sich bei der jüngsten Ankündigung um eine relativ moderate Anhebung von 25 Basispunkten in Folge der die Turbulenzen im Bankensektors handelte. Die Bank of England (BoE) stimmte ebenfalls vier Zinserhöhungen zu und folgte damit der Fed; die letzte Erhöhung betrug 25 Basispunkte. Die Europäische Zentralbank (EZB) behielt ihre Haltung bei und nahm ebenfalls vier Zinserhöhungen vor; allerdings betrug die letzte Erhöhung 50 Basispunkte.

Vor diesem Hintergrund zeigten sich die Märkte volatil, wobei erstklassige Anleihen aus den USA und Europa positive Renditen verbuchten, Hochzinsanleihen zeigten sich jedoch negativ, wobei der Bankensektor mit schlechter Performance dominierte. Die Inflation in der Eurozone und in den USA setzte ihren Abwärtstrend fort und ging von ihren Allzeithochs aus dem vergangenen Jahr zurück, blieb jedoch weiterhin hoch.

In den USA fielen die Renditen der 10-jährigen Anleihen von 3,83% auf 3,47%, die der zweijährigen Anleihen von 4,28% auf 4,03%. Die Rendite auf 10-jährige Staatsanleihen Deutschlands stieg von 2,11% auf 2,29%. Die Rendite der 10-jährigen Staatsanleihen des Vereinigten Königreichs gaben von 4,15% auf 3,49% nach, die der zweijährigen Anleihen von 4,92% auf 3,44%.

Aufgrund von veränderten Erwartungen zu Zinserhöhungen wurde der US-Dollar gegenüber dem Euro und dem britischen Pfund schwächer.

Ausblick

Für China hat sich der Ausblick seit der Aufgabe der Null-Covid-Politik deutlich verbessert. Die Aktivitäten normalisieren sich. Die Schroders Economics Group geht davon aus, dass eine Erholung, angetrieben durch den Dienstleistungssektor, eine Steigerung des BIP von 6,2% im Jahr 2023 und von 4,5% im kommenden Jahr hervorbringen könnte.

Die schiere Grösse Chinas wird dazu führen, dass stärkere Aktivitäten automatisch BIP-Steigerungen weltweit ankurbeln werden. Dabei ist jedoch nicht selbstverständlich, dass eine auf Dienstleistungen beruhende Erholung Chinas der übrigen Welt wesentlich zugutekommen wird. Die kleineren Volkswirtschaften Asiens werden von der Wiederbelebung des Tourismus profitieren. Angesichts der zuvor hohen Investitionen und der schwachen Auslandsnachfrage dürfte diese Erholung jedoch kaum einen erneuten Investitionszyklus im verarbeitenden Gewerbe, mit Nachfrage nach Importen aus Europa und der übrigen Welt, zur Folge haben.

Rohstoffexporteure erhalten möglicherweise etwas Rückenwind, sollten die Preise steigen, jedoch kann das Drehbuch diesmal auch etwas anderes vorsehen. Die vom Baugewerbe vorangetriebenen Erholungen früherer Zeiten stützten die Preise für Industriemetalle; eine auf dem Dienstleistungssektor basierende Erholung hingegen könnte den Energiesektor stärken, und das wiederum könnte die Inflation weltweit wieder in die Höhe treiben. Einige Schwellenmärkte würden in diesem Umfeld gedeihen. Die meisten dieser Märkte sehen sich jedoch einer Phase eines schleppenden Wachstums gegenüber, da höhere Zinssätze und eine gedämpfte Auslandsnachfrage zu Buche schlagen.

Bei den Aussichten für die Industrieländer ist die Schroders Economics Group weniger pessimistisch, jedoch eher aufgrund der Binnenmärkte. Zwar leuchten viele rote Warnsignale, jedoch trotz der US-Wirtschaft weiterhin allen Widrigkeiten. Wir sind nach wie vor der Ansicht, dass höhere Zinssätze, die mit 5,25% im zweiten Quartal wohl ihren Höchststand erreichen dürften, zu einer Rezession führen werden. Aber es würde sich wahrscheinlich um eine relativ kurze und flache Rezession handeln. Eine Phase eines Wachstums unter dem Trend sollte zu einem Sinken der Inflation führen, sodass die US-Notenbank Ende 2023 wieder auf Zinssenkungen umschwenken kann.

Die Eurozone wird nach einer gewissen Erholung von der Energiekrise eine Rezession vermeiden können. Die Inflation sollte schneller zurückgehen und damit den Druck auf die Realeinkommen etwas reduzieren. Die Wirtschaft wird wahrscheinlich weitgehend stagnieren, was bedeutet, dass die Europäische Zentralbank die Zinsen zwar kurzfristig etwas weiter anheben könnte, sie im nächsten Jahr jedoch wahrscheinlich ebenfalls senken wird.

Im Gegensatz dazu sieht sich das Vereinigte Königreich nach wie vor einer Rezession gegenüber, da höhere Inflations- und Zinssätze in Kombination mit einer strikten Fiskalpolitik den Ausblick dämpfen. Möglicherweise haben die Zinssätze bereits ihren Höhepunkt erreicht und werden im Jahr 2024 wahrscheinlich sinken.

Die Anlageverwalter

Schroder GAIA

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

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
VERMÖGENSWERTE						
Investitionen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	9 127 068	380 145 809	2 325 167 267	118 409 475	328 960 140	259 396 176
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	460 641	(22 845 815)	(132 480 976)	12 038 774	24 347 675	(3 875 562)
Wertpapiere zum Marktwert	9 587 709	357 299 994	2 192 686 291	130 448 249	353 307 815	255 520 614
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/ (-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	(70 691)	915 421	12 147 339	829 830	2 591 295	2 941 314
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	(863 875)	-	-	-	(2 992 828)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index Swap-Kontrakten	-	867 395	-	-	-	-
aus Cross Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflation Rate Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zinsswap-Kontrakten	-	(9 054 781)	-	-	-	-
aus Total Return Swap-Kontrakten	-	-	-	-	5 795 999	(10 260 677)
aus Differenzkontrakten	(156 159)	(2 988 010)	-	(6 438 410)	-	14 770 375
	(226 850)	(11 123 850)	12 147 339	(5 608 580)	8 387 294	4 458 184
Forderungen aus Verkauf von Wertpapieren	-	278 439	1 117 093	8 805 707	22 679 149	13 293 277
Bankguthaben	909 797	109 421 911	212 002 687	29 183 960	62 920 993	19 104 860
Termineinlagen	-	-	-	-	-	-
Forderung aus Broker-Einschusskonto	-	19 596 693	-	-	-	9 606 906
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	69 379	15 986 749	3 470 000	11 791 780	27 886 506	10 055 788
Forderungen aus Zeichnungen	-	1 148 584	-	167 012	-	336 953
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	-	-	53 599
Dividenden und Zinsforderungen	68 276	688 499	33 087 340	469 689	1 383 222	8 876 815
Erstattungsforderung des Fonds	-	283 309	12 868	-	-	8 894
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	1 910 000	-
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	2 980 000	13 160 000	830 000	-	2 400 000
Sonstige Forderungen	-	1 142 428	-	353 970	-	883 085
SUMME VERMÖGENSWERTE	10 408 311	497 702 756	2 467 683 618	176 441 787	478 474 979	324 598 975
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus Ankauf von Wertpapieren	4 713	50 036 824	18 887 000	1 075 138	19 863 223	20 822 432
Verbindlichkeiten aus Rückgabe von Anteilen	-	1 479 619	-	1 141 194	9 056 283	918 937
Fällige Managementgebühren	6	408 030	1 747 773	192 919	570 393	207 275
Zahlbare Performancegebühren	30	465	123 986	-	-	-
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	16 188	309 847	-	1 125 019	293 187	1 325 555
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	-	-	-	-	-	-
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	-	-	-	-	-	-
Optionen zum Marktwert	-	-	-	665 412	-	-
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	2 980 000	10 580 000	830 000	-	2 400 000
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	2 580 000	-	1 910 000	-
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	3 951	274 650	5 769 606	105 966	1 026 328	120 377
SUMME VERBINDLICHKEITEN	24 888	55 489 435	39 688 365	5 135 648	32 719 414	25 794 576
SUMME NETTOVERMÖGEN	10 383 423	442 213 321	2 427 995 253	171 306 139	445 755 565	298 804 399

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe ** EUR
VERMÖGENSWERTE						
Investitionen						
Wertpapiere zu Anschaffungskosten	64 226 749	174 059 813	32 347 143	54 430 120	526 979 837	3 972 893 551
Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)	(3 169 079)	10 881 777	(1 154 514)	26 099	9 231 237	(96 590 189)
Wertpapiere zum Marktwert	61 057 670	184 941 590	31 192 629	54 456 219	536 211 074	3 876 303 362
Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust)						
aus Devisenterminkontrakten	202 440	53 124	4 865	1 605 153	24 924	19 792 637
aus Kassageschäften	-	-	-	8 932	-	8 236
aus Terminkontrakten	(3 922)	-	-	(1 916 681)	(2 058 377)	(7 225 157)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(416 664)	(384 199)
aus Credit Default Index Swap-Kontrakten	-	-	-	104 968	(424 856)	504 847
aus Cross Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	346 908	319 878
aus Inflation Rate Swap-Kontrakten	-	-	-	-	77 743	71 686
aus Zinsswap-Kontrakten	-	-	-	-	(1 931 885)	(10 130 628)
aus Total Return Swap-Kontrakten	-	3 706 122	-	2 191 713	(4 192 718)	(2 092 945)
aus Differenzkontrakten	-	-	(121 710)	-	-	4 645 140
	198 518	3 759 246	(116 845)	1 994 085	(8 574 925)	5 509 495
Forderungen aus Verkauf von Wertpapieren	8 884	2 724 590	4 631 804	150 085 844	68 548 040	253 730 942
Bankguthaben	2 286 213	8 340 466	1 276 594	89 629 098	53 822 151	548 191 582
Termineinlagen	-	-	-	304 885 000	-	281 129 555
Forderung aus Broker-Einschusskonto	83 591	-	-	25 239 442	31 259 544	79 102 053
Sicherheitenforderung für gestellte Sicherheiten	-	-	1 882 936	17 645 234	60 801 079	140 512 416
Forderungen aus Zeichnungen	55 322	-	-	617 951	2 904 529	4 822 823
Optionen und Swaptions zum Marktwert	-	-	-	-	875 524	856 729
Dividenden und Zinsforderungen	885 291	207 796	298 212	101 648	2 592 917	45 040 341
Erstattungsforderung des Fonds	-	-	-	-	-	281 301
Zu erhaltende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	-	-	-	1 910 000
Zu erhaltende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	140 000	460 000	29 729	2 360 000	3 200 000	23 574 619
Sonstige Forderungen	68 095	192 291	-	1 452 751	1 676 009	5 319 160
SUMME VERMÖGENSWERTE	64 783 584	200 625 979	39 195 059	648 467 272	753 315 942	5 266 284 378
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten aus Ankauf von Wertpapieren	667 855	3 596 670	7 783	75 004 278	57 661 092	229 882 223
Verbindlichkeiten aus Rückgabe von Anteilen	-	1 865 234	7 655 501	2 715 635	16 013 462	40 017 931
Fällige Managementgebühren	22 628	262 435	24 892	754 131	710 958	4 569 343
Zahlbare Performancegebühren	-	45 422	-	944 756	19 773	1 046 041
Dividenden und Zinsverbindlichkeiten	-	132 483	102 802	1 049 589	2 610 992	6 467 912
Verbindlichkeit aus Broker-Einschusskonto	-	-	56 590	-	-	64 370
Sicherheitenverbindlichkeit für erhaltene Sicherheiten	110 000	4 460 000	-	-	-	4 213 924
Optionen zum Marktwert	-	-	-	-	-	613 566
Zu zahlende Nettosicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	140 000	460 000	19 729	2 360 000	3 200 000	21 184 267
Zu zahlende Sicherheitenforderungen auf Devisenterminkontrakte für Anteilsklassen mit Währungsabsicherung	-	-	10 000	-	-	4 300 351
Sonstige Verbindlichkeiten und Rückstellungen	38 314	117 160	106 283	582 191	358 363	7 943 515
SUMME VERBINDLICHKEITEN	978 797	10 939 404	7 983 580	83 410 580	80 574 640	320 303 443
SUMME NETTOVERMÖGEN	63 804 787	189 686 575	31 211 479	565 056 692	672 741 302	4 945 980 935

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors 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 2023 umgerechnet: 1 Euro = 0,92208 US-Dollar und 1 Euro = 1,13748 Pfund Sterling.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert						
zum 31. März 2023	10 383 423	442 213 321	2 427 995 253	171 306 139	445 755 565	298 804 399
Ausstehende Aktien **						
zum 31. März 2023						
Klasse A Thes.	15	125 257	2 475	153 269	260 140	5 058
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	1 052	-	2 838	-	100
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	461 946	10 966	33 014	-	144 140
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	8 194	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	100	-	-	64
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	5 342	-	140
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	312 450	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	813	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	10 506	20 824	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	90 618	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	15	489 546	6 882	469 914	733 419	11 461
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	304 427	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	20 937	2 539	15 148	-	669
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	369 233	18 142	410 585	-	38 602
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	1 222 946	10 856	183 690	88 938	38 931
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	56 264	-	11
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	140
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	501 147	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	5 419	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	3 210	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	33 215	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	1
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	-	38 787	-	5 210	6	372 369
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	2 509	-	8 803
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	5 000	-	33 663	-	951 405
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	86 455
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	34 498	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	120 008	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	12 698	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 262	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	7 434	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	162	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	256	-	-	-
Klasse I Thes.	100 015	-	185 901	-	-	158 667
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	27 760	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	9	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	120	-	-	103
Klasse IF Thes.	-	-	180 377	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	94 258	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	455 109	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	7 537 346	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	12 095	-	-	-
Klasse IZ Thes.	15	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	92
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

** Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt «Anteilklassen» der Anmerkungen zum Finanzbericht.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Ausstehende Aktien ** (Forts.)						
zum 31. März 2023						
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	273 000	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	100	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	168 972	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	23 103	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	33 739	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	44 813	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	65 583	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-	3 053
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	246
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	25 857
Klasse X Thes.	-	-	-	-	122 230	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	646 429
Klasse Y Thes.	-	-	7 185	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	413	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	10	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	31	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	10	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	10	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	16 904	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	49 230	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	29 765	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	100	-	-	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

** Informationen zu der für die Anteilsklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt «Anteilsklassen» der Anmerkungen zum Finanzbericht.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert					
zum 31. März 2023	63 804 787	189 686 575	31 211 479	565 056 692	672 741 302
Ausstehende Aktien **					
zum 31. März 2023					
Klasse A Thes.	-	576 820	-	-	152 439
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	1 902	-	-	8 138
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	79 282	-	-	218 557
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	16 758
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	15	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	100	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	100	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	15	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	103	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	102	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	103	-	-	-	-
Klasse C Thes.	10 578	323 225	124 284	2 049 636	2 537 978
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	158 010
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	620	14 521	5 611	31 787	88 869
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	107	169 089	24 977	1 052 213	1 317 764
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	100	29 805	-	663 945	1 030 549
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	5 071	-	-
Klasse C Aussch.	15	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	103	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	102	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	103	68	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	39
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	328
Klasse E Thes.	300 579	170	-	-	44 895
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	100	-	-	-	8 332
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	114 909	5 632	-	-	111 748
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	100	-	-	-	58 965
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	16	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	103	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	102	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	17 676	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	200 015	-	15	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	439 980	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

** Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt «Anteilklassen» der Anmerkungen zum Finanzbericht.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Ausstehende Aktien ** (Forts.)					
zum 31. März 2023					
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	790	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	87	69 937	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	77	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	93 212	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	19 087	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	3 819	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	15	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	68	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.
** Informationen zu der für die Anteilklassen verwendeten Namenskonvention finden Sie in Abschnitt «Anteilklassen» der Anmerkungen zum Finanzbericht.

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil **						
zum 31. März 2023						
Klasse A Thes.	102,54	111,84	1 481,61	120,17	199,87	110,56
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	96,11	-	106,41	-	100,82
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	99,39	982,04	109,30	-	102,23
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	190,49	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	905,23	-	-	848,35
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	163,71	-	109,27
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	205,30	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	195,30	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	119,11	186,02	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	196,36	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	102,71	115,72	1 499,74	125,52	217,70	115,27
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	137,44	-	-	-	-
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	-	99,80	1 133,68	112,57	-	105,67
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	-	102,36	1 206,27	113,87	-	106,76
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	-	110,85	106,15	95,65	205,87	111,57
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	950,40	-	864,60
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-	113,63
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	223,85	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	-	216,55	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	212,91	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	-	109,93	-	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-	5 695,00
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Thes.	-	118,85	-	127,29	216,18	118,09
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	113,42	-	107,74
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	-	104,81	-	115,33	-	109,58
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	114,30
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	954,30	-	-
Klasse E Aussch.	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	-	112,89	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	-	1 481,89	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 123,66	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 192,04	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	-	1 102,05	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	-	1 467,21	-	-	-
Klasse I Thes.	103,77	-	1 720,53	-	-	124,80
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 401,33	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 493,23	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	10 600,51	-	-	12 350,94
Klasse IF Thes.	-	-	1 539,15	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 253,25	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 335,11	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	920,56	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	1 312,41	-	-	-
Klasse IZ Thes.	102,77	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	112,01
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

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

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
Nettoinventarwert je Anteil ** (Forts.)						
zum 31. März 2023						
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	101,56	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	113,79	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	787,66	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	992,63	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 002,30	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	1 006,38	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	100,28	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-	114,43
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	105,59
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-	110,21
Klasse X Thes.	-	-	-	-	216,71	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	109,25
Klasse Y Thes.	-	-	1 019,04	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	989,31	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	998,85	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	1 016,40	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	986,34	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	995,79	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	1 063,98	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	1 046,84	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	1 052,82	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	105,97	-	-	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

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

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil **					
zum 31. März 2023					
Klasse A Thes.	-	155,04	-	-	114,27
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	-	177,15	-	-	101,73
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	-	134,29	-	-	103,51
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	156,69
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	96,22	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	91,73	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	92,54	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch.	96,78	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	93,87	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	100,42	-	-	-	-
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	95,87	-	-	-	-
Klasse C Thes.	96,77	163,48	113,05	129,15	117,80
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	-	-	-	-	147,30
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	92,56	185,43	138,04	112,39	105,18
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	93,41	141,94	124,59	115,70	106,75
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	95,65	150,63	-	122,75	89,91
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	151,85	-	-
Klasse C Aussch.	96,79	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	93,87	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	100,45	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	95,89	150,56	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	5 247,34
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	5 355,68
Klasse E Thes.	96,90	175,67	-	-	121,34
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	92,83	-	-	-	108,01
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	93,71	152,93	-	-	109,82
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	95,92	-	-	-	92,49
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch.	96,79	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	93,87	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	100,45	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	95,92	-	-	-	-
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.	98,31	-	122,51	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes.	-	-	-	-	-
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	125,67	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	108,96	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	120,87	112,02	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

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

Nettovermögensaufstellung zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD
Nettoinventarwert je Anteil ** (Forts.)					
zum 31. März 2023					
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	147,77	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	112,99	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	124,71	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	151,81	-	-
Klasse S Aussch.	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse X Thes.	-	108,42	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	150,38	-	-	-
Klasse Y Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes.	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	-

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.
** Der Nettoinventarwert je Anteil jeder Anteilsklasse wird in der Währung der Anteilsklasse ausgewiesen.

Erfolgsrechnung für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
ERTRÄGE						
Nettodividenden [^]	61 675	-	-	-	1 000 021	6 386 800
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	-	638 982	49 427 535	-	-	350 306
Nettoertrag aus Swaps	18 248	2 005 514	-	1 603 070	1 053 543	456 215
Bankzinsen	182	1 143 879	2 725 015	531 224	335 393	714 716
Sonstige Erträge	-	-	-	-	269	16 366
Erträge insgesamt	80 105	3 788 375	52 152 550	2 134 294	2 389 226	7 924 403
AUFWAND						
Performancegebühren	30	465	123 986	-	-	-
Managementgebühren	18	2 380 733	9 753 929	1 140 423	3 840 510	1 221 759
Nettodividendenaufwand [^]	-	-	26 747	616 741	-	-
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	-	-	-	-
Verwahrstellengebühren	1 697	130 601	286 455	22 368	69 824	50 842
Verwaltungsgebühren	2 397	680 829	1 669 177	267 089	818 046	223 066
Taxe d'abonnement	507	111 600	142 517	41 994	114 725	57 986
Vertriebsgebühren	-	-	-	4 307	51 710	-
Bank- und Zinskosten	-	27 622	30 880	604	2 315	3 471
Sonstige Aufwendungen	668	133 843	368 903	44 976	423 461	104 743
Aufwendungen insgesamt	5 317	3 465 693	12 402 594	2 138 502	5 320 591	1 661 867
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	(109 706)	(12 868)	-	-	(2 329)
NETTOINVESTITIONSERTRAG/(-VERLUST)	74 788	432 388	39 762 824	(4 208)	(2 931 365)	6 264 865

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.
[^] Einschliesslich erhaltene/gezahlte Dividenden im Zusammenhang mit Derivaten mit zugrunde liegenden Anteilswerten.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Erfolgsrechnung für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe ** EUR
ERTRÄGE						
Nettodividenden ^	17 014	254 011	160 770	84 434	-	7 456 692
Zinsen aus festverzinslichen Anlagen	1 933 002	218 668	58 077	5 957 858	1 314 389	55 244 246
Nettoertrag aus Swaps	-	507 028	-	-	-	5 285 977
Bankzinsen	32 738	138 384	30 361	4 124 437	1 224 162	10 176 048
Sonstige Erträge	629	271	-	-	-	16 190
Erträge insgesamt	1 983 383	1 118 362	249 208	10 166 729	2 538 551	78 179 153
AUFWAND						
Performancegebühren	-	45 422	-	944 756	19 773	1 046 041
Managementgebühren	138 318	1 586 359	151 328	4 399 271	4 019 153	26 732 757
Nettodividendenaufwand ^	-	-	-	-	201 719	779 352
Nettoaufwand aus Swaps	-	-	35 019	12 296 561	1 178 946	12 465 382
Verwahrstellengebühren	16 665	27 487	9 667	77 092	137 414	772 956
Verwaltungsgebühren	46 021	301 941	53 417	919 257	990 306	5 581 511
Taxe d'abonnement	11 563	48 060	9 129	144 068	159 788	787 242
Vertriebsgebühren	-	-	-	-	-	55 681
Bank- und Zinskosten	40 315	102	-	-	36 972	131 375
Sonstige Aufwendungen	11 570	44 291	9 882	148 822	166 696	1 379 388
Aufwendungen insgesamt	264 452	2 053 662	268 442	18 929 827	6 910 767	49 731 685
Abzüglich: Kostenzuschüsse	-	-	-	-	-	(115 171)
NETTOINVESTITIONSERTRAG/(-VERLUST)	1 718 931	(935 300)	(19 234)	(8 763 098)	(4 372 216)	28 562 639

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors 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 2023 umgerechnet: 1 Euro = 0,92208 US-Dollar und 1 Euro = 1,13748 Pfund Sterling.

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

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * USD	Schroder GAIA BlueTrend USD	Schroder GAIA Cat Bond USD	Schroder GAIA Contour Tech Equity USD	Schroder GAIA Egerton Equity EUR	Schroder GAIA Helix USD
NETTOINVESTITIONSERTRAG/(-VERLUST) **	74 788	432 388	39 762 824	(4 208)	(2 931 365)	6 264 865
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	66 001	(306 742)	(9 554 803)	(18 825 442)	13 232 388	(8 996 649)
aus Devisenterminkontrakten	58 451	35 546 772	90 661 698	6 636 195	15 435 877	29 019 578
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	(38 752 149)	430	-	476 064	(5 245 758)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index Swap-Kontrakten	-	(4 937 278)	-	-	-	-
aus Cross Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflation Rate Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zinsswap-Kontrakten	-	7 247 699	-	-	-	-
aus Total Return Swap-Kontrakten	-	-	-	-	20 267 606	(42 031 176)
aus Differenzkontrakten	(61 614)	-	-	14 161 568	-	32 034 016
aus Versicherungsprämien	-	-	56 942 797	-	-	-
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	1 042 425	-	199 879	-	(1 261 033)
aus Devisengeschäften	5 930	39 892	2 059 264	(31 407)	15 458 747	(7 198 025)
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	68 768	(119 381)	140 109 386	2 140 793	64 870 682	(3 679 047)
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)						
aus Investitionen	460 641	(13 148 471)	138 025 029	46 701 905	(11 379 251)	63 209 861
aus Devisenterminkontrakten	(70 691)	(10 096 684)	4 411 067	638 199	6 771 280	9 944 252
aus Kassageschäften	-	-	-	-	-	-
aus Terminkontrakten	-	(8 176 900)	-	-	(2 219 883)	(16 853 921)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Credit Default Index Swap-Kontrakten	-	(622 518)	-	-	-	-
aus Cross Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Inflation Rate Swap-Kontrakten	-	-	-	-	-	-
aus Zinsswap-Kontrakten	-	(16 755 302)	-	-	-	-
aus Total Return Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(29 754 218)	(45 768 004)
aus Differenzkontrakten	(156 159)	(3 566 721)	-	(22 867 981)	-	44 687 307
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	-	3 883	-	450 359	-	(922 033)
aus Devisengeschäften	76	138 166	15 294	(4 240)	211 482	60 120
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	233 867	(52 224 547)	142 451 390	24 918 242	(36 370 590)	54 357 582
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS GESCHÄFTSBETRIEB	377 423	(51 911 540)	322 323 600	27 054 827	25 568 727	56 943 400
Nettoerlöse aus Ausgabe von Anteilen	10 006 000	207 196 236	390 605 982	12 160 461	23 452 684	56 900 820
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	-	(84 522 541)	(261 221 451)	(87 444 181)	(191 863 618)	(305 403 536)
Ausschüttungen aus Nettoinvestitionserträgen	-	-	(566 589)	-	-	-
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Berichtszeitraums	10 383 423	70 762 155	451 141 542	(48 228 893)	(142 842 207)	(191 559 316)
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	-	371 451 166	1 976 853 711	219 535 032	588 597 772	490 363 715
Nennwährungsanpassung ***	-	-	-	-	-	-
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS	10 383 423	442 213 321	2 427 995 253	171 306 139	445 755 565	298 804 399

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

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

*** Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2022 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 31. März 2023.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023 (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit USD	Schroder GAIA Sirios US Equity USD	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * GBP	Schroder GAIA Two Sigma Diversified USD	Schroder GAIA Wellington Pagosa USD	Summe ** EUR
NETTOINVESTITIONSERTRAG/(-VERLUST) ***	1 718 931	(935 300)	(19 234)	(8 763 098)	(4 372 216)	28 562 639
Realisierter Nettogewinn/(Verlust)						
aus verkauften Wertpapieren	(162 353)	1 114 233	(1 041 837)	43 736	9 646 482	(12 826 392)
aus Devisenterminkontrakten	309 262	2 341 037	(127 461)	18 763 939	27 888 680	210 058 632
aus Kassageschäften	-	-	-	49 078	-	45 254
aus Terminkontrakten	47 390	-	(131 974)	(1 342 213)	(2 891 031)	(44 103 129)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(1 353 739)	(1 248 261)
aus Credit Default Index Swap-Kontrakten	-	-	-	(356 333)	(1 051 327)	(5 850 565)
aus Cross Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(91 775)	(84 624)
aus Inflation Rate Swap-Kontrakten	-	-	-	-	315 445	290 867
aus Zinsswap-Kontrakten	-	-	-	-	(4 995 112)	2 077 074
aus Total Return Swap-Kontrakten	-	621 675	-	46 433 094	9 460 866	33 623 493
aus Differenzkontrakten	-	-	132 499	-	-	42 690 107
aus Versicherungsprämien	-	-	-	-	-	52 506 037
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	(353)	-	-	-	(10 037 788)	(9 273 278)
aus Devisengeschäften	(164 716)	1 621	1 557	65 041	(3 751 075)	7 186 221
Realisierter Nettogewinn/(-verlust)	29 230	4 078 566	(1 167 216)	63 656 342	23 139 626	275 091 436
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlustes)						
aus Investitionen	4 208 656	20 151 028	1 688 757	76 618	30 920 222	258 504 329
aus Devisenterminkontrakten	(864 704)	(641 601)	(85 514)	(397 065)	(5 098 113)	4 668 163
aus Kassageschäften	-	-	-	(3 500)	-	(3 227)
aus Terminkontrakten	(47 095)	-	(138 600)	(5 653 663)	(1 456 637)	(32 057 774)
aus Credit Default Swap-Kontrakten	-	-	-	-	(1 839 310)	(1 695 998)
aus Credit Default Index Swap-Kontrakten	-	-	-	(431 139)	(673 551)	(1 592 631)
aus Cross Currency Swap-Kontrakten	-	-	-	-	352 876	325 381
aus Inflation Rate Swap-Kontrakten	-	-	-	-	67 966	62 670
aus Zinsswap-Kontrakten	-	-	-	-	(623 388)	(16 024 610)
aus Total Return Swap-Kontrakten	-	(3 989 459)	-	(15 826 084)	(16 718 880)	(105 643 962)
aus Differenzkontrakten	-	-	(384 963)	-	-	16 248 553
aus Optionen und Swaptions-Kontrakten	(422)	-	-	-	(593 627)	(979 106)
aus Devisengeschäften	37 809	10 031	(2 869)	143 068	3 896 820	4 170 546
NETTOVERÄNDERUNG DES NICHT REALISIERTEN WERTZUWACHSES/(WERTVERLUSTES)	3 334 244	15 529 999	1 076 811	(22 091 765)	8 234 378	125 982 334
NETTOVERÄNDERUNGEN DES GESAMTEN NETTOVERMÖGENS AUS DEM GESCHÄFTSBETRIEB	5 082 405	18 673 265	(109 639)	32 801 479	27 001 788	429 636 409
Nettoerlöse aus Ausgabe von Anteilen	19 146 603	20 784 681	1 023 372	78 087 392	156 425 938	901 808 195
Zahlungen für zurückgenommene Anteile	(7 909 236)	(38 240 437)	(10 327 523)	(240 678 194)	(126 224 997)	(1 265 523 937)
Ausschüttungen aus Nettoinvestitionserträgen	(31 398)	-	-	-	-	(551 394)
Zuwachs/(Abnahme) des Nettovermögens während des Berichtszeitraums	16 288 374	1 217 509	(9 413 790)	(129 789 323)	57 202 729	65 369 273
Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums	47 516 413	188 469 066	40 625 269	694 846 015	615 538 573	5 333 186 258
Nennwährungsanpassung ****	-	-	-	-	-	(452 574 596)
NETTOVERMÖGEN AM ENDE DES BERICHTSZEITRAUMS	63 804 787	189 686 575	31 211 479	565 056 692	672 741 302	4 945 980 935

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors 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 2023 umgerechnet: 1 Euro = 0,92208 US-Dollar und 1 Euro = 1,13748 Pfund Sterling.

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

**** Diese Anpassung entspricht der Differenz zwischen dem Anfangssaldo unter Verwendung des Wechselkurses vom 30. September 2022 und demselben Nettovermögen mit dem Wechselkurs vom 31. März 2023.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Aufteilung der Vermögensinvestitionen nach Branchen

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * %	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	43,16	80,80	87,57	-	-	29,78
Sonstige Wertpapiere						
Werbung	-	-	-	-	-	-
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	-	-	-	2,03	-
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	-	-
Fluggesellschaften	-	-	-	-	-	0,13
Bekleidung	1,57	-	-	-	-	0,33
Automobilhersteller	-	-	-	-	-	0,17
Autoteile und -zubehör	1,99	-	-	-	-	0,86
Banken	2,62	-	-	-	8,10	5,70
Getränke	-	-	-	-	-	0,89
Biotechnologie	-	-	-	-	-	0,11
Baustoffe	-	-	-	-	-	0,11
Chemie	-	-	-	-	0,32	1,99
Gewerbliche Dienstleistungen	3,41	-	-	-	-	0,86
Computer	1,88	-	-	-	-	0,61
Kosmetik und Körperpflege	-	-	-	-	-	-
Vertrieb und Grosshandel	-	-	-	-	-	0,14
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	-	-	-	11,36	1,49
Elektrik	-	-	-	-	-	0,39
Elektrische Bauteile und Geräte	2,04	-	-	-	-	0,99
Elektronik	2,33	-	-	2,67	-	1,82
Energie – Alternative Energieträger	-	-	-	-	-	1,24
Bau- und Ingenieurwesen	-	-	-	-	-	-
Unterhaltung	-	-	-	2,06	-	-
Umweltschutz	-	-	-	-	-	-
Lebensmittel	-	-	-	-	-	1,87
Gas	-	-	-	-	-	-
Hand- und Maschinenwerkzeuge	-	-	-	-	-	-
Gesundheitswesen – Produkte	-	-	-	-	0,46	0,59
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	-	-	-	0,32	-
Holdinggesellschaften – Diversifiziert	-	-	-	-	-	-
Wohngebäude-Bausträger	-	-	-	-	-	-
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	-	1,02
Haushaltswaren	1,45	-	-	-	-	0,30
Versicherungen	1,82	-	2,74	-	6,86	1,35
Internet	-	-	-	29,12	6,58	0,49
Investmentgesellschaften	-	-	-	-	1,45	5,54
Eisen und Stahl	-	-	-	-	-	-
Freizeit	1,23	-	-	-	-	0,24
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	-	0,11
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	-	0,44
Maschinen – Diversifiziert	-	-	-	-	-	0,45
Medien	-	-	-	12,99	-	-
Metallprodukte und Eisenwaren	1,66	-	-	-	0,75	-
Bergbau	-	-	-	-	2,68	2,03
Diverse Fertigungsbetriebe	-	-	-	-	-	-
Öl und Gas	-	-	-	-	3,23	0,83

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Aufteilung der Vermögensinvestitionen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Asian Equity Long Short * %	Schroder GAIA BlueTrend %	Schroder GAIA Cat Bond %	Schroder GAIA Contour Tech Equity %	Schroder GAIA Egerton Equity %	Schroder GAIA Helix %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)						
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	-	-	-	3,70	-
Verpackung und Container	-	-	-	-	-	-
Pharmazeutika	-	-	-	-	1,15	0,69
Pipelines	-	-	-	-	-	-
Immobilien	-	-	-	-	-	1,51
Einzelhandel	1,68	-	-	-	2,07	2,61
Halbleiter	23,13	-	-	9,86	5,43	16,49
Software	-	-	-	19,45	5,86	0,30
Telekommunikation	2,37	-	-	-	-	0,65
Transport	-	-	-	-	16,91	0,39
Investitionsportfolio in Prozent des Nettovermögens	92,34	80,80	90,31	76,15	79,26	85,51
Termineinlagen	-	-	-	-	-	-
Sonstiges Nettovermögen	7,66	19,20	9,69	23,85	20,74	14,49
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Aufteilung der Vermögensinvestitionen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Anleihen, Commercial Paper, ABS- und MBS-Titel	95,69	22,86	91,01	8,75	39,54
Sonstige Wertpapiere					
Werbung	-	-	-	-	0,06
Luft- und Raumfahrt und Verteidigung	-	0,97	-	-	0,15
Agrarwirtschaft	-	-	-	-	0,37
Fluggesellschaften	-	2,39	-	-	-
Bekleidung	-	-	-	-	-
Automobilhersteller	-	2,02	-	-	-
Autoteile und -zubehör	-	-	-	-	0,14
Banken	-	4,84	-	-	6,85
Getränke	-	1,55	-	-	-
Biotechnologie	-	-	-	-	2,39
Baustoffe	-	0,19	-	-	0,51
Chemie	-	2,17	-	-	0,17
Gewerbliche Dienstleistungen	-	5,77	1,25	-	0,78
Computer	-	1,01	-	-	0,07
Kosmetik und Körperpflege	-	-	-	-	0,21
Vertrieb und Grosshandel	-	-	-	-	-
Diversifizierte Finanzdienstleistungen	-	3,64	-	-	2,02
Elektrik	-	0,20	-	-	2,65
Elektrische Bauteile und Geräte	-	-	-	-	0,24
Elektronik	-	1,59	1,61	-	0,39
Energie – Alternative Energieträger	-	-	-	-	0,47
Bau- und Ingenieurwesen	-	-	-	-	0,08
Unterhaltung	-	-	1,17	-	0,01
Umweltschutz	-	1,18	-	-	-
Lebensmittel	-	-	-	-	0,46
Gas	-	-	-	-	0,48
Hand- und Maschinenwerkzeuge	-	-	-	-	0,09
Gesundheitswesen – Produkte	-	12,44	-	-	1,43
Gesundheitswesen – Dienstleistungen	-	0,75	-	-	0,98
Holdinggesellschaften – Diversifiziert	-	-	-	-	0,03
Wohngebäude-Bauträger	-	-	-	-	0,40
Heimeinrichtungsgegenstände	-	-	-	-	0,10
Haushaltswaren	-	-	-	-	-
Versicherungen	-	-	-	-	1,14
Internet	-	0,45	-	-	1,18
Investmentgesellschaften	-	-	-	0,88	1,42
Eisen und Stahl	-	-	-	-	0,03
Freizeit	-	1,53	-	-	-
Beherbergungsunternehmen	-	-	-	-	0,07
Maschinen – Bau und Bergbau	-	-	-	-	0,23
Maschinen – Diversifiziert	-	-	-	-	0,66
Medien	-	-	-	-	0,04
Metallprodukte und Eisenwaren	-	-	-	-	0,05
Bergbau	-	-	-	-	1,04
Diverse Fertigungsbetriebe	-	2,01	-	-	0,39

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Aufteilung der Vermögensinvestitionen nach Branchen (Forts.)

	Schroder GAIA Oaktree Credit %	Schroder GAIA Sirios US Equity %	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * %	Schroder GAIA Two Sigma Diversified %	Schroder GAIA Wellington Pagosa %
Sonstige Wertpapiere (Forts.)					
Öl und Gas	-	2,86	-	-	5,85
Öl- und Erdgasdienstleistungen	-	1,43	-	-	0,54
Verpackung und Container	-	0,61	-	-	-
Pharmazeutika	-	2,89	-	-	2,28
Pipelines	-	-	-	-	0,50
Immobilien	-	-	2,59	-	0,17
Einzelhandel	-	1,11	0,24	-	0,51
Halbleiter	-	5,04	-	-	1,19
Software	-	14,16	2,07	-	0,91
Telekommunikation	-	-	-	-	0,28
Transport	-	1,84	-	-	0,16
Investitionsportfolio in Prozent des Nettovermögens	95,69	97,50	99,94	9,63	79,71
Termineinlagen	-	-	-	53,96	-
Sonstiges Nettovermögen	4,31	2,50	0,06	36,41	20,29
Summe Nettovermögen	100,00	100,00	100,00	100,00	100,00

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023

Schroder GAIA Asian Equity Long Short *

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Aktien				
China				
3 500	CNH	Contemporary Amperex Technology	206 775	1,99
45 900	CNH	Zhejiang Sanhua Intelligent Controls	171 965	1,66
Indonesien				
234 000	IDR	Bank Mandiri Persero	161 129	1,55
Philippinen				
56 300	PHP	International Container Terminal Services	220 996	2,13
316 800	PHP	Wilcon Depot	174 818	1,68
Südkorea				
878	KRW	L&F	211 432	2,04
18 106	KRW	Samsung Electronics	890 106	8,56
1 191	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	188 460	1,82
436	KRW	Samsung SDI	246 157	2,37
Taiwan				
16 000	TWD	Advantech	194 959	1,88
67 000	TWD	ASE Technology Holding	247 556	2,38
22 000	TWD	Chroma ATE	128 254	1,24
10 000	TWD	Eclat Textile	162 575	1,57
9 000	TWD	MediaTek	232 630	2,24
23 000	TWD	Merida Industry	127 285	1,23
14 000	TWD	Nien Made Enterprise	150 357	1,45
15 000	TWD	Sporton International	133 016	1,28
59 000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	1 032 826	9,95
2 000	TWD	Voltronic Power Technology	113 638	1,09
Thailand				
28 700	THB	Kasikornbank	111 208	1,07
Summe Aktien			5 106 142	49,18
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			5 106 142	49,18

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
USA				
500 000	USD	United States Treasury Bill 06/04/23, ZCP	499 689	4,82
500 000	USD	United States Treasury Bill 13/04/23, ZCP	499 255	4,81
500 000	USD	United States Treasury Bill 20/04/23, ZCP	498 783	4,80
500 000	USD	United States Treasury Bill 27/04/23, ZCP	498 353	4,80
500 000	USD	United States Treasury Bill 04/05/23, ZCP	497 885	4,79
500 000	USD	United States Treasury Bill 11/05/23, ZCP	497 399	4,79
500 000	USD	United States Treasury Bill 18/05/23, ZCP	497 013	4,79
500 000	USD	United States Treasury Bill 25/05/23, ZCP	496 753	4,78
500 000	USD	United States Treasury Bill 01/06/23, ZCP	496 437	4,78
Summe Anleihen			4 481 567	43,16
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			4 481 567	43,16
Summe Kapitalinvestitionen			9 587 709	92,34
Sonstiges Nettovermögen			795 714	7,66
Nettoinventarwert			10 383 423	100,00

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA BlueTrend

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
USA				
39 500 000	USD	United States Treasury Note 15/04/23, 0.25%	39 443 267	8,92
41 000 000	USD	United States Treasury Note 15/05/23, 0.13%	40 781 396	9,22
42 000 000	USD	United States Treasury Note 15/06/23, 0.25%	41 625 681	9,41
30 500 000	USD	United States Treasury Note 15/07/23, 0.13%	30 096 536	6,81
30 500 000	USD	United States Treasury Note 15/08/23, 0.13%	29 977 518	6,78
32 000 000	USD	United States Treasury Note 15/09/23, 0.13%	31 349 438	7,09
33 000 000	USD	United States Treasury Note 15/10/23, 0.13%	32 195 174	7,28
10 000 000	USD	United States Treasury Note 15/11/23, 0.25%	9 726 074	2,20
14 500 000	USD	United States Treasury Note 15/12/23, 0.13%	14 045 090	3,18
15 000 000	USD	United States Treasury Note 15/01/24, 0.13%	14 472 039	3,27
10 500 000	USD	United States Treasury Note 15/02/24, 0.13%	10 090 272	2,28
14 500 000	USD	United States Treasury Note 15/03/24, 0.25%	13 910 449	3,15
10 000 000	USD	United States Treasury Note 15/04/24, 0.38%	9 572 358	2,16
12 500 000	USD	United States Treasury Note 15/05/24, 0.25%	11 924 072	2,70
Summe Anleihen			329 209 364	74,45
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			329 209 364	74,45

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
Irland				
608 022 303	USD	Star Compass Public 10/12/25, ZCP	28 090 630	6,35
Summe Anleihen			28 090 630	6,35
Summe sonstige Wertpapiere			28 090 630	6,35
Summe Kapitalinvestitionen			357 299 994	80,80
Sonstiges Nettovermögen			84 913 327	19,20
Nettoinventarwert			442 213 321	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag			Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag			Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen	
Währung						Währung						
Aktien						4 750 000	USD	Kilimanjaro III Re Series C1 21/04/25, variabel	4 276 069	0,18		
Bermuda						7 032 033				0,29		
697	USD	Voussoir Re	7 032 033		0,29	10 464 000	USD	Kilimanjaro III Re Series A2 20/04/26, variabel	8 268 914	0,34		
Supranational						59 500 143				2,45		
550	USD	Voussoir Re SideCar	3 388 000		0,14	8 500 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B2 20/04/26, variabel	7 303 838	0,30		
697	USD	Voussoir Re SideCar- Preference	243 253		0,01	4 100 000	USD	Kilimanjaro III Re Series C2 20/04/26, variabel	3 543 118	0,15		
530	USD	Voussoir Re SideCar- Preference	55 868 890		2,30	6 000 000	USD	Kilimanjaro Re Series A2 05/05/23, variabel	6 034 500	0,25		
Summe Aktien						66 532 176				2,74		
Anleihen						921 740	USD	Manatee Re III 08/06/26, variabel	184 348	0,01		
Bermuda						594 251 488				24,48		
19 450 000	USD	Acorn Re 07/11/24, variabel	18 610 733		0,77	25 602 000	USD	Merna Reinsurance II 08/07/24, variabel	21 761 699	0,90		
10 263 000	USD	Baldwin Re 07/07/25, variabel	9 670 825		0,40	15 000 000	USD	Merna Reinsurance II 07/04/25, variabel	14 739 000	0,61		
2 667 000	USD	Blue Halo Re Series A 24/02/25, variabel	2 020 253		0,08	11 500 000	USD	Montoya Re 07/04/25, variabel	10 853 125	0,45		
3 500 000	USD	Blue Halo Re Series B 24/02/25, variabel	2 693 688		0,11	30 000 000	USD	Mystic Re IV 08/01/24, variabel	28 842 749	1,18		
500 000	USD	Bowline Re 23/05/25, variabel	469 300		0,02	5 000 000	USD	Nakama Re 14/01/25, variabel	4 899 625	0,20		
6 750 000	USD	Citrus Re 07/06/25, variabel	6 438 150		0,27	14 880 000	USD	Northshore Re II 07/07/23, variabel	14 788 116	0,61		
1 487 500	USD	Eden Re II 22/03/24, ZCP	235 769		0,01	14 962 000	USD	Northshore Re II 08/01/24, variabel	14 407 284	0,59		
220 000	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	157 058		0,01	8 491 000	USD	Phoenician Re 14/12/23, variabel	8 335 827	0,34		
24 512 000	USD	Everglades Re II Series A1 14/05/24, variabel	22 647 249		0,93	16 000 000	USD	Phoenician Re Series A 14/12/23, variabel	15 708 800	0,65		
28 750 000	USD	Everglades Re II Series A2 14/05/24, variabel	26 515 405		1,09	5 000 000	USD	Power Protective Re 15/12/23, variabel	4 815 625	0,20		
19 250 000	USD	Everglades Re II Series B1 14/05/24, variabel	16 760 013		0,69	2 250 000	USD	Power Protective Re 09/10/24, variabel	2 196 056	0,09		
9 917 000	USD	Four Lakes Re 07/01/25, variabel	9 203 224		0,38	23 000 000	USD	Riverfront Re Series A 07/01/25, variabel	21 450 950	0,88		
24 450 000	USD	Galileo Re Series C 08/01/24, variabel	23 265 397		0,96	5 750 000	USD	Riverfront Re Series B 07/01/25, variabel	4 947 013	0,20		
9 650 000	USD	Galileo Re Series D 08/01/24, variabel	9 280 405		0,38	9 270 000	USD	Sanders Re II 07/06/23, variabel	9 151 112	0,38		
6 400 000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	5 794 560		0,24	9 625 000	USD	Sanders Re II 07/04/24, variabel	9 534 766	0,39		
5 000 000	USD	Integrity Re 12/06/28, variabel	4 612 500		0,19	9 917 000	USD	Sanders Re II Series A 07/04/25, variabel	9 522 799	0,39		
12 000 000	USD	Kilimanjaro III Re Series A1 19/12/23, variabel	9 150 000		0,38	16 447 000	USD	Sanders Re II Series A1 07/04/25, variabel	15 806 389	0,65		
20 250 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/23, variabel	19 605 038		0,81	7 750 000	USD	Sanders Re III Series A 07/06/25, variabel	7 379 356	0,30		
5 250 000	USD	Kilimanjaro III Re Series A 19/12/24, variabel	4 003 125		0,16	8 250 000	USD	Sanders Re III Series B 07/06/25, variabel	7 499 663	0,31		
12 087 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B 19/12/24, variabel	11 500 478		0,47	3 254 964	USD	Sanders Re II 07/04/26, variabel	24 656	-		
4 380 000	USD	Kilimanjaro III Re Series B1 21/04/25, variabel	3 902 580		0,16							

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
11 050 000	USD	Sanders Re III Series A 07/04/26, variabel	10 457 720	0,43
8 750 000	USD	Sanders Re III Series B 07/04/26, variabel	8 317 750	0,34
11 250 000	USD	Sutter Re Series A 23/05/23, variabel	11 270 531	0,46
13 100 000	USD	Sutter Re Series F 23/05/23, variabel	13 134 060	0,54
6 256 000	USD	Tailwind Re Series A 08/01/25, variabel	5 674 036	0,23
13 958 000	USD	Tailwind Re Series B 08/01/25, variabel	12 791 111	0,53
5 152 000	USD	Tailwind Re Series C 08/01/25, variabel	4 622 117	0,19
250 000	USD	Tailwind Re Series D 08/01/25, variabel	225 956	0,01
14 500 000	USD	Titania Re 21/06/24, variabel	13 441 863	0,55
17 107 000	USD	Titania Re 27/12/24, variabel	15 567 798	0,64
5 750 000	USD	Tomoni Re Series A 07/04/26, variabel	5 535 525	0,23
9 475 000	USD	Tomoni Re Series B 07/04/26, variabel	9 138 401	0,38
1 384 000	USD	Voussoir Re 01/03/24, variabel	159 298	0,01
1 460 000	USD	Voussoir Re perpetual, variabel	135 780	0,01
3 500 000	USD	Wrigley Re 08/07/24, variabel	3 353 875	0,14
Irland			22 555 119	0,93
9 856 000	EUR	Azzurro Re II DAC 17/01/24, variabel	10 621 759	0,44
10 966 000	EUR	Hexagon II Reinsurance DAC 17/01/24, variabel	11 933 360	0,49
Singapur			101 500 184	4,18
37 150 000	USD	Alamo Re II 08/06/23, variabel	37 456 488	1,54
10 533 000	USD	Easton Re 08/01/24, variabel	10 295 481	0,42
7 750 000	USD	Integrity Re II 12/04/28, variabel	5 231 250	0,22
6 750 000	USD	Kizuna Re III 07/04/26, variabel	6 358 163	0,26
40 075 000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	37 815 771	1,56
4 012 000	USD	Phoenix 3 Re 04/01/29, ZCP	4 343 031	0,18
Supranational			48 678 750	2,00
18 500 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 29/12/23, variabel	18 079 588	0,74

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Marktwert USD	% Nettovermögen
2 763 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series A 13/03/24, variabel	2 758 441	0,11
5 550 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series B 13/03/24, variabel	5 466 750	0,23
6 700 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series C 13/03/24, variabel	6 391 465	0,26
4 750 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development Series D 13/03/24, variabel	4 676 256	0,19
11 250 000	USD	International Bank for Reconstruction & Development 31/03/26, variabel	11 306 250	0,47
Vereinigtes Königreich			21 137 366	0,87
21 450 000	USD	Atlas Capital UK 2019 07/06/23, variabel	21 137 366	0,87
Summe Anleihen			788 122 907	32,46
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			854 655 083	35,20

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Marktwert USD	% Nettovermögen
Anleihen				
Bermuda			899 511 429	37,05
7 308 000	USD	2001 Cat Re 08/01/24, variabel	6 849 058	0,28
37 059 000	USD	Alamo Re 07/06/24, variabel	36 080 641	1,50
2 450 000	USD	Artex 17/01/25, variabel	2 205 000	0,09
19 855 000	USD	Bonanza Re 20/02/24, variabel	17 188 970	0,71
18 996 000	USD	Bonanza Re 23/12/24, variabel	16 697 009	0,69
12 250 000	USD	Bonanza Re 16/03/25, variabel	10 313 888	0,42
6 750 000	USD	Bonanza Re 08/01/26, variabel	6 755 400	0,28
3 333 000	USD	Bowline Re Series 2022-1 23/05/25, variabel	3 238 259	0,13
24 917 000	USD	Cape Lookout Re 22/03/24, variabel	23 674 265	0,99
10 000 000	USD	Cape Lookout Re 28/03/25, variabel	9 464 250	0,39
10 833 000	USD	Commonwealth Re 08/07/25, variabel	10 480 657	0,43

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
657 278	USD	Eden Re II Series A 21/03/25, ZCP	337 841	0,01	6 000 000	USD	Isosceles Insurance 10/07/23, variabel	5 940 000	0,24
1 348 049	USD	Eden Re II Series B 21/03/25, ZCP	688 853	0,03	3 000 000	USD	Kendall Re 02/05/24, variabel	2 789 850	0,11
3 260 000	USD	Eden Re II 20/03/26, ZCP	2 382 734	0,10	7 857 000	USD	Kilimanjaro III Re 21/04/25, variabel	6 630 719	0,27
1 500 000	USD	Eden Re II Series A 19/03/27, ZCP	1 526 475	0,06	24 844 000	USD	Kilimanjaro III Re 25/06/25, variabel	23 610 495	0,97
10 000 000	USD	Eden Re II Series B 19/03/27, ZCP	10 176 500	0,42	11 406 000	USD	Locke Tavern Re 09/04/26, variabel	11 447 632	0,47
11 000 000	USD	Everglades Re II 04/05/23, variabel	10 557 525	0,43	7 500 000	USD	Matterhorn Re 08/01/24, variabel	6 419 250	0,26
8 750 000	USD	Everglades Re II 19/05/25, variabel	8 275 969	0,34	4 257 000	USD	Matterhorn Re 07/06/24, variabel	4 252 211	0,18
1 250 000	USD	Finca Re 06/06/25, variabel	1 221 750	0,05	9 250 000	USD	Matterhorn Re 24/03/25, variabel	8 205 675	0,34
31 404 000	USD	FloodSmart Re Series A 01/03/24, variabel	29 755 289	1,24	11 500 000	USD	Matterhorn Re Series A 24/03/25, variabel	10 207 113	0,42
5 625 000	USD	FloodSmart Re Series B 01/03/24, variabel	4 964 063	0,20	14 250 000	USD	Matterhorn Re 08/12/25, variabel	11 970 713	0,49
21 020 000	USD	FloodSmart Re Series A 25/02/25, variabel	19 758 800	0,81	7 600 000	USD	Matterhorn Re 25/01/27, variabel	7 609 543	0,31
9 250 000	USD	FloodSmart Re Series B 25/02/25, variabel	8 787 500	0,36	20 144 000	USD	Merna Reinsurance II 05/04/24, variabel	20 128 388	0,83
2 250 000	USD	FloodSmart Re Series C 25/02/25, variabel	2 002 500	0,08	12 000 000	USD	Merna Reinsurance II Series 2 07/07/25, variabel	11 100 000	0,46
975 000	USD	FloodSmart Re Series B 27/02/26, variabel	645 938	0,03	19 000 000	USD	Merna Reinsurance II Series 3 07/07/25, variabel	18 556 825	0,76
17 708 000	USD	FloodSmart Re Series A 11/03/26, variabel	17 710 214	0,73	7 900 000	USD	MetroCat Re 08/05/23, variabel	7 854 773	0,32
4 500 000	USD	FloodSmart Re Series B 11/03/26, variabel	4 500 225	0,19	23 750 000	USD	Mona Lisa Re 08/07/25, variabel	21 329 281	0,88
7 917 000	USD	Four Lakes Re 07/01/26, variabel	7 979 346	0,33	8 250 000	USD	Mona Lisa Re Series A 08/01/26, variabel	8 334 150	0,34
4 242 460	USD	Frontline Re 06/07/26, variabel	3 012 146	0,12	8 171 000	USD	Mona Lisa Re Series B 08/01/26, variabel	8 148 121	0,34
7 000 000	USD	Herbie Re 08/07/24, variabel	6 409 375	0,26	8 462 000	USD	Montoya Re 07/04/26, variabel	8 417 575	0,35
3 833 000	USD	Herbie Re 08/01/25, variabel	3 577 243	0,15	13 250 000	USD	Mystic Re IV 08/01/25, variabel	12 164 494	0,50
1 866 569	USD	Herbie Re 08/01/26, variabel	1 143 273	0,05	14 250 000	USD	Mystic Re IV 08/01/26, variabel	14 478 356	0,60
6 000 000	USD	Herbie Re 08/01/27, variabel	6 056 400	0,25	34 150 000	USD	Nakama Re Series 1 13/04/23, variabel	34 150 853	1,42
9 250 000	USD	Hestia Re 22/04/25, variabel	7 631 250	0,31	12 200 000	USD	Nakama Re Series 2 13/04/23, variabel	12 203 965	0,50
6 864 000	USD	Hypatia Series A 07/06/23, variabel	6 910 504	0,28	10 918 000	USD	Northshore Re II 08/07/25, variabel	10 536 689	0,43
2 379 000	USD	Hypatia Series B 07/06/23, variabel	2 348 251	0,10	7 500 000	USD	Pelican IV Re Series A 07/05/24, variabel	39 938	-
5 758 000	USD	Hypatia 08/04/26, variabel	5 779 017	0,24	4 750 000	USD	Pelican IV Re Series B 07/05/24, variabel	83 481	-
6 750 000	USD	Integrity Re 06/06/25, variabel	6 412 500	0,26	13 000 000	USD	Phoenician Re 14/12/24, variabel	12 332 450	0,51
8 691 000	USD	Integrity Re Series A 06/06/25, variabel	8 711 858	0,36					

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
19 872 000	USD	Sakura Re Series A 07/04/25, variabel	18 856 541	0,78	2 250 000	USD	Residential Reinsurance 2019 Series 13 06/06/23, variabel	2 235 431	0,09
19 792 000	USD	Sakura Re Series B 07/04/25, variabel	18 970 137	0,78	6 154 000	USD	Residential Reinsurance 2020 06/06/24, variabel	5 657 372	0,23
11 500 000	USD	Sakura Re 05/01/26, variabel	11 505 750	0,47	5 484 000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 3 06/12/24, variabel	5 208 840	0,21
5 156 000	USD	Sanders Re III 07/04/27, variabel	5 174 819	0,21	5 000 000	USD	Residential Reinsurance 2020 Series 4 06/12/24, variabel	4 784 250	0,20
10 000 000	USD	Sanders Re III Series A 07/04/27, variabel	10 261 750	0,42	4 250 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 11 06/06/25, variabel	3 382 575	0,14
14 500 000	USD	Sierra Series A 31/01/24, variabel	14 211 813	0,59	5 535 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 12 06/06/25, variabel	4 642 481	0,19
3 500 000	USD	Sierra Series B 31/01/24, variabel	3 407 513	0,14	4 642 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 13 06/06/25, variabel	4 097 842	0,17
2 708 000	USD	Titania Re 27/02/26, variabel	2 715 176	0,11	6 500 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 14 06/06/25, variabel	5 965 213	0,25
3 750 000	USD	Topanga Re 08/01/26, variabel	3 254 250	0,13	14 416 667	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 2 06/12/25, variabel	13 006 717	0,54
20 000 000	USD	Torrey Pines Re Series A 07/06/24, variabel	19 527 000	0,80	4 310 000	USD	Residential Reinsurance 2021 Series 3 06/12/25, variabel	3 864 669	0,16
19 250 000	USD	Torrey Pines Re Series B 07/06/24, variabel	18 608 494	0,77	6 300 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 13 06/06/26, variabel	5 595 975	0,23
9 500 000	USD	Torrey Pines Re Series A 06/06/25, variabel	9 302 875	0,38	2 950 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 14 06/06/26, variabel	2 698 070	0,11
5 000 000	USD	Torrey Pines Re Series B 06/06/25, variabel	4 709 750	0,19	3 750 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 3 06/12/26, variabel	3 740 250	0,15
41 725 000	USD	Ursa Re II Series AA 07/12/23, variabel	41 127 288	1,70	8 500 000	USD	Residential Reinsurance 2022 Series 5 06/12/26, variabel	8 485 550	0,35
15 200 000	USD	Ursa Re II Series D 07/12/23, variabel	15 103 100	0,62	9 117 000	USD	Vitality Re XI Series A 09/01/24, variabel	8 998 479	0,37
21 366 000	USD	Ursa Re II 06/12/24, variabel	19 585 678	0,81	3 500 000	USD	Vitality Re XI Series B 09/01/24, variabel	3 437 700	0,14
10 500 000	USD	Ursa Re II Series A 16/06/25, variabel	10 101 000	0,42	12 044 000	USD	Vitality Re XII Series A 07/01/25, variabel	11 792 582	0,49
6 250 000	USD	Ursa Re II Series E 16/06/25, variabel	5 836 875	0,24	6 000 000	USD	Vitality Re XII Series B 07/01/25, variabel	5 845 200	0,24
17 500 000	USD	Ursa Re II Series AA 06/12/25, variabel	17 644 813	0,73	8 148 000	USD	Vitality Re XIII Series A 06/01/26, variabel	7 857 320	0,32
11 250 000	USD	Ursa Re II Series C 06/12/25, variabel	11 432 531	0,47	4 000 000	USD	Vitality Re XIII Series B 06/01/26, variabel	3 834 600	0,16
7 000 000	USD	Veraison Re 09/03/26, variabel	7 021 000	0,29	14 000 000	USD	Vitality Re XIV Series A 05/01/27, variabel	14 004 550	0,58
		Kaimaninseln	165 929 613	6,83	5 550 000	USD	Vitality Re XIV Series B 05/01/27, variabel	5 551 804	0,23
1 092 500	USD	Caelus Re V Series B 05/06/24, variabel	942 281	0,04					
3 747 995	USD	Caelus Re V Series C 05/06/24, variabel	552 829	0,02					
6 850 000	USD	Caelus Re VI 07/06/23, variabel	6 759 066	0,28					
13 050 000	USD	Caelus Re VI 07/06/24, variabel	12 631 421	0,52					
7 062 000	USD	Residential Reinsurance 2019 06/12/23, variabel	6 836 546	0,28					
4 000 000	USD	Residential Reinsurance 2019 Series 12 06/06/23, variabel	3 520 000	0,14					

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
China			3 233 750	0,13
3 250 000	USD	Great Wall Re 05/01/26, variabel	3 233 750	0,13
Hongkong			6 228 624	0,26
6 558 000	USD	Black Kite Re 09/06/25, variabel	6 228 624	0,26
Irland			72 269 895	2,97
19 925 000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2020 DAC 10/06/24, variabel	18 961 128	0,78
20 000 000	USD	Atlas Capital Reinsurance 2022 Designated Activity 06/06/25, variabel	18 554 500	0,76
20 000 000	EUR	Lion III Re DAC 16/07/25, variabel	21 420 502	0,88
4 250 000	EUR	Orange Capital Re DAC 17/01/25, variabel	4 590 228	0,19
8 269 000	EUR	Windmill II Re DAC 05/07/24, variabel	8 743 537	0,36
Singapur			77 335 472	3,19
4 000 000	USD	Astro Re 08/07/25, variabel	3 520 000	0,14
9 750 000	USD	Catahoula II Re Series A 16/06/25, variabel	8 919 544	0,37
5 250 000	USD	Catahoula II Re Series B 16/06/25, variabel	5 050 894	0,21
11 466 000	USD	First Coast Re III 07/04/25, variabel	10 294 461	0,42
7 973 000	USD	First Coast Re IV 07/04/26, variabel	7 992 933	0,33
6 957 000	EUR	Hexagon III Re 15/01/26, variabel	6 979 001	0,29
5 000 000	EUR	Hexagon III Re Series CAT 15/01/26, variabel	5 178 487	0,21
17 714 000	USD	Nakama Re 13/10/26, variabel	16 919 970	0,71
3 000 000	USD	Phoenix 2 Re 04/01/28, ZCP	3 131 360	0,13
250 000	USD	Phoenix 2 Re Series 22-1 04/01/28, ZCP	309 078	0,01
5 000 000	USD	Umigame Re Series A1 07/04/25, variabel	4 679 375	0,19
2 750 000	USD	Umigame Re Series A2 07/04/25, variabel	2 579 775	0,11
1 875 000	USD	Umigame Re Series B1 07/04/25, variabel	1 780 594	0,07
Vereinigtes Königreich			27 340 994	1,13
29 750 000	USD	Sussex Capital UK Pcc 08/01/25, variabel	27 340 994	1,13

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen regulierten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
USA			71 862 544	2,96
6 315 000	USD	Cosaint Re 03/04/24, variabel	4 823 081	0,20
5 500 000	USD	Gateway Re 12/05/25, variabel	5 134 800	0,21
21 666 000	USD	Gateway Re Series A 24/02/26, variabel	21 721 790	0,89
5 500 000	USD	Gateway Re Series B 24/02/26, variabel	5 513 338	0,23
531 621	USD	JGWPT XXV 15/02/67, 7,14%	544 336	0,02
9 000 000	USD	Lightning Re 31/03/26, variabel	9 029 250	0,37
6 250 000	USD	Logistics Re 20/12/24, variabel	6 021 719	0,25
51 919	USD	Putnam Re 07/06/24, 10,18% *	-	-
1 200 000	USD	Security First Managers 25/02/25, variabel	1 200 000	0,05
15 403 000	USD	Vista Re 21/05/24, variabel	14 345 199	0,59
3 750 000	USD	Vista Re 21/05/25, variabel	3 529 031	0,15
Summe Anleihen			1 323 712 321	54,52
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen regulierten Markt gehandelt werden			1 323 712 321	54,52
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
USA			14 318 887	0,59
13 506 525	USD	LIAS Administration Fee Issuer 25/07/48, 5,96%	12 868 301	0,53
2 400	USD	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP	-	-
1 836 184	USD	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP	1 450 586	0,06
Summe Anleihen			14 318 887	0,59
Summe sonstige Wertpapiere			14 318 887	0,59
Summe Kapitalinvestitionen			2 192 686 291	90,31
Sonstiges Nettovermögen			235 308 962	9,69
Nettoinventarwert			2 427 995 253	100,00

* Notleidendes Wertpapier.

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Aktien				
Niederlande			6 469 468	3,78
9 504	USD	ASML Holding	6 469 468	3,78
USA			123 978 781	72,37
65 434	USD	Amazon.com	6 758 678	3,95
565 325	USD	CCC Intelligent Solutions Holdings	5 070 965	2,96
58 000	USD	Chewy	2 168 040	1,27
67 871	USD	Marvell Technology	2 938 814	1,72
63 789	USD	Meta Platforms	13 519 442	7,88
20 671	USD	Microsoft	5 959 449	3,48
18 278	USD	MongoDB	4 260 967	2,49
35 700	USD	Netflix	12 333 636	7,19
98 333	USD	New Relic	7 403 492	4,32
372 679	USD	News	6 436 166	3,76
114 417	USD	Oracle	10 631 628	6,21
6 600	USD	Roku	434 412	0,25
63 384	USD	Skyworks Solutions	7 478 044	4,37
54 102	USD	Spotify Technology	7 229 109	4,22
87 184	USD	Trimble	4 570 185	2,67
108 569	USD	Walt Disney	10 871 014	6,34
326 985	USD	Warner Bros Discovery	4 937 474	2,88
105 600	USD	Warner Music Group	3 523 872	2,06
167 605	USD	Zillow Group	7 453 394	4,35
Summe Aktien			130 448 249	76,15
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			130 448 249	76,15
Summe Kapitalinvestitionen			130 448 249	76,15
Sonstiges Nettovermögen			40 857 890	23,85
Nettoinventarwert			171 306 139	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% Netto- vermögen
Aktien				
Bermuda			4 168 808	0,94
22 567	USD	RenaissanceRe Holdings	4 168 808	0,94
Kanada			101 702 418	22,81
323 356	CAD	Canadian National Railway	35 181 496	7,89
566 027	CAD	Canadian Pacific Railway	40 189 916	9,01
894 062	CAD	Cenovus Energy	14 383 541	3,23
354 987	USD	Teck Resources	11 947 465	2,68
Dänemark			5 108 637	1,15
35 051	DKK	Novo Nordisk	5 108 637	1,15
Frankreich			9 049 052	2,03
66 274	EUR	Safran	9 049 052	2,03
Deutschland			21 598 148	4,85
66 971	EUR	Münchener Rückversicherungs- Gesellschaft in München	21 598 148	4,85
Indien			10 718 814	2,40
86 125	USD	HDFC Bank	5 294 563	1,19
272 595	USD	ICICI Bank	5 424 251	1,21
Norwegen			3 325 766	0,75
485 378	NOK	Norsk Hydro	3 325 766	0,75
Vereinigtes Königreich			6 065 383	1,36
970 600	HKD	HSBC Holdings	6 065 383	1,36
USA			191 570 789	42,97
109 916	USD	Alphabet	10 540 585	2,36
70 217	USD	Analog Devices	12 769 199	2,86
100 956	USD	Applied Materials	11 434 233	2,57
2 564	USD	Booking Holdings	6 270 889	1,41
14 620	USD	Everest Re Group	4 826 420	1,08
21 539	USD	First Citizens BancShares	19 326 511	4,34
128 009	USD	Fiserv	13 341 500	2,99
133 789	USD	KKR	6 479 113	1,45
4 294	USD	Linde	1 407 339	0,32
49 987	USD	Lowe's	9 217 059	2,07
36 824	USD	LPL Financial Holdings	6 872 455	1,54
37 048	USD	Mastercard	12 414 582	2,79
64 119	USD	Meta Platforms	12 530 549	2,81

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert EUR	% Netto- vermögen
47 997	USD	Microsoft	12 759 368	2,86
364 639	USD	Schlumberger	16 508 783	3,70
3 878	USD	Thermo Fisher Scientific	2 061 008	0,46
3 322	USD	UnitedHealth Group	1 447 620	0,32
150 864	USD	Visa	31 363 576	7,04
Summe Aktien			353 307 815	79,26
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			353 307 815	79,26
Summe Kapitalinvestitionen			353 307 815	79,26
Sonstiges Nettovermögen			92 447 750	20,74
Nettoinventarwert			445 755 565	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Helix

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Aktien				
Belgien			426 527	0,14
16 806	EUR	Azelis Group	426 527	0,14
Brasilien			9 035 889	3,02
582 079	BRL	Aliansce Sonae Shopping Centers	2 020 530	0,68
329 700	BRL	B3 – Brasil Bolsa Balcao	673 023	0,23
94 262	BRL	Banco Bradesco	244 846	0,08
560 726	BRL	Cia Brasileira de Aluminio	838 283	0,28
1 217 673	BRL	Itausa	1 974 118	0,66
52 022	BRL	Lojas Renner	170 012	0,06
151 200	BRL	Petro Rio	930 117	0,31
453 100	BRL	Raia Drogasil	2 184 960	0,72
Britische Jungferninseln			-	-
100 339	USD	Noventiq Holdings	-	-
Chile			2 776 948	0,93
1 037 166	CLP	Cencosud	2 015 010	0,68
107 379	CLP	Empresas Copec	761 938	0,25
China			29 103 203	9,74
3 782	USD	Alibaba Group Holding	386 445	0,13
124 000	HKD	China Mengniu Dairy	508 640	0,17
29 500	HKD	China Merchants Bank	150 695	0,05
130 600	HKD	China Pacific Insurance Group	346 882	0,12
19 000	CNH	China Tourism Group Duty Free	506 977	0,17
12 800	CNH	Chongqing Brewery	232 988	0,08
34 998	CNH	Contemporary Amperex Technology	2 069 363	0,69
144 800	CNH	East Money Information	422 341	0,14
33 200	CNH	Estun Automation	135 705	0,05
24 570	CNH	Foshan Haitian Flavouring & Food	273 847	0,09
6 552	USD	H World Group	320 917	0,11
92 021	CNH	Hangzhou First Applied Material	787 243	0,26
86 190	CNH	Han's Laser Technology Industry Group	380 916	0,13
300 700	CNH	Hengli Petrochemical	709 353	0,24
71 016	CNH	Hongfa Technology	337 019	0,11
98 775	CNH	Huafon Chemical	107 300	0,04
105 100	CNH	Hualan Biological Engineering	334 095	0,11
20 350	HKD	JD.com	445 888	0,15
6 708	USD	JinkoSolar Holding	342 242	0,11

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
2 300	CNH	Kweichow Moutai	609 555	0,20
49 889	CNH	Leader Harmonious Drive Systems	787 423	0,26
385 676	CNH	LONGi Green Energy Technology	2 269 475	0,76
390 174	CNH	Midea Group	3 057 282	1,03
109 560	CNH	NARI Technology	432 509	0,14
1 921	USD	PDD Holdings	145 804	0,05
29 300	CNH	Ping An Insurance Group of China	194 557	0,07
8 183	CNH	Pylon Technologies	292 535	0,10
533 700	CNH	Sany Heavy Industry	1 328 169	0,44
74 700	CNH	Shandong Sinocera Functional Material	308 272	0,10
162 508	CNH	Shenzhen Inovance Technology	1 663 581	0,56
12 400	CNH	Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics	562 842	0,19
37 256	CNH	Thunder Software Technology	587 813	0,20
208 300	CNH	Tofflon Science & Technology Group	817 755	0,27
750 843	CNH	Toly Bread	1 702 361	0,57
164 603	CNH	Wanhua Chemical Group	2 298 158	0,77
63 800	CNH	Wuliangye Yibin	1 830 210	0,61
142 200	CNH	Wuxi Lead Intelligent Equipment	838 212	0,28
37 300	CNH	Zhejiang Huayou Cobalt	298 735	0,10
33 890	CNH	Zhejiang Jiechang Linear Motion Technology	121 499	0,04
113 500	HKD	Zylox-Tonbridge Medical Technology	157 600	0,05
Georgien			1 308 825	0,44
47 256	GBP	TBC Bank Group	1 308 825	0,44
Deutschland			420 243	0,14
3 278	EUR	Dr Ing hc F Porsche	420 243	0,14
Griechenland			4 419 184	1,48
242 293	EUR	Alpha Services & Holdings	296 144	0,10
40 753	EUR	Mytilneos	1 160 034	0,39
610 120	EUR	National Bank of Greece	2 963 006	0,99
Ungarn			2 047 530	0,69
97 858	HUF	Richter Gedeon	2 047 530	0,69
Indonesien			1 742 051	0,58
241 900	IDR	Bank Central Asia	141 160	0,05
1 999 900	IDR	Bank Mandiri Persero	1 377 103	0,46
826 500	IDR	Telkom Indonesia Persero	223 788	0,07

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Italien			4 119 277	1,38
2 248	EUR	DiaSorin	237 053	0,08
39 152	EUR	Eni	548 979	0,18
51 969	EUR	FinecoBank Banca Fineco	798 369	0,27
310 761	EUR	Intesa Sanpaolo	799 330	0,27
5 029	EUR	Moncler	347 167	0,12
14 469	EUR	Prysmian	608 358	0,20
41 238	EUR	UniCredit	780 021	0,26
Japan			526 248	0,18
68 800	JPY	Monstarlab Holdings	526 248	0,18
Kasachstan			2 443 921	0,82
191 002	USD	Halyk Savings Bank of Kazakhstan	2 207 983	0,74
3 125	USD	Kaspi.KZ	235 938	0,08
Mexiko			2 685 961	0,90
61 626	USD	Banco Santander Mexico Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	417 208	0,14
426 800	MXN	Grupo Mexico	2 014 867	0,68
12 829	USD	Vista Energy	253 886	0,08
Peru			103 922	0,03
4 554	USD	Intercorp Financial Services	103 922	0,03
Philippinen			3 112 302	1,04
347 780	PHP	International Container Terminal Services	1 365 148	0,46
1 140 800	PHP	Puregold Price Club	656 802	0,22
1 975 900	PHP	Wilcon Depot	1 090 352	0,36
Polen			3 409 960	1,14
8 251	PLN	Grupa Kety	1 015 084	0,35
29 910	PLN	Grupa Pracuj	402 683	0,13
13 938	PLN	KRUK	997 131	0,33
122 200	PLN	Powszechny Zaklad Ubezpieczen	995 062	0,33
Katar			1 169 736	0,39
1 230 945	QAR	Qatar Gas Transport	1 169 736	0,39
Russland			-	-
262 653	USD	Fix Price Group	-	-
Slowenien			3 793 821	1,27
255 820	EUR	Nova Ljubljanska Banka dd	3 793 821	1,27
Südafrika			1 688 810	0,57
13 477	ZAR	Capitec Bank Holdings	1 281 950	0,43
36 000	ZAR	Tiger Brands	406 860	0,14

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Südkorea			29 282 574	9,80
3 718	KRW	Hana Financial Group	116 237	0,04
18 614	KRW	Hankook Tire & Technology	497 574	0,17
707	KRW	Hyundai Motor	100 197	0,03
3 731	KRW	KB Financial Group	136 561	0,05
4 492	KRW	Korea Zinc	1 908 112	0,64
5 220	KRW	L&F	1 257 034	0,42
4 430	KRW	LG Chem	2 422 829	0,81
432	KRW	LG Chem – Preference	103 035	0,03
425	KRW	NAVER	65 945	0,02
235 780	KRW	Samsung Electronics	11 591 136	3,88
92 228	KRW	Samsung Electronics – Preference	3 818 481	1,28
15 721	KRW	Samsung Fire & Marine Insurance	2 487 634	0,83
2 621	KRW	Samsung SDI	1 479 767	0,50
2 345	KRW	SK Hynix	159 594	0,05
6 740	KRW	SK Telecom	250 061	0,08
107 282	KRW	WONIK IPS	2 888 377	0,97
Schweiz			375 280	0,12
10 209	GBP	Wizz Air Holdings	375 280	0,12
Taiwan			39 450 569	13,20
104 792	TWD	Advantech	1 276 881	0,43
474 000	TWD	ASE Technology Holding	1 751 375	0,59
3 000	TWD	ASMedia Technology	112 817	0,04
146 000	TWD	Chroma ATE	851 137	0,28
227 000	TWD	CTBC Financial Holding	162 902	0,05
16 250	TWD	Dadi Early-Childhood Education Group	62 177	0,02
26 000	TWD	Delta Electronics	257 033	0,09
61 000	TWD	Eclat Textile	991 707	0,33
448 000	TWD	Hon Hai Precision Industry	1 530 241	0,51
165 000	TWD	MediaTek	4 264 882	1,43
132 000	TWD	Merida Industry	730 503	0,24
26 000	TWD	Micro-Star International	122 966	0,04
84 000	TWD	Nien Made Enterprise	902 143	0,30
61 000	TWD	Novatek Microelectronics	864 488	0,29
88 750	TWD	Sporton International	787 010	0,26
1 289 000	TWD	Taiwan Semiconductor Manufacturing	22 564 644	7,56
78 000	TWD	Uni-President Enterprises	184 192	0,06
724 000	TWD	United Microelectronics	1 257 890	0,42

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
13 650	TWD	Voltronic Power Technology	775 581	0,26
Thailand			1 796 760	0,60
169 000	THB	Kasikornbank	654 847	0,22
250 200	THB	Kasikornbank-XDR	969 484	0,32
598 600	THB	Land & Houses	172 429	0,06
Vereinigte Arabische Emirate			2 333 890	0,78
1 392 492	AED	Emaar Development	2 089 212	0,70
160 461	AED	Emaar Properties	244 678	0,08
Vereinigtes Königreich			2 841 513	0,95
294 973	PLN	Pepco Group	2 841 513	0,95
USA			1 086 384	0,36
1 511	USD	Mastercard	549 113	0,18
2 383	USD	Visa	537 271	0,18
Vietnam			481 923	0,16
152 000	VND	Vietnam Dairy Products	481 923	0,16
Summe Aktien			151 983 251	50,85
Anleihen				
Angola			447 961	0,15
340 000	USD	Angolan Government International Bond 26/11/29, 8.00%	292 536	0,10
200 000	USD	Angolan Government International Bond 26/11/49, 9.13%	155 425	0,05
Brasilien			1 203 545	0,39
2 096 000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/29, 10.00%	382 944	0,13
1 210 000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/31, 10.00%	214 975	0,07
3 500 000	BRL	Brazil Notas do Tesouro Nacional Serie F 01/01/33, 10.00%	605 626	0,19
Burkina Faso			319 694	0,11
380 000	USD	Endeavour Mining 14/10/26, 5.00%	319 694	0,11
Kolumbien			566 795	0,19
3 430 000 000	COP	Colombian TES 26/03/31, 7.00%	566 795	0,19
Tschechische Republik			317 637	0,11
570 000	EUR	CPI Property Group 27/01/31, 1.50%	317 637	0,11
Ägypten			127 500	0,04
200 000	USD	Egypt Government International Bond 29/05/32, 7.63%	127 500	0,04

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Ungarn			299 367	0,10
138 000 000	HUF	Hungary Government Bond 24/11/32, 4.75%	299 367	0,10
Elfenbeinküste			537 268	0,18
470 000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 17/10/31, 5.88%	420 929	0,14
140 000	EUR	Ivory Coast Government International Bond 30/01/32, 4.88%	116 339	0,04
Kenia			236 176	0,08
290 000	USD	Kenya Government International Bond 22/05/32, 8.00%	236 176	0,08
Mexiko			1 110 710	0,37
2 700 000	MXN	Mexican Bonos 18/11/38, 8.50%	142 870	0,05
8 110 000	MXN	Mexican Bonos 13/11/42, 7.75%	391 933	0,13
8 870 000	MXN	Mexican Bonos 07/11/47, 8.00%	437 531	0,14
2 900 000	MXN	Petroleos Mexicanos 12/11/26, 7.47%	138 376	0,05
Nigeria			289 272	0,10
350 000	USD	Nigeria Government International Bond 24/03/29, 8.38%	289 272	0,10
Peru			204 284	0,07
840 000	PEN	Peru Government Bond 12/08/32, 6.15%	204 284	0,07
Russland			158 945	0,05
38 000 000	RUB	Russian Federal Bond – OFZ 23/03/33, 7.70%	158 945	0,05
Senegal			224 265	0,08
320 000	EUR	Senegal Government International Bond 08/06/37, 5.38%	224 265	0,08
Südafrika			987 337	0,33
3 000 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/03/32, 8.25%	147 612	0,05
6 690 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 28/02/35, 8.88%	323 631	0,11
6 500 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/37, 8.50%	295 060	0,10
4 819 000	ZAR	Republic of South Africa Government Bond 31/01/40, 9.00%	221 034	0,07
Türkei			202 400	0,07
200 000	USD	Pegasus Hava Tasimaciligi 30/04/26, 9.25%	202 400	0,07

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Ukraine				
330 000	USD	VF Ukraine PAT via VFU Funding 11/02/25, 6.20%	196 350	0,07
Summe Anleihen			7 429 506	2,49
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			159 412 757	53,34

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
Brasilien				
241 563	USD	MC Brazil Downstream Trading 30/06/31, 7.25%	189 351	0,07
USA				
40 321 000	USD	United States Treasury Bill 06/04/23, ZCP	40 296 119	13,48
7 056 400	USD	United States Treasury Bill 13/04/23, ZCP	7 045 904	2,36
8 000 000	USD	United States Treasury Bill 20/04/23, ZCP	7 980 548	2,67
8 000 000	USD	United States Treasury Bill 27/04/23, ZCP	7 973 697	2,67
10 074 000	USD	United States Treasury Bill 04/05/23, ZCP	10 031 152	3,36
5 036 600	USD	United States Treasury Bill 11/05/23, ZCP	5 011 708	1,68
2 014 000	USD	United States Treasury Bill 18/05/23, ZCP	2 002 584	0,67
1 006 600	USD	United States Treasury Bill 25/05/23, ZCP	1 000 244	0,33
Summe Anleihen			81 531 307	27,29
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			81 531 307	27,29

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Investitionen	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Luxemburg			14 576 550	4,88
100 000	USD	Schroder GAIA Asian Equity Long Short	10 397 000	3,48
4 078	USD	Schroder ISF – China A	631 451	0,21
2 007	USD	Schroder ISF Emerging Markets Value	300 511	0,10
10 025	USD	Schroder ISF Indian Equity	3 247 588	1,09
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Investitionen			14 576 550	4,88
Summe Kapitalinvestitionen			255 520 614	85,51
Sonstiges Nettovermögen			43 283 785	14,49
Nettoinventarwert			298 804 399	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
Argentinien			954 154	1,50
150 000	USD	Transportadora de Gas del Sur 02/05/25, 6.75%	135 113	0,21
775 000	USD	YPF 27/06/29, 8.50%	595 952	0,94
250 000	USD	YPF Energia Electrica 25/07/26, 10.00%	223 089	0,35
Belgien			198 564	0,31
200 000	EUR	Telenet Finance Luxembourg Notes 01/03/28, 3.50%	198 564	0,31
Kanada			324 759	0,51
300 000	EUR	Primo Water Holdings 31/10/28, 3.88%	284 692	0,45
40 000	USD	Royal Bank of Canada 12/01/26, 4.88%	40 067	0,06
China			154 565	0,24
200 000	USD	Shimao Group Holdings 15/07/26, 5.60%	29 363	0,05
200 000	USD	Shimao Group Holdings 13/07/30, 4.60%	29 202	0,05
200 000	USD	Sino-Ocean Land Treasure IV 05/05/26, 3.25%	96 000	0,14
Frankreich			1 829 017	2,87
50 911	EUR	Accor 07/12/27, 0.70%	52 041	0,08
200 000	EUR	Afflelou 19/05/26, 4.25%	200 964	0,31
100 000	EUR	Altice France 15/01/25, 2.50%	101 265	0,16
200 000	EUR	Altice France 15/07/29, 4.00%	163 076	0,26
100 000	EUR	Banijay Entertainment 01/03/25, 3.50%	105 867	0,17
210 000	EUR	CAB Selas 01/02/28, 3.38%	187 533	0,29
200 000	EUR	Electricite de France perpetual, variabel	212 803	0,33
100 000	EUR	Elis 24/05/27, 4.13%	108 506	0,17
300 000	EUR	Iliad Holding 15/10/28, 5.63%	303 683	0,48
100 000	EUR	Loxam 15/07/26, 3.75%	100 930	0,16
100 000	EUR	Loxam 15/04/27, 4.50%	91 116	0,14
110 000	EUR	Parts Europe 16/07/25, 6.50%	120 302	0,19
16 099	EUR	Safran 01/04/28, ZCP	17 160	0,03
65 573	EUR	Worldline 30/07/25, ZCP	63 771	0,10
Deutschland			933 436	1,46
165 000	EUR	IHO Verwaltungs 15/05/25, 3.63%	178 352	0,28
115 000	EUR	IHO Verwaltungs 15/05/28, 8.75%	127 611	0,20

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
100 000	EUR	Nidda BondCo 30/09/25, 5.00%	107 203	0,17
100 000	EUR	Nidda Healthcare Holding 21/08/26, 7.50%	106 295	0,17
100 000	EUR	Phoenix PIB Dutch Finance 05/08/25, 2.38%	103 434	0,16
200 000	EUR	Renk 15/07/25, 5.75%	212 936	0,33
100 000	EUR	TUI Cruisesa 15/05/26, 6.50%	97 605	0,15
Indien			283 940	0,45
200 000	USD	Vedanta Resources Finance II 21/01/24, 13.88%	160 255	0,26
200 000	USD	Vedanta Resources Finance II 11/03/25, 8.95%	123 685	0,19
Irland			294 574	0,46
100 000	EUR	eircom Finance DAC 15/05/26, 3.50%	103 170	0,16
100 000	EUR	eircom Finance DAC 15/02/27, 2.63%	97 541	0,15
100 000	EUR	Rockford Tower Europe CLO DAC 20/04/34, variabel	93 863	0,15
Italien			1 061 792	1,66
210 000	EUR	Castor 15/02/29, variabel	217 922	0,33
200 000	EUR	Centurion Bidco 30/09/26, 5.88%	195 291	0,31
200 000	EUR	Lottomatica 15/07/25, 5.13%	214 447	0,34
100 000	EUR	Mooney Group 17/12/26, variabel	106 362	0,17
110 000	EUR	TeamSystem 15/02/28, 3.50%	105 571	0,17
200 000	EUR	Telecom Italia 15/02/28, 6.88%	222 199	0,34
Luxemburg			784 044	1,23
310 000	EUR	Altice Financing 15/01/28, 3.00%	268 940	0,42
205 000	EUR	INEOS Finance 15/05/28, 6.63%	224 797	0,35
100 000	EUR	Matterhorn Telecom 15/11/27, 4.00%	100 514	0,16
200 000	EUR	Summer BC Holdco B 31/10/26, 5.75%	189 793	0,30
Niederlande			945 745	1,48
110 000	EUR	Q-Park Holding I 01/03/26, variabel	117 379	0,18
210 000	EUR	TMNL Holding 15/01/29, 3.75%	199 728	0,31
100 000	EUR	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 3.75%	100 317	0,16
260 000	USD	Trivium Packaging Finance 15/08/26, 5.50%	249 395	0,40

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
100 000	EUR	UPC Holding 15/06/29, 3,88%	90 402	0,14
120 000	EUR	VZ Vendor Financing II 15/01/29, 2,88%	104 236	0,16
100 000	EUR	Ziggo Bond 28/02/30, 3,38%	84 288	0,13
Spanien			684 837	1,07
100 000	EUR	Cellnex Telecom 20/11/31, 0,75%	86 847	0,14
200 000	EUR	Cirsa Finance International 15/03/27, 4,50%	189 785	0,30
210 000	EUR	Lorca Telecom Bondco 18/09/27, 4,00%	209 806	0,32
100 000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	92 361	0,14
100 000	EUR	Telefonica Europe perpetual, variabel	106 038	0,17
Schweden			358 657	0,56
100 000	EUR	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden perpetual, variabel	40 241	0,06
200 000	EUR	Verisure Holding 15/07/26, 3,88%	201 760	0,32
100 000	EUR	Verisure Holding 15/10/27, 9,25%	116 656	0,18
Vereinigtes Königreich			1 359 395	2,13
100 000	GBP	AA Bond 31/01/26, 6,50%	104 854	0,16
200 000	EUR	BCP V Modular Services Finance II 30/11/28, 4,75%	185 117	0,29
200 000	EUR	EG Global Finance 30/10/25, 6,25%	201 185	0,32
100 000	GBP	Hurricane Finance 15/10/25, 8,00%	111 880	0,18
100 000	EUR	Motion Finco 15/05/25, 7,00%	110 110	0,17
200 000	GBP	Pinewood Finance 15/11/27, 3,63%	219 753	0,34
100 000	GBP	Premier Foods Finance 15/10/26, 3,50%	112 584	0,18
100 000	GBP	Thames Water Kemble Finance 19/05/26, 4,63%	109 231	0,17
100 000	GBP	Virgin Media Secured Finance 15/05/29, 5,25%	107 945	0,17
110 000	EUR	Vodafone Group 27/08/80, variabel	96 736	0,15
USA			2 401 414	3,77
60 000	USD	Advance Auto Parts 09/03/26, 5,90%	61 282	0,10
52 000	USD	American Tower 15/03/25, 2,40%	49 403	0,08

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
310 000	EUR	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 2,13%	295 300	0,46
125 000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/27, 5,25%	98 676	0,15
43 000	USD	AT&T 20/02/26, 5,54%	43 133	0,07
100 000	EUR	Avantor Funding 15/07/28, 3,88%	101 414	0,16
45 000	USD	Celanese US Holdings 05/07/24, 5,90%	45 022	0,07
30 000	USD	Cigna Group 15/03/26, 5,69%	30 196	0,05
100 000	EUR	Clarios Global 15/05/26, 4,38%	103 806	0,16
310 000	EUR	Dana Financing Luxembourg 15/07/29, 3,00%	260 966	0,41
200 000	EUR	Energizer Gamma Acquisition 30/06/29, 3,50%	175 011	0,27
50 000	USD	Energy Transfer 15/03/25, 4,05%	49 039	0,08
20 000	USD	Ford Motor Credit 17/11/23, 3,37%	19 645	0,03
65 000	USD	Ford Motor Credit 13/11/30, 4,00%	55 284	0,09
31 000	USD	HCA 15/03/24, 5,00%	30 828	0,05
27 000	USD	Hewlett Packard Enterprise 01/10/24, 5,90%	27 356	0,04
20 000	USD	Lowe's 01/04/26, 4,80%	20 109	0,03
85 000	USD	MGIC Investment 15/08/28, 5,25%	80 881	0,13
170 000	USD	MPT Operating Partnership 15/10/27, 5,00%	140 013	0,22
190 000	USD	Oceaneering International 01/02/28, 6,00%	178 754	0,28
70 000	USD	Oracle 01/04/25, 2,50%	67 013	0,11
110 000	EUR	Silgan Holdings 01/06/28, 2,25%	101 017	0,16
55 000	USD	TransDigm 15/03/27, 7,50%	54 918	0,09
260 000	USD	TransDigm 15/11/27, 5,50%	245 440	0,38
69 000	USD	Zimmer Biomet Holdings 01/04/25, 3,55%	66 908	0,10
Summe Anleihen			12 568 893	19,70
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			12 568 893	19,70

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
Argentinien			176 914	0,28
42 300	USD	Genneia 02/09/27, 8.75%	40 588	0,06
150 000	USD	Pampa Energia 15/04/29, 9.13%	136 326	0,22
Australien			1 445 209	2,27
295 000	USD	Mineral Resources 01/05/27, 8.13%	299 716	0,47
125 000	USD	Mineral Resources 01/05/30, 8.50%	128 413	0,20
262 000	AUD	Ruby Bond Trust 12/03/53, variabel	175 190	0,27
272 000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2021-1 12/03/53, variabel	179 703	0,28
500 000	AUD	Ruby Bond Trust 14/01/54, variabel	331 059	0,52
500 000	AUD	Ruby Bond Trust Series 2022-1 14/01/54, variabel	331 128	0,53
Bermuda			781 167	1,22
400 000	USD	Eagle Re 25/11/28, variabel	400 694	0,62
400 000	USD	Home Re 25/01/34, variabel	380 473	0,60
Brasilien			131 315	0,21
200 000	USD	Azul Investments 15/06/26, 7.25%	131 315	0,21
Kanada			1 418 211	2,22
15 000	USD	Bombardier 15/03/25, 7.50%	15 017	0,02
255 000	USD	Bombardier 15/06/26, 7.13%	256 148	0,40
405 000	USD	Cascades 15/01/28, 5.38%	385 081	0,60
105 000	USD	GFL Environmental 01/08/28, 4.00%	95 120	0,15
300 000	USD	Intelligent Packaging 15/09/28, 6.00%	258 750	0,41
195 000	USD	Precision Drilling 15/01/26, 7.13%	190 624	0,30
56 000	USD	Shopify 01/11/25, 0.13%	49 504	0,08
100 000	USD	Strathcona Resources 01/08/26, 6.88%	79 623	0,12
55 000	USD	Toronto-Dominion Bank 09/01/26, 5.10%	55 332	0,09
33 000	USD	TransCanada PipeLines 09/03/26, variabel	33 012	0,05
Kaimaninseln			3 744 074	5,87
250 000	USD	ACAM 17/11/34, variabel	235 060	0,37
250 000	USD	ACAM Series 2019-FL1 17/11/34, variabel	238 700	0,37
375 000	USD	ICG US CLO 16/01/33, variabel	290 119	0,45

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
375 000	USD	Marble Point CLO XV 23/07/32, variabel	316 047	0,50
250 000	USD	MP CLO VIII 28/04/34, variabel	223 626	0,35
250 000	USD	Ocean Trails CLO XI 20/07/34, variabel	216 934	0,34
250 000	USD	Ocean Trails CLO XI Series 2021-11A 20/07/34, variabel	223 925	0,35
494 941	USD	Pioneer Aircraft Finance 15/06/44, 3.97%	429 319	0,67
375 000	USD	Trinitas CLO XVI 20/07/34, variabel	329 629	0,52
1 000 000	USD	Trinitas CLO XVIII 20/01/35, variabel	873 304	1,37
400 000	USD	TRTX Issuer 15/03/38, variabel	367 411	0,58
Deutschland			381 385	0,60
64 000	USD	Daimler Truck Finance North America 16/01/26, 5.15%	64 245	0,10
17 000	USD	Mercedes-Benz Finance North America 30/03/25, variabel	17 016	0,03
350 000	USD	Mercer International 01/02/29, 5.13%	300 124	0,47
Hongkong			187 433	0,29
240 000	USD	Seaspan 01/08/29, 5.50%	187 433	0,29
Irland			10 862 263	17,02
500 000	EUR	Adagio X EUR CLO DAC 20/07/36, variabel	511 606	0,80
375 000	EUR	Ares European CLO XII DAC 20/04/32, variabel	361 429	0,57
321 530	EUR	Arrow CMBS 2018 DAC 22/05/30, variabel	333 790	0,52
750 000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 15/04/32, variabel	731 756	1,15
750 000	EUR	Bain Capital Euro CLO DAC 19/10/34, variabel	720 742	1,13
800 000	EUR	Barings Euro CLO 2022-1 DAC 28/10/34, variabel	850 412	1,33
550 000	EUR	BBAM European CLO I DAC 22/07/34, variabel	516 419	0,81
250 000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund 15/01/37, variabel	241 696	0,38
300 000	EUR	CVC Cordatus Loan Fund 15/01/37, variabel	300 942	0,47
466 170	EUR	European Loan Conduit No 36 DAC 17/02/30, variabel	487 440	0,76
388 475	EUR	European Loan Conduit No 36 DAC 17/02/30, variabel	401 289	0,63
103 751	EUR	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	98 121	0,15

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
99 756	GBP	Frost CMBS DAC 20/11/33, variabel	112 283	0,18	195 000	USD	Academy 15/11/27, 6.00%	190 440	0,30
108 734	GBP	Frost CMBS DAC* 20/11/33, variabel	118 917	0,19	125 000	USD	Acadia Healthcare 01/07/28, 5.50%	121 206	0,19
375 000	EUR	Goldentree Loan Management CLO 4 DAC 20/07/34, variabel	353 448	0,55	65 000	USD	Acadia Healthcare 15/04/29, 5.00%	61 159	0,10
800 000	EUR	ICG Euro CLO 19/04/36, variabel	858 649	1,34	170 000	USD	Ahead DB Holdings 01/05/28, 6.63%	141 310	0,22
174 770	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance 17/08/33, variabel	172 196	0,27	47 000	USD	Airbnb 15/03/26, ZCP	41 219	0,06
550 821	EUR	Last Mile Logistics Pan Euro Finance Series 1A 17/08/33, variabel	544 678	0,85	61 000	USD	Alarm.com Holdings 15/01/26, ZCP	51 770	0,08
375 000	EUR	Palmer Square European CLO DAC 15/04/35, variabel	350 422	0,55	310 000	USD	Albertsons 15/02/28, 5.88%	308 419	0,48
300 000	EUR	Penta CLO 10 DAC 20/11/34, variabel	279 128	0,44	60 000	USD	Albertsons 15/02/30, 4.88%	56 068	0,09
375 000	EUR	Segovia European CLO 20/07/32, variabel	363 802	0,57	135 000	USD	Allied Universal 01/06/28, 4.63%	115 025	0,18
250 000	EUR	St Paul's CLO VII DAC 18/07/34, variabel	241 540	0,38	280 000	USD	Allied Universal Finance 15/07/26, 6.63%	269 360	0,42
399 359	GBP	Taurus UK DAC 17/11/29, variabel	459 051	0,72	275 000	USD	AMC Networks 15/02/29, 4.25%	169 371	0,27
310 000	GBP	Taurus UK DAC 17/05/31, variabel	324 636	0,51	245 000	USD	American Airlines 15/07/25, 11.75%	268 321	0,42
279 432	GBP	Taurus UK DAC 17/08/31, variabel	305 174	0,48	245 000	USD	APX Group 15/02/27, 6.75%	244 046	0,38
500 000	EUR	Tikehau CLO VIII DAC 25/10/34, variabel	508 208	0,80	250 000	USD	Arbor Realty Commercial Real Estate Notes 15/05/36, variabel	228 352	0,36
375 000	EUR	Vendome Funding CLO DAC 20/07/34, variabel	314 489	0,49	265 000	USD	Arconic 15/02/28, 6.13%	261 241	0,41
Israel			45 136	0,07	80 000	USD	Ardagh Holdings USA 15/08/26, 4.13%	74 708	0,12
52 000	USD	Wix.com 15/08/25, ZCP	45 136	0,07	103 000	USD	AREIT Trust 14/09/36, variabel	91 857	0,14
Japan			64 600	0,10	305 000	USD	ASP Unifrax Holdings 30/09/28, 5.25%	244 092	0,38
64 000	USD	Sumitomo Mitsui Financial Group 13/01/26, 5.46%	64 600	0,10	170 000	USD	AssuredPartners 15/01/29, 5.63%	147 107	0,23
Luxemburg			104 038	0,16	50 000	USD	Bausch Health 01/02/27, 6.13%	32 411	0,05
130 000	USD	ION Trading Technologies 15/05/28, 5.75%	104 038	0,16	55 000	USD	Bausch Health 01/06/28, 4.88%	32 500	0,05
Mexiko			151 056	0,24	49 000	USD	Beauty Health 01/10/26, 1.25%	41 038	0,06
200 000	USD	Braskem Idesa 20/02/32, 6.99%	151 056	0,24	375 000	USD	BellRing Brands 15/03/30, 7.00%	380 201	0,61
Singapur			79 722	0,12	57 000	USD	Bentley Systems 01/07/27, 0.38%	48 393	0,08
2 000	USD	Sea 01/12/25, 2.38%	2 449	-	12 000	USD	BILL Holdings 01/12/25, ZCP	11 034	0,02
98 000	USD	Sea 15/09/26, 0.25%	77 273	0,12	18 000	USD	BioMarin Pharmaceutical 01/08/24, 0.60%	18 513	0,03
Vereinigtes Königreich			210 601	0,33	309 999	USD	Blackbird Capital Aircraft 15/07/46, 2.44%	269 310	0,42
200 000	GBP	Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC 15/07/28, 4.88%	210 601	0,33	41 000	USD	Blackline 15/03/26, ZCP	34 953	0,05

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt- wert USD	% Netto- vermögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden		Markt- wert USD	% Netto- vermögen
11 000	USD		Block 01/05/26, ZCP	9 020	0,01	260 000	USD		Covanta Holding 01/12/29, 4.88%	231 611	0,36
370 000	USD		Bloomin' Brands 15/04/29, 5.13%	330 482	0,52	45 000	USD		Crocs 15/03/29, 4.25%	39 522	0,06
250 000	USD		BRSF 19/08/38, variabel	231 025	0,36	265 000	USD		CSC Holdings 01/02/28, 5.38%	217 806	0,34
50 000	USD		Cable One 15/03/26, ZCP	39 700	0,06	145 000	USD		CVR Energy 15/02/25, 5.25%	139 364	0,22
235 000	USD		Cablevision Lightpath 15/09/28, 5.63%	162 423	0,25	11 000	USD		Datadog 15/06/25, 0.13%	11 930	0,02
280 000	USD		Calpine 01/02/29, 4.63%	242 133	0,38	76 000	USD		DigitalOcean Holdings 01/12/26, ZCP	60 060	0,09
165 000	USD		Carnival 01/03/27, 5.75%	135 892	0,21	390 000	USD		Directv Financing 15/08/27, 5.88%	351 549	0,55
20 000	USD		Carnival 01/06/30, 10.50%	19 218	0,03	115 000	USD		DISH DBS 01/12/26, 5.25%	91 353	0,14
500 354	USD		Castlelake Aircraft Structured Trust 2017-1R 15/08/41, 2.74%	447 816	0,71	50 000	USD		DISH DBS 01/12/28, 5.75%	37 406	0,06
120 000	USD		CCO Holdings 01/02/28, 5.00%	110 846	0,17	85 000	USD		Edgewell Personal Care 01/04/29, 4.13%	74 566	0,12
200 000	USD		CCO Holdings 01/09/29, 6.38%	191 180	0,30	24 000	USD		Enphase Energy 01/03/28, ZCP	25 003	0,04
45 000	USD		Ceridian HCM Holding 15/03/26, 0.25%	40 586	0,06	16 000	USD		Etsy 15/06/28, 0.25%	13 325	0,02
67 000	USD		Charles Schwab 13/05/26, variabel	63 871	0,10	9 000	USD		Exact Sciences 15/03/27, 0.38%	8 419	0,01
80 000	USD		Citgo Holding 01/08/24, 9.25%	80 226	0,13	125 000	USD		Fertitta Entertainment 15/01/29, 4.63%	109 813	0,17
330 000	USD		CITGO Petroleum 15/06/25, 7.00%	325 900	0,51	90 000	USD		Fertitta Entertainment 15/01/30, 6.75%	74 127	0,12
65 000	USD		Citigroup 01/06/24, variabel	64 981	0,10	405 000	USD		FirstCash 01/01/30, 5.63%	374 167	0,60
220 000	USD		Cloud Software Group Holdings 31/03/29, 6.50%	194 273	0,30	400 000	USD		FMC GMSR Issuer Trust 25/07/26, variabel	343 724	0,54
40 000	USD		Cloudflare 15/08/26, ZCP	33 980	0,05	24 000	USD		Ford Motor 15/03/26, ZCP	24 096	0,04
280 000	USD		Cogent Communications Group 15/06/27, 7.00%	277 928	0,44	160 000	USD		Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/08/27, 9.75%	168 966	0,26
45 000	USD		CommScope 01/07/28, 7.13%	33 245	0,05	195 000	USD		Fortress Transportation and Infrastructure Investors 01/05/28, 5.50%	178 144	0,28
225 000	USD		CommScope 01/09/29, 4.75%	187 763	0,29	210 000	USD		Frontier Communications Holdings 01/05/28, 5.00%	182 465	0,29
145 000	USD		CommScope Technologies 15/06/25, 6.00%	136 697	0,21	170 000	USD		Frontier Communications Holdings 01/05/29, 6.75%	134 890	0,21
145 000	USD		Community Health Systems 15/03/27, 5.63%	127 446	0,20	500 000	USD		FS Rialto Issuer 17/08/37, variabel	494 385	0,78
30 000	USD		Community Health Systems 15/01/29, 6.00%	25 407	0,04	45 000	USD		General Motors Financial 08/03/24, variabel	44 671	0,07
420 000	USD		Compass Group Diversified Holdings 15/04/29, 5.25%	369 998	0,58	40 000	USD		Goldman Sachs Group 29/09/25, variabel	38 815	0,06
35 000	USD		Comstock Resources 15/01/30, 5.88%	30 102	0,05	195 000	USD		Graham Packaging 15/08/28, 7.13%	168 809	0,26
380 000	USD		Consolidated Communications 01/10/28, 6.50%	275 776	0,43						
335 000	USD		Coty 15/04/26, 6.50%	333 663	0,52						

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
305 000	USD	Gray Television 15/10/30, 4.75%	202 825	0,32	25 000	USD	NCR 01/10/28, 5.00%	22 000	0,03
23 000	USD	Haemonetics 01/03/26, ZCP	19 630	0,03	245 000	USD	NCR 15/04/29, 5.13%	212 246	0,33
40 000	USD	Harley-Davidson Financial Services 08/06/25, 3.35%	38 206	0,06	160 000	USD	NCR 01/09/29, 6.13%	157 963	0,25
200 000	USD	HAT Holdings I 15/04/25, 6.00%	192 239	0,30	180 000	USD	Necessity Retail Real Estate Investment Trust 30/09/28, 4.50%	134 843	0,21
130 000	USD	HAT Holdings I 15/06/26, 3.38%	112 928	0,18	245 000	USD	Neptune Bidco US 15/04/29, 9.29%	227 385	0,36
350 000	USD	Hawaiian Brand Intellectual Property 20/01/26, 5.75%	332 717	0,52	50 000	USD	Nexstar Media 01/11/28, 4.75%	44 527	0,07
170 000	USD	Hess Midstream Operations 15/06/28, 5.13%	161 563	0,25	28 000	USD	NextEra Energy Partners 15/06/24, ZCP	26 138	0,04
350 000	USD	Hunt 15/04/29, 5.25%	273 982	0,43	185 000	USD	NFP 15/08/28, 4.88%	167 105	0,26
10 000	USD	Hyundai Capital America 30/03/26, 5.50%	10 019	0,02	52 000	USD	Nutanix 01/10/27, 0.25%	43 595	0,07
25 000	USD	iHeartCommunications 01/05/27, 8.38%	18 250	0,03	52 000	USD	NuVasive 15/03/25, 0.38%	46 046	0,07
365 000	USD	iHeartCommunications 15/08/27, 5.25%	298 738	0,47	56 000	USD	Okta 15/06/26, 0.38%	47 936	0,08
44 000	USD	Intel 10/02/26, 4.88%	44 550	0,07	275 000	USD	Olympus Water US Holding 01/10/28, 4.25%	227 833	0,36
185 000	USD	Iron Mountain 15/03/28, 5.25%	176 480	0,28	290 000	USD	OneMain Finance 15/03/26, 7.13%	279 067	0,44
180 000	USD	Iron Mountain 15/07/28, 5.00%	167 691	0,26	330 000	USD	Pediatrix Medical Group 15/02/30, 5.38%	299 033	0,47
305 000	USD	JB Poindexter 15/04/26, 7.13%	286 279	0,45	40 000	USD	Penske Truck Leasing 15/07/25, 4.00%	38 759	0,06
63 000	USD	JetBlue Airways 01/04/26, 0.50%	48 636	0,08	50 000	USD	Perficient 15/11/26, 0.13%	39 974	0,06
145 000	USD	LABL 01/11/28, 5.88%	129 053	0,20	205 000	USD	Performance Food Group 15/10/27, 5.50%	200 597	0,31
245 000	USD	Legends Hospitality Holding 01/02/26, 5.00%	219 491	0,34	125 000	USD	Permian Resources Operating 15/02/26, 7.75%	125 468	0,20
375 000	USD	Level 3 Financing 01/07/28, 4.25%	211 959	0,33	360 000	USD	Pike 01/09/28, 5.50%	315 382	0,49
6 000	USD	LivaNova USA 15/12/25, 3.00%	6 057	0,01	200 000	USD	Post Holdings 15/01/28, 5.63%	196 186	0,31
340 000	USD	Medline Borrower 01/10/29, 5.25%	295 313	0,46	420 000	USD	Prime Security Services Borrower 15/01/28, 6.25%	393 095	0,63
295 000	USD	Minerals Technologies 01/07/28, 5.00%	270 360	0,42	293 416	USD	PRPM 25/06/26, variabel	232 317	0,36
67 000	USD	Mondelez International Holdings Netherlands 15/09/25, 4.25%	66 447	0,10	200 000	USD	PRPM 25/09/26, variabel	170 147	0,27
26 000	USD	MP Materials 01/04/26, 0.25%	24 561	0,04	85 000	USD	Rocket Mortgage 15/10/26, 2.88%	76 451	0,12
155 000	USD	MPH Acquisition Holdings 01/09/28, 5.50%	124 465	0,20	65 000	USD	Sabine Pass Liquefaction 01/03/25, 5.63%	65 419	0,10
296 829	USD	Natixis Commercial Mortgage Securities Trust 15/03/35, variabel	280 470	0,44	394 841	USD	Santander Bank Mortgage Credit-Linked Notes 26/02/52, variabel	394 685	0,63
					165 000	USD	SEG Holding 15/10/28, 5.63%	156 831	0,25
					59 000	USD	Shake Shack 01/03/28, ZCP	43 174	0,07
					40 000	USD	Shift4 Payments 01/08/27, 0.50%	37 940	0,06

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Oaktree Credit (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
240 000	USD	Six Flags Entertainment 15/04/27, 5.50%	232 884	0,36
195 000	USD	SK Invictus Intermediate II 30/10/29, 5.00%	162 107	0,25
58 000	USD	Snap 01/03/28, 0.13%	40 977	0,06
335 000	USD	Spirit AeroSystems 15/04/25, 7.50%	335 328	0,53
72 000	USD	Splunk 15/06/27, 1.13%	61 884	0,10
99 000	USD	Spotify USA 15/03/26, ZCP	83 358	0,13
20 000	USD	Sprint 15/09/23, 7.88%	20 165	0,03
55 000	USD	Standard Industries 15/01/28, 4.75%	51 458	0,08
170 000	USD	Standard Industries 15/07/30, 4.38%	148 092	0,23
160 000	USD	Suburban Propane Partners 01/06/31, 5.00%	139 996	0,22
55 000	USD	Tenet Healthcare 01/02/27, 6.25%	54 148	0,08
325 000	USD	Tenet Healthcare 01/10/28, 6.13%	310 887	0,49
52 000	USD	T-Mobile USA 15/02/26, 2.25%	48 416	0,08
95 000	USD	TMS International 15/04/29, 6.25%	73 352	0,11
40 000	USD	Tronox 15/03/29, 4.63%	33 479	0,05
105 000	USD	Uber Technologies 15/09/27, 7.50%	108 379	0,17
110 000	USD	Uber Technologies 15/01/28, 6.25%	109 836	0,17
370 000	USD	United States Treasury Bill 06/04/23, ZCP	369 778	0,58
71 000	USD	Unity Software 15/11/26, ZCP	55 345	0,09
180 000	USD	Univision Communications 01/06/27, 6.63%	170 838	0,27
165 000	USD	Univision Communications 30/06/30, 7.38%	156 146	0,24
80 000	USD	US Foods 01/06/30, 4.63%	72 225	0,11
382 550	USD	Verus Securitization Trust 25/08/67, variabel	375 447	0,60
400 000	USD	Verus Securitization Trust 25/08/67, variabel	371 104	0,58
370 000	USD	VM Consolidated 15/04/29, 5.50%	328 080	0,51
189 000	USD	VMC Finance 16/06/36, variabel	175 388	0,27
455 000	USD	VMC Finance Series 2021- FL4 16/06/36, variabel	430 526	0,68

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
49 000	USD	Warnermedia Holdings 15/03/25, 3.64%	47 340	0,07
370 000	USD	Wash Multifamily Acquisition 15/04/26, 5.75%	350 523	0,55
375 000	USD	Watco 15/06/27, 6.50%	351 976	0,55
85 000	USD	Xerox Holdings 15/08/25, 5.00%	80 113	0,13
115 000	USD	Xerox Holdings 15/08/28, 5.50%	99 651	0,16
11 000	USD	Zscaler 01/07/25, 0.13%	11 655	0,02
Summe Anleihen			45 793 043	71,77
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			45 793 043	71,77

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
Kaimaninseln			692 132	1,08
787 079	USD	Horizon Aircraft Finance I 15/12/38, 4.46%	692 132	1,08
Irland			1 164 789	1,83
500 000	EUR	Dryden 27 R Euro CLO DAC 15/04/33, variabel	453 543	0,71
250 000	EUR	ICG Euro CLO DAC 15/05/35, variabel	226 873	0,36
500 000	EUR	ICG Euro CLO DAC Series 2022-1A 15/05/35, variabel	484 373	0,76
USA			838 813	1,31
100 000	EUR	Darling Global Finance 15/05/26, 3.63%	105 707	0,17
750 000	USD	Voya CLO 20/10/34, variabel	733 106	1,14
Summe Anleihen			2 695 734	4,22
Summe sonstige Wertpapiere			2 695 734	4,22
Summe Kapitalinvestitionen			61 057 670	95,69
Sonstiges Nettovermögen			2 747 117	4,31
Nettoinventarwert			63 804 787	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Aktien				
Schweiz			9 538 348	5,03
135 219	USD	Alcon	9 538 348	5,03
Vereinigtes Königreich			640 158	0,34
9 529	USD	Endava	640 158	0,34
USA			131 404 637	69,27
18 164	USD	Abbott Laboratories	1 839 287	0,97
33 331	USD	Activision Blizzard	2 852 800	1,50
11 247	USD	Adobe	4 334 256	2,28
12 086	USD	agilon health	287 043	0,15
27 207	USD	American Express	4 487 795	2,37
28 320	USD	Analog Devices	5 585 270	2,94
3 316	USD	AptarGroup	391 918	0,21
113 181	USD	Boston Scientific	5 662 445	2,98
21 456	USD	Comerica	931 620	0,49
13 016	USD	Constellation Brands	2 940 184	1,55
4 465	USD	CyberArk Software	660 731	0,35
3 845	USD	Danaher	969 094	0,51
93 022	USD	Delta Air Lines	3 248 328	1,71
5 192	USD	DuPont de Nemours	372 630	0,20
22 223	USD	Eaton	3 807 689	2,01
9 612	USD	Eli Lilly	3 300 953	1,74
34 733	USD	Fifth Third Bancorporation	925 287	0,49
1 841	USD	HCA Healthcare	485 435	0,26
13 530	USD	HEICO	1 838 727	0,97
11 174	USD	Hess	1 478 767	0,78
7 279	USD	Inari Medical	449 405	0,24
4 705	USD	Intuit	2 097 630	1,11
18 639	USD	Keysight Technologies	3 009 826	1,59
18 760	USD	Lantheus Holdings	1 548 826	0,82
2 348	USD	Linde	834 573	0,44
11 924	USD	LPL Financial Holdings	2 413 418	1,27
41 605	USD	Medtronic	3 354 195	1,77
12 431	USD	Microsoft	3 583 857	1,89
25 645	USD	Nabors Industries	3 126 382	1,65
4 047	USD	Natera	224 689	0,12
4 919	USD	NextEra Energy	379 157	0,20
216 462	USD	Norwegian Cruise Line Holdings	2 911 414	1,53
13 136	USD	Occidental Petroleum	820 080	0,43
15 340	USD	Option Care Health	487 352	0,26
52 415	USD	PACCAR	3 836 778	2,02
76 571	USD	PacWest Bancorporation	745 036	0,39
4 314	USD	Palo Alto Networks	861 678	0,45

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
41 707	USD	Pfizer	1 701 646	0,90
98 887	USD	Portillo's	2 113 215	1,11
50 201	USD	Regions Financial	931 731	0,49
21 082	USD	Roper Technologies	9 290 627	4,89
31 753	USD	S&P Global	10 947 481	5,76
55 133	USD	Schlumberger	2 707 030	1,43
12 917	USD	Sherwin-Williams	2 903 354	1,53
14 318	USD	Silgan Holdings	768 447	0,41
39 365	USD	Southwest Airlines	1 280 937	0,68
8 340	USD	Splunk	799 639	0,42
12 715	USD	Tenable Holdings	604 090	0,32
11 030	USD	Tenet Healthcare	655 403	0,35
21 366	USD	Texas Instruments	3 974 290	2,10
17 334	USD	Union Pacific	3 488 641	1,84
26 024	USD	US Bancorporation	938 165	0,49
2 104	USD	Vulcan Materials	360 962	0,19
16 130	USD	Waste Connections	2 243 199	1,18
125 829	USD	Wells Fargo	4 703 488	2,48
18 920	USD	Workday	3 907 737	2,06
Summe Aktien			141 583 143	74,64
Anleihen				
USA			1 992 781	1,05
2 111 000	USD	TransDigm 15/11/27, 5,50%	1 992 781	1,05
Summe Anleihen			1 992 781	1,05
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			143 575 924	75,69
Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
USA			41 365 666	21,81
3 741 000	USD	NCL 15/03/26, 5,88%	3 183 853	1,68
2 515 000	USD	Royal Caribbean Cruises 31/08/26, 5,50%	2 355 813	1,24
36 000 000	USD	United States Treasury Bill 11/05/23, ZCP	35 826 000	18,89
Summe Anleihen			41 365 666	21,81
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			41 365 666	21,81
Summe Kapitalinvestitionen			184 941 590	97,50
Sonstiges Nettovermögen			4 744 985	2,50
Nettoinventarwert			189 686 575	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert GBP	% Netto- vermögen
Aktien				
Vereinigtes Königreich			2 787 303	8,93
1 296 958	GBP	Comptoir Group	74 575	0,24
547 250	GBP	Everyman Media Group	363 921	1,17
746 167	GBP	Harworth Group	809 592	2,59
170 003	GBP	Team17 Group	646 011	2,07
268 314	GBP	TT Electronics	502 284	1,61
58 000	GBP	Vp	390 920	1,25
Summe Aktien			2 787 303	8,93
Anleihen				
Vereinigtes Königreich			17 678 952	56,64
5 900 000	GBP	United Kingdom Gilt 22/07/23, 0.75%	5 842 067	18,72
4 600 000	GBP	United Kingdom Gilt 07/09/23, 2.25%	4 563 715	14,62
6 850 000	GBP	United Kingdom Gilt 31/01/24, 0.13%	6 643 130	21,28
650 000	GBP	United Kingdom Gilt 22/04/24, 1.00%	630 040	2,02
Summe Anleihen			17 678 952	56,64
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			20 466 255	65,57

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert GBP	% Netto- vermögen
Anleihen				
Vereinigtes Königreich			10 726 374	34,37
1 500 000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 26/06/23, ZCP	1 486 307	4,76
1 500 000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 10/07/23, ZCP	1 483 883	4,75
2 000 000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 04/09/23, ZCP	1 965 081	6,30
5 900 000	GBP	United Kingdom Treasury Bill 11/09/23, ZCP	5 791 103	18,56
Summe Anleihen			10 726 374	34,37
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden			10 726 374	34,37
Summe Kapitalinvestitionen			31 192 629	99,94
Sonstiges Nettovermögen			18 850	0,06
Nettoinventarwert			31 211 479	100,00

* Für Einzelheiten zu den während des Berichtszeitraums vorgenommenen Kapitalmassnahmen wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen. Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
Deutschland			70 782	0,02
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/39, 4.25%	13 455	0,01
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/40, 4.75%	14 344	0,01
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/42, 3.25%	12 178	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 04/07/44, 2.50%	11 032	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/46, 2.50%	11 116	-
10 000	EUR	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe 15/08/48, 1.25%	8 657	-
USA			24 591	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/45, 2.50%	7 968	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/45, 3.00%	8 695	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/02/46, 2.50%	7 928	-
Summe Anleihen			95 373	0,02
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			95 373	0,02

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregeltten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
USA			49 360 846	8,73
25 000 000	USD	United States Treasury Bill 09/05/23, ZCP	24 877 556	4,40
25 000 000	USD	United States Treasury Bill 21/09/23, ZCP	24 458 174	4,33
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/08/45, 2.88%	8 508	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/11/45, 3.00%	8 684	-
10 000	USD	United States Treasury Note/Bond 15/05/46, 2.50%	7 924	-
Summe Anleihen			49 360 846	8,73
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregeltten Markt gehandelt werden			49 360 846	8,73

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Investitionen	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Luxemburg				
5 000 000	USD	JPMorgan Liquidity Funds-US Dollar Treasury Liquidity Fund	5 000 000	0,88
Summe der Anteile an offenen Organismen für gemeinsame Investitionen			5 000 000	0,88
Summe Kapitalinvestitionen			54 456 219	9,63

Termineinlagen				
Finanzen			304 885 000	53,96
75 000 000	USD	Banque 03/04/23, 4.80%	75 000 000	13,28
75 000 000	USD	Credit Agricole 03/04/23, 4.80%	75 000 000	13,27
22 000 000	USD	Mizuho Bank 03/04/23, 4.82%	22 000 000	3,89
57 885 000	USD	Rabobank 03/04/23, 4.79%	57 885 000	10,24
75 000 000	USD	Toronto-Dominion Bank 03/04/23, 4.81%	75 000 000	13,28
Summe Termineinlagen			304 885 000	53,96
Sonstiges Nettovermögen			205 715 473	36,41
Nettoinventarwert			565 056 692	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Aktien				
Australien			989 498	0,15
172 648	GBP	Glencore	989 498	0,15
Österreich			3 427 444	0,51
31 251	EUR	Addiko Bank	491 430	0,07
54 261	EUR	BAWAG Group	2 628 065	0,39
9 310	EUR	Erste Group Bank	307 949	0,05
Belgien			3 217 905	0,48
37 335	EUR	KBC Group	2 563 005	0,38
7 325	EUR	UCB	654 900	0,10
Bermuda			283 610	0,05
7 062	USD	Seadrill	283 610	0,05
Brasilien			719 706	0,11
230 353	USD	Banco Bradesco	603 524	0,09
224 756	BRL	Hapvida Participacoes e Investimentos	116 182	0,02
Burkina Faso			53 717	0,01
2 229	CAD	Endeavour Mining	53 717	0,01
Kamerun			100 246	0,01
4 641	USD	Golar LNG	100 246	0,01
Kanada			13 000 728	1,93
93 832	CAD	Advantage Energy	542 233	0,08
158 235	CAD	ARC Resources	1 794 852	0,27
88 688	USD	Barrick Gold	1 646 936	0,24
22 167	USD	Canadian Natural Resources	1 226 943	0,18
104 422	USD	Cenovus Energy	1 823 209	0,27
3 200	USD	Clementia Pharmaceuticals	-	-
93 592	CAD	Enerplus	1 348 999	0,20
68 876	CAD	Foran Mining	201 302	0,03
66 440	CAD	Headwater Exploration	310 201	0,05
1 877	CAD	Intact Financial	268 627	0,04
3 109	CAD	Ivanhoe Mines	28 088	-
1 908	CAD	MEG Energy	30 649	-
63 805	CAD	NuVista Energy	516 011	0,08
5 489	USD	Pan American Silver	99 900	0,01
20 127	CAD	Parex Resources	374 393	0,06
104 959	CAD	Peyto Exploration & Development	940 476	0,14
6 684	CAD	Royal Bank of Canada	639 221	0,10
5 024	USD	Shopify	240 851	0,04
4 638	USD	Suncor Energy	144 010	0,02
15 791	CAD	Tourmaline Oil	658 046	0,10

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
5 788	CAD	Vecima Networks	98 501	0,01
4 431	CAD	Vermilion Energy	57 474	0,01
274	USD	Xenon Pharmaceuticals	9 806	-
China			8 890 116	1,32
7 862	TWD	Airtac International Group	305 985	0,05
255 078	HKD	Alibaba Group Holding	3 262 439	0,49
21 943	CNH	Amoy Diagnostics	89 840	0,01
100 218	HKD	Anhui Conch Cement	347 257	0,05
17 145	HKD	Baidu	324 776	0,05
8 949	HKD	China National Building Material	7 342	-
5 880	CNH	China Railway Group	5 886	-
160 062	HKD	China Vanke	252 432	0,04
14 481	CNH	Contemporary Amperex Technology	855 517	0,14
15 446	HKD	Country Garden Holdings	4 349	-
6 859	HKD	Ganfeng Lithium Group	42 640	0,01
3 350	CNH	Ganfeng Lithium Group	32 398	-
951	CNH	Guangzhou Tinci Materials Technology	5 806	-
1 500	CNH	Hangzhou Tigermed Consulting	20 888	-
44 768	HKD	Hope Education Group	3 536	-
33 000	HKD	Innovent Biologics	147 766	0,02
57 000	HKD	Li Ning	449 471	0,07
178 204	HKD	Lifetech Scientific	63 337	0,01
1 090	HKD	Meituan	19 926	-
650	HKD	Ping An Insurance Group of China	4 231	-
47 505	HKD	Remegen	253 262	0,04
1 960	CNH	Sany Heavy Industry	4 874	-
184 200	HKD	Shandong Weigao Group Medical Polymer	294 254	0,04
213 249	CNH	Sinoma Science & Technology	748 678	0,11
7 300	HKD	Tencent Holdings	358 774	0,05
145 500	HKD	Venus MedTech Hangzhou	199 439	0,03
35 100	HKD	WuXi AppTec	367 549	0,05
873	HKD	XPeng	4 866	-
240	CNH	Yunnan Energy New Material	3 974	-
11 927	USD	Zai Lab	396 692	0,06
1 132	CNH	Zhejiang HangKe Technology	7 379	-

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
5 039	CNH	Zoomlion Heavy Industry Science & Technology	4 553	-
Dänemark			1 697 285	0,25
5 629	USD	Ascendis Pharma	603 541	0,09
570	DKK	Genmab	214 828	0,03
21 753	DKK	Vestas Wind Systems	630 168	0,09
7 955	DKK	Zealand Pharma	248 748	0,04
Finnland			2 351 786	0,35
8 604	EUR	Metso Outotec	93 684	0,01
99 366	EUR	Nordea Bank Abp	1 060 706	0,16
107 769	SEK	Nordea Bank Abp	1 148 815	0,17
5 156	EUR	Wartsila Abp	48 581	0,01
Frankreich			7 173 218	1,07
165 066	EUR	ALD	1 933 352	0,30
26 840	EUR	BNP Paribas	1 607 052	0,24
2 003	EUR	Dassault Aviation	396 653	0,06
94 211	EUR	Engie	1 489 052	0,22
5 567	EUR	Publicis Groupe	433 365	0,06
15 012	EUR	Technip Energies	319 994	0,05
10 737	EUR	TotalEnergies	632 983	0,09
28 628	EUR	Vallourec	360 767	0,05
Deutschland			8 368 562	1,24
3 692	EUR	Bayer	235 113	0,03
133 750	EUR	Commerzbank	1 407 293	0,21
91 786	EUR	Deutsche Bank	931 314	0,14
5 477	EUR	Hensoldt	197 202	0,03
33 556	USD	Immatics	231 536	0,03
27 871	EUR	Infineon Technologies	1 138 919	0,17
2 070	EUR	Rheinmetall	614 209	0,09
7 231	EUR	Siemens	1 170 500	0,17
51 145	EUR	Talanx	2 368 431	0,36
457	EUR	Wacker Chemie	74 045	0,01
Griechenland			840 429	0,12
97 111	EUR	Public Power	840 429	0,12
Hongkong			2 854 516	0,42
187 495	HKD	AIA Group	1 974 097	0,29
14 100	HKD	Hong Kong Exchanges & Clearing	625 437	0,09
20 030	USD	Melco Resorts & Entertainment	254 982	0,04
Indien			1 932 304	0,29
133 785	INR	Axis Bank	1 396 739	0,21
49 297	INR	Bharti Airtel	450 186	0,07
15 192	USD	ReNew Energy Global	85 379	0,01

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Irland			4 787 758	0,71
911 363	EUR	AIB Group	3 698 492	0,55
161 316	EUR	Irish Continental Group	763 645	0,11
6 718	USD	Prothena	325 621	0,05
Italien			6 975 444	1,04
10 227	EUR	BFF Bank	101 484	0,02
5 113	EUR	DiaSorin	538 202	0,08
126 241	EUR	FinecoBank Banca Fineco	1 935 884	0,29
233 030	EUR	UniCredit	4 399 874	0,65
Japan			10 904 090	1,62
9 124	JPY	Astellas Pharma	129 396	0,02
10 300	JPY	Bank of Kyoto	484 843	0,07
194	JPY	Calbee	4 049	-
129 900	JPY	Chiba Bank	836 487	0,12
32 635	JPY	Chugai Pharmaceutical	803 739	0,12
34 300	JPY	Concordia Financial Group	126 066	0,02
23 932	JPY	Daiichi Sankyo	869 140	0,13
2 789	JPY	Daikin Industries	496 884	0,07
12 600	JPY	Ebara	581 721	0,09
7 932	JPY	Eisai	448 290	0,07
4 155	JPY	Hitachi	226 941	0,03
10 100	JPY	Japan Steel Works	188 574	0,03
170 700	JPY	Mitsubishi UFJ Financial Group	1 090 088	0,16
89 355	JPY	Nikon	911 889	0,14
569	JPY	Nippon Shinyaku	24 984	-
488	JPY	Nippon Television Holdings	4 194	-
2 230	JPY	Ono Pharmaceutical	46 422	0,01
35 685	JPY	Panasonic Holdings	317 678	0,05
3 959	JPY	Rohm	327 096	0,05
18 000	JPY	Sanken Electric	1 431 594	0,21
207	JPY	Seria	4 088	-
43 100	JPY	Shiga Bank	869 628	0,13
4 800	JPY	Shiseido	223 452	0,03
3 700	JPY	Sony Group	333 982	0,05
9 400	JPY	T&D Holdings	116 177	0,02
200	JPY	Taiyo Yuden	6 688	-
Jersey			1 515 753	0,23
33 781	USD	WisdomTree Brent Crude Oil	1 515 753	0,23
Jordanien			44 983	0,01
2 177	GBP	Hikma Pharmaceuticals	44 983	0,01
Mexiko			771 284	0,11
83 811	GBP	Fresnillo	771 284	0,11

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Niederlande			7 909 719	1,18
140	EUR	Adyen	221 550	0,03
2 665	USD	Argenx	992 926	0,15
30 475	EUR	ASR Nederland	1 214 262	0,18
39 373	EUR	EXOR	3 238 370	0,48
20 725	USD	Merus	381 340	0,06
65 359	GBP	Shell	1 861 271	0,28
Norwegen			74 095	0,01
44 536	NOK	Aker Carbon Capture	62 849	0,01
12 201	NOK	PGS	11 246	-
Philippinen			5 070	-
2 996	PHP	Security Bank	5 070	-
Singapur			1 261 104	0,19
82 296	SGD	AEM Holdings	196 650	0,03
47 600	SGD	United Overseas Bank	1 064 454	0,16
Südafrika			1 240 528	0,18
37 551	GBP	Anglo American	1 240 528	0,18
Südkorea			1 677 750	0,25
34 125	KRW	Samsung Electronics	1 677 612	0,25
1	KRW	SK Innovation	138	-
Spanien			1 575 221	0,23
203 411	EUR	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria	1 449 558	0,21
12 722	EUR	Grifols	125 663	0,02
Schweden			412 316	0,06
36 007	SEK	Hexagon	412 316	0,06
Schweiz			4 768 528	0,71
9 161	CHF	Alcon	647 813	0,10
4 254	CHF	Cie Financiere Richemont	678 352	0,10
10 129	CHF	Julius Baer Group	689 917	0,10
91	CHF	Lonza Group	54 444	0,01
11 725	CHF	Novartis	1 073 377	0,16
599	CHF	Tecan Group	261 348	0,04
64 662	CHF	UBS Group	1 363 277	0,20
Taiwan			965 102	0,14
162 997	TWD	Unimicron Technology	789 623	0,11
101 000	TWD	United Microelectronics	175 479	0,03
Thailand			259 922	0,04
1 771	USD	Fabrinet	210 324	0,03
12 800	THB	Kasikornbank	49 598	0,01
Vereinigtes Königreich			13 660 354	2,03
19 525	USD	Abcam	262 807	0,04
33 271	GBP	Admiral Group	836 458	0,12
41 754	EUR	Allfunds Group	275 316	0,04
17 000	GBP	AstraZeneca	2 355 484	0,34

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
27 395	GBP	BP	172 622	0,03
51 464	GBP	British American Tobacco	1 803 320	0,27
43 492	EUR	CNH Industrial	664 112	0,10
28 683	GBP	Cranswick	1 062 916	0,16
4 480	GBP	Entain	69 441	0,01
5 924	GBP	Genus	210 028	0,03
8 105	GBP	IMI	153 374	0,02
2 469	USD	Immunocore Holdings	122 067	0,02
20 568	GBP	Imperial Brands	472 947	0,07
104 730	GBP	John Wood Group	258 390	0,04
13 528	GBP	London Stock Exchange Group	1 313 023	0,20
108 705	USD	Nomad Foods	2 037 132	0,30
20 665	GBP	Persimmon	320 184	0,05
12 266	GBP	Smith & Nephew	169 774	0,03
35 362	NOK	Subsea 7	418 475	0,06
23 327	USD	TechnipFMC	318 414	0,05
18 131	USD	Verona Pharma	364 070	0,05
USA			155 550 711	23,12
9 355	USD	Abbott Laboratories	947 287	0,14
6 595	USD	Acadia Healthcare	476 489	0,07
38 260	USD	Aclaris Therapeutics	309 523	0,05
8 695	USD	Activision Blizzard	744 205	0,11
3 933	USD	AdaptHealth	48 887	0,01
3 663	USD	Addus HomeCare	391 062	0,06
560	USD	Advanced Micro Devices	54 886	0,01
11 410	USD	AES	274 753	0,04
786	USD	Agilent Technologies	108 735	0,02
8 975	USD	agilon health	213 156	0,03
7 147	USD	Akero Therapeutics	273 444	0,04
16 693	USD	Alkermes	470 576	0,07
4 940	USD	Alnylam Pharmaceuticals	989 581	0,15
1 656	USD	Alphabet	171 777	0,03
2 521	USD	Amazon.com	260 394	0,04
1 258	USD	Amedisys	92 526	0,01
24 688	USD	American Electric Power	2 246 361	0,33
21 576	USD	American Express	3 558 961	0,53
1 589	USD	AmerisourceBergen	254 415	0,04
6 238	USD	AMETEK	906 569	0,13
2 230	USD	Amicus Therapeutics	24 731	-
20 802	USD	Antero Midstream	218 213	0,03
7 565	USD	Apellis Pharmaceuticals	498 987	0,07
9 178	USD	Apollo Global Management	579 682	0,09
1 938	USD	Applied Industrial Technologies	275 448	0,04

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
837	USD	Aptiv	93 903	0,01	30 956	USD	Diamondback Energy	4 184 323	0,62
41 519	USD	Ares Management	3 464 345	0,51	14 015	USD	DocuSign	817 075	0,12
1 449	USD	Arista Networks	243 229	0,04	18 842	USD	Dominion Energy	1 053 456	0,16
16 149	USD	Atmos Energy	1 814 502	0,27	10 250	USD	DR Horton	1 001 323	0,15
9 411	USD	AtriCure	390 086	0,06	1 485	USD	Duke Energy	143 258	0,02
2 328	USD	Autodesk	484 596	0,07	4 130	USD	Edison International	291 537	0,04
4 066	USD	Avantor	85 955	0,01	532	USD	Edwards Lifesciences	44 012	0,01
35 440	USD	AZEK	834 258	0,12	21 442	USD	Elanco Animal Health	201 555	0,03
12 248	USD	Baker Hughes	353 477	0,05	1 229	USD	Elevance Health	565 106	0,08
10 428	USD	Bath & Body Works	381 456	0,06	5 453	USD	Eli Lilly	1 872 669	0,28
1 860	USD	Becton Dickinson	460 424	0,07	4 640	USD	Encompass Health	251 024	0,04
5 838	USD	Biogen	1 623 139	0,24	290	USD	Enphase Energy	60 981	0,01
1 171	USD	Bio-Techne	86 876	0,01	857	USD	Enstar Group	198 644	0,03
10 494	USD	Bioxcel Therapeutics	195 818	0,03	7 738	USD	Entergy	833 692	0,12
5 914	USD	BJ's Wholesale Club Holdings	449 878	0,07	1 370	USD	Enviva	39 566	0,01
13 963	USD	Block	958 560	0,14	35 900	USD	EOG Resources	4 115 217	0,61
5 791	USD	Blueprint Medicines	260 537	0,04	89 172	USD	EQT	2 845 479	0,42
197	USD	Booking Holdings	522 525	0,08	12 803	USD	Eversource Energy	1 001 963	0,15
7 600	USD	Boston Scientific	380 228	0,06	10 098	USD	Exact Sciences	684 745	0,10
15 533	USD	Builders FirstSource	1 379 020	0,20	63 971	USD	Exelon	2 679 745	0,40
19 786	USD	BWX Technologies	1 247 309	0,19	11 716	USD	Expro Group Holdings	215 106	0,03
2 883	USD	Cabot	220 953	0,03	7 093	USD	Exxon Mobil	777 818	0,12
28 294	USD	Cactus	1 166 562	0,17	40 811	USD	Federated Hermes	1 638 154	0,24
14 627	USD	Cargurus	273 232	0,04	347	USD	First Solar	75 473	0,01
1 699	USD	Celldex Therapeutics	61 130	0,01	2 019	USD	Five9	145 954	0,02
7 907	USD	Centene	499 801	0,07	2 105	USD	FleetCor Technologies	443 839	0,07
30 620	USD	CenterPoint Energy	902 065	0,13	15 597	USD	Flex	358 887	0,05
813	USD	Charter Communications	290 737	0,04	246	USD	Fluor-Preference	352 134	0,05
10 891	USD	Cheniere Energy	1 716 422	0,26	5 241	USD	FormFactor	166 926	0,02
39 855	USD	Chesapeake Energy	3 030 574	0,45	9 829	USD	Fortive	670 043	0,10
15 206	USD	Chord Energy	2 046 728	0,30	13 886	USD	Freeport-McMoRan	568 076	0,08
2 486	USD	Chubb	482 731	0,07	4 536	USD	Generac Holdings	489 933	0,07
1 089	USD	Civitas Resources	74 422	0,01	108 234	USD	Geron	234 868	0,03
7 248	USD	ConocoPhillips	719 074	0,11	2 518	USD	Glaukos	126 152	0,02
9 624	USD	Consolidated Edison	920 728	0,14	2 380	USD	GoDaddy	184 974	0,03
105 050	USD	Coterra Energy	2 577 927	0,38	13 491	USD	Goldman Sachs Group	4 413 042	0,66
16 204	USD	Crinetics Pharmaceuticals	260 236	0,04	7 024	USD	Green Plains	217 674	0,03
8 483	USD	CTI BioPharma	35 629	0,01	17 250	GBP	GSK	304 085	0,05
24 720	USD	Cytokinetics	869 897	0,13	5 915	USD	Gulfport Energy	473 200	0,07
2 820	USD	Danaher	710 753	0,11	301 658	GBP	Haleon	1 198 243	0,18
597	USD	Deere	246 489	0,04	7 833	USD	Hannon Armstrong Sustainable Infrastructure Capital	224 024	0,03
9 425	USD	Denali Therapeutics	217 152	0,03					
1 991	USD	Denbury	174 471	0,03	54 527	USD	Harmonic	795 549	0,12
555	USD	Dexcom	64 480	0,01	2 657	USD	HCA Healthcare	700 598	0,10
42 918	USD	Diamond Offshore Drilling	516 733	0,08	12 335	USD	Health Catalyst	143 949	0,02
					4 510	USD	Hologic	363 957	0,05

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
1 453	USD	Humana	705 373	0,10	10 626	USD	Nuvalent	277 232	0,04
142	USD	ICON	30 330	-	3 966	USD	NVIDIA	1 101 636	0,16
607	USD	IDEXX Laboratories	303 549	0,05	7 716	USD	ON Semiconductor	635 181	0,09
1 852	USD	Illumina	430 683	0,06	8 824	USD	Owens & Minor	128 389	0,02
53 444	USD	ImmunoGen	205 225	0,03	1 230	USD	Palo Alto Networks	245 680	0,04
2 126	USD	Inari Medical	131 259	0,02	781	USD	Paycom Software	237 432	0,04
2 524	USD	Incyte	182 409	0,03	10 719	USD	Pfizer	437 335	0,07
4 378	USD	Insulet	1 396 407	0,21	110 245	USD	PG&E	1 782 662	0,26
7 834	USD	Intel	255 937	0,04	1 686	USD	Phillips 66	170 927	0,03
3 512	USD	Intellia Therapeutics	130 892	0,02	11 749	USD	Portland General Electric	574 409	0,09
10 680	USD	Intra-Cellular Therapies	578 322	0,09	12 167	USD	ProFrac Holding	154 156	0,02
1 491	USD	Intuitive Surgical	380 906	0,06	1 560	USD	Progressive	223 174	0,03
7 246	USD	Johnson Controls International	436 354	0,06	448	USD	PTC Therapeutics	21 701	-
13 391	USD	JPMorgan Chase	1 744 981	0,26	2 661	USD	QuidelOrtho	237 068	0,04
4 889	USD	Karuna Therapeutics	888 038	0,13	27 999	USD	Range Resources	741 134	0,11
25 251	USD	KKR	1 326 183	0,20	493	USD	Regeneron Pharmaceuticals	405 083	0,06
367	USD	KLA	146 495	0,02	3 743	USD	Revolution Medicines	81 073	0,01
4 699	USD	Kymera Therapeutics	139 231	0,02	8 096	USD	Rice Acquisition II	82 863	0,01
1 554	USD	Laboratory of America Holdings	356 519	0,05	10 553	USD	Rice Acquisition II-XNYS	108 010	0,02
4 185	USD	Las Vegas Sands	240 428	0,04	20 464	USD	Rocket Pharmaceuticals	350 548	0,05
7 425	USD	Legend Biotech	358 034	0,05	39 959	USD	Roivant Sciences	294 897	0,04
5 793	USD	Lennar	608 902	0,09	725	USD	S&P Global	249 958	0,04
1 557	USD	Marathon Petroleum	209 930	0,03	9 095	USD	Sage Therapeutics	381 626	0,06
1 982	USD	MasTec	187 180	0,03	3 279	USD	Salesforce	655 079	0,10
12 156	USD	Merck	1 293 277	0,19	520	USD	Sarepta Therapeutics	71 672	0,01
3 529	USD	Meta Platforms	747 936	0,11	28 138	USD	Schlumberger	1 381 576	0,21
1 270	USD	Microsoft	366 141	0,05	1 442	EUR	Schneider Electric	240 332	0,04
917	USD	Mirati Therapeutics	34 094	0,01	4 870	USD	Seagen	986 029	0,15
953	USD	Moderna	146 362	0,02	1 092	USD	Sempra Energy	165 067	0,02
3 703	USD	Moody's	1 133 192	0,17	448	USD	ServiceNow	208 195	0,03
54 282	USD	Morgan Stanley	4 765 961	0,71	21 662	USD	Shoals Technologies Group	493 677	0,07
1 646	USD	Morphic Holding	61 955	0,01	4 693	USD	SiTime	667 485	0,10
30 526	USD	NanoString Technologies	302 207	0,04	35 867	USD	Sitio Royalties	810 594	0,12
20 269	USD	Navigator Holdings	283 766	0,04	10 051	USD	Skyline Champion	756 137	0,11
1 011	USD	Netflix	349 280	0,05	5 237	USD	SolarEdge Technologies	1 591 786	0,24
28 530	USD	Newmont	1 398 541	0,21	3 353	USD	Southern	233 302	0,03
17 198	USD	NextDecade	85 474	0,01	8 437	USD	Southwest Gas Holdings	526 891	0,08
29 957	USD	NextEra Energy	2 309 086	0,34	7 477	USD	Stanley Black & Decker	602 497	0,09
30 763	USD	NiSource	860 133	0,13	201	USD	Stryker	57 379	0,01
5 807	USD	Noble	229 202	0,03	4 259	USD	Super Micro Computer	453 796	0,07
14 522	USD	Northern Oil & Gas	440 743	0,07	11 700	USD	Surgery Partners	403 299	0,06
9 749	USD	NOV	180 454	0,03					

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
1 110	USD	Syndax Pharmaceuticals	23 443	-
7 197	USD	Syneos Health	256 357	0,04
1 718	USD	Take-Two Interactive Software	204 957	0,03
30 289	USD	Talos Energy	449 489	0,07
17 500	USD	Targa Resources	1 276 625	0,19
170	USD	Teleflex	43 063	0,01
270	USD	Thermo Fisher Scientific	155 620	0,02
2 141	USD	T-Mobile US	310 102	0,05
30 317	USD	Tradeweb Markets	2 395 649	0,36
13 176	USD	Uber Technologies	417 679	0,06
857	USD	Ulta Beauty	467 639	0,07
846	USD	Ultragenyx Pharmaceutical	33 925	0,01
2 438	USD	United Therapeutics	546 014	0,08
2 300	USD	UnitedHealth Group	1 086 957	0,16
10 159	USD	Valero Energy	1 418 196	0,21
900	USD	Vaxcyte	33 732	0,01
3 980	USD	Veeva Systems	731 484	0,11
7 000	USD	Veracyte	156 100	0,02
3 230	USD	Vertex Pharmaceuticals	1 017 676	0,15
10 221	USD	Vicor	479 774	0,07
22 880	USD	Viper Energy Partners	640 640	0,10
7 436	USD	Visa	1 676 521	0,25
6 584	USD	Walmart	970 811	0,14
1 679	USD	Waters	519 869	0,08
81 117	USD	Wells Fargo	3 032 153	0,45
8 776	USD	Westinghouse Air Brake Technologies	886 903	0,13
29 017	USD	Weyerhaeuser	874 282	0,13
133 540	USD	WisdomTree	782 544	0,12
3 870	USD	Workday	799 310	0,12
12 429	USD	Zillow Group	552 718	0,08
4 788	USD	Zoetis	796 915	0,12
7 821	USD	Zoom Video Communications	577 503	0,09
Summe Aktien			270 260 802	40,17
Anleihen				
Finnland			1 804 391	0,27
520 000	EUR	Finnair perpetual, 10,25%	499 087	0,07
1 360 000	EUR	Finnair perpetual *, 10,25%	1 305 304	0,20

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Frankreich			532 853	0,08
200 000	GBP	Dexia Credit Local 22/07/23, 0,50%	243 532	0,04
267 153	EUR	Vallourec 30/06/26, 8,50%	289 321	0,04
Deutschland			1 674 694	0,25
1 200 000	EUR	Allianz 07/09/38, variabel	1 269 860	0,19
400 000	EUR	Allianz 06/07/47, variabel	404 834	0,06
Ungarn			906 179	0,13
1 175 000	EUR	Hungary Government International Bond 18/11/30, 0,50%	906 179	0,13
Italien			1 932 968	0,29
1 765 000	EUR	Enel perpetual, variabel	1 932 968	0,29
Japan			6 468 917	0,96
470 579 784	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 10/03/29, 0,10%	3 703 679	0,55
353 033 208	JPY	Japanese Government CPI Linked Bond 10/03/31, 0,01%	2 765 238	0,41
Luxemburg			1 364 572	0,20
1 300 000	USD	ArcelorMittal 29/11/32, 6,80%	1 364 572	0,20
Mexiko			12 612 106	1,88
32 186 600	MXN	Mexican Bonos 26/05/33, 7,50%	1 629 541	0,24
2 420 835 400	MXN	Mexico Cetes 23/01/25, ZCP	10 982 565	1,64
Niederlande			1 890 496	0,28
1 740 000	EUR	Koninklijke KPN perpetual, variabel	1 890 496	0,28
Peru			2 480 541	0,37
2 530 000	PEN	Peru Government Bond 12/02/29, 5,94%	635 151	0,09
1 825 000	PEN	Peru Government Bond 12/08/32, 6,15%	443 624	0,07
6 280 000	PEN	Peru Government Bond 12/08/34, 5,40%	1 401 766	0,21
Rumänien			684 145	0,10
694 000	USD	Romanian Government International Bond 25/11/27, 5,25%	684 145	0,10
Südkorea			1 410 501	0,21
1 010 000	USD	Export-Import Bank of Korea 27/04/23, variabel	1 010 576	0,15
200 000	USD	Korea Development Bank 16/04/23, variabel	200 063	0,03
200 000	USD	Korea Development Bank 09/03/24, variabel	199 862	0,03

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Supranational			8 156 163	1,22
127 500 000	ZAR	Asian Development Bank 30/04/40, ZCP	1 382 342	0,21
16 000 000	TRY	European Bank for Reconstruction & Development 15/10/26, ZCP	355 087	0,05
40 000 000	MXN	European Bank for Reconstruction & Development 19/01/32, ZCP	693 452	0,10
5 110 000	EUR	European Union 04/07/34, 3.25%	5 634 593	0,85
7 200 000	TRY	International Finance 09/05/27, ZCP	90 689	0,01
Vereinigtes Königreich			4 036 694	0,60
320 000	GBP	AA Bond 31/07/29, 7.38%	379 470	0,06
2 295 000	EUR	British American Tobacco perpetual, variabel	1 860 175	0,28
460 000	GBP	Heathrow Funding 09/08/49, 2.75%	354 804	0,05
1 640 000	EUR	Vodafone Group 27/08/80, variabel	1 442 245	0,21
USA			499 886	0,07
500 000	USD	United States Treasury Note 31/10/23, variabel	499 886	0,07
Summe Anleihen			46 455 106	6,91
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassen sind			316 715 908	47,08

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
Kanada			28 099 902	4,18
500 000	CAD	CDP Financial 23/05/23, ZCP	367 534	0,05
400 000	USD	CDP Financial 26/06/23, ZCP	396 493	0,06
1 000 000	USD	CDP Financial 28/06/23, ZCP	988 676	0,15
1 750 000	CAD	City of Edmonton Canada 16/06/23, ZCP	1 282 743	0,20
400 000	CAD	City of Montreal Canada 11/05/23, 0.45%	294 758	0,04
1 000 000	CAD	City of Montreal Canada 01/09/23, 3.50%	736 730	0,11
1 178 000	CAD	City of Ottawa Ontario 05/04/23, ZCP	871 191	0,13

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
500 000	CAD	City of Ottawa Ontario 26/04/23, ZCP	368 816	0,05
500 000	CAD	City of Quebec Canada 01/05/23, 3.00%	369 458	0,05
310 000	CAD	City of Quebec Canada 25/09/23, 4.00%	228 698	0,03
700 000	CAD	City of Toronto Canada 29/09/23, 3.90%	516 339	0,08
700 000	CAD	Hydro Quebec Interest Strip 15/08/23, ZCP	509 659	0,08
600 000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 12/04/23, ZCP	443 341	0,07
1 000 000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 19/04/23, ZCP	738 253	0,11
500 000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 03/05/23, ZCP	368 477	0,05
500 000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 17/05/23, ZCP	367 834	0,05
400 000	CAD	Municipal Finance Authority of British Columbia Bills 31/05/23, ZCP	293 733	0,04
700 000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 06/04/23, ZCP	517 625	0,08
900 000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 27/04/23, ZCP	663 783	0,10
500 000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 18/05/23, ZCP	367 778	0,05
700 000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 25/05/23, ZCP	514 438	0,08
200 000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 15/06/23, ZCP	146 611	0,02
1 010 000	CAD	Newfoundland Treasury Bill 22/06/23, ZCP	739 799	0,11
1 250 000	CAD	Ontario Teachers' Finance Trust 01/08/23, ZCP	910 831	0,14
1 205 000	CAD	Ontario Treasury Bill 19/04/23, ZCP	889 645	0,13
2 275 000	CAD	Ontario Treasury Bill 26/04/23, ZCP	1 678 139	0,26
400 000	CAD	Ontario Treasury Bill 09/08/23, ZCP	291 174	0,04
500 000	CAD	Ontario Treasury Bill 06/09/23, ZCP	362 599	0,05
200 000	CAD	Ontario Treasury Bill 27/09/23, ZCP	144 776	0,02
1 500 000	CAD	Ontario Treasury Bill 18/10/23, ZCP	1 081 921	0,16

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen	Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelt Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
1 000 000	CAD	Prince Edward Island Treasury Note 30/05/23, ZCP	734 451	0,11	271 000 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 19/06/23, ZCP	2 041 922	0,30
1 000 000	CAD	Province of British Columbia 18/07/23, ZCP	726 319	0,11	218 050 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 26/06/23, ZCP	1 643 272	0,24
1 300 000	CAD	Province of British Columbia Canada Principal Strip 08/09/23, ZCP	943 876	0,14	305 200 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 03/07/23, ZCP	2 299 969	0,34
750 000	CAD	Province of Manitoba Canada Treasury Bill 12/04/23, ZCP	554 191	0,08	119 950 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 10/07/23, ZCP	903 658	0,13
1 520 000	CAD	Province of New Brunswick Canada Treasury Bill 20/04/23, ZCP	1 122 064	0,17	Macau			871 200	0,13
910 000	CAD	Quebec Treasury Bill 28/07/23, ZCP	663 705	0,10	800 000	USD	Wynn Macau 07/03/29, 4.50%	871 200	0,13
500 000	CAD	Quebec Treasury Bill 25/08/23, ZCP	363 117	0,05	Südkorea			2 721 725	0,40
500 000	CAD	Quebec Treasury Bill 01/09/23, ZCP	363 059	0,05	500 000	USD	Export-Import Bank of Korea 30/05/23, ZCP	495 731	0,07
425 000	CAD	Regional Municipality of York 25/05/23, ZCP	312 328	0,05	1 000 000	USD	Korea Development Bank 26/05/23, ZCP	993 010	0,14
3 595 000	CAD	Regional Municipality of York 14/06/23, ZCP	2 635 828	0,40	250 000	USD	Korea Development Bank 07/07/23, ZCP	246 699	0,04
550 000	CAD	Regional Municipality of York 23/06/23, ZCP	402 708	0,06	1 000 000	USD	Korea Development Bank * 07/07/23, ZCP	986 285	0,15
1 480 000	CAD	Saskatchewan Canada Coupon Strip 11/04/23, ZCP	1 093 737	0,16	Schweiz			1 802 306	0,27
1 000 000	CAD	Saskatchewan Canada Coupon Strip 20/06/23, ZCP	732 667	0,11	1 867 000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7.25%	-	-
Japan			30 103 092	4,47	200 000	USD	Credit Suisse Group perpetual, 7.50%	-	-
686 500 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 04/04/23, ZCP	5 170 448	0,78	325 000	USD	Credit Suisse Group perpetual *, 7.50%	-	-
209 700 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 10/04/23, ZCP	1 579 409	0,23	650 000	CHF	Switzerland Treasury Bill 13/04/23, ZCP	710 200	0,11
53 950 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 17/04/23, ZCP	406 350	0,06	500 000	CHF	Switzerland Treasury Bill 20/04/23, ZCP	546 188	0,08
172 650 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 20/04/23, ZCP	1 300 435	0,19	500 000	CHF	Switzerland Treasury Bill 04/05/23, ZCP	545 918	0,08
309 800 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 24/04/23, ZCP	2 333 505	0,35	USA			154 966 734	23,04
321 200 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 08/05/23, ZCP	2 419 510	0,36	1 415 000	USD	Airbnb 15/03/26, ZCP	1 240 955	0,18
366 450 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 15/05/23, ZCP	2 760 461	0,41	680 000	USD	Carnival 01/12/27, 5.75%	737 460	0,11
31 950 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 22/05/23, ZCP	240 692	0,04	1 220 000	USD	Federal Home Loan Bank Discount Notes 25/05/23, ZCP	1 211 399	0,18
421 100 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 29/05/23, ZCP	3 172 315	0,47	375 000	USD	ON Semiconductor 01/03/29, 0.50%	391 728	0,06
491 350 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 05/06/23, ZCP	3 701 556	0,55	1 214 000	USD	PPL Capital Funding 15/03/28, 2.88%	1 224 544	0,18
17 200 000	JPY	Japan Treasury Discount Bill 12/06/23, ZCP	129 590	0,02	655 000	USD	Royal Caribbean Cruises 15/01/30, 7.25%	660 502	0,10
					715 000	USD	Southern 15/12/25, 3.88%	726 606	0,11
					1 370 000	USD	Spirit Loyalty Cayman 20/09/25, 8.00%	1 379 851	0,22
					490 000	USD	Transocean 15/02/30, 8.75%	500 241	0,07

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Investitionsportfolio zum 31. März 2023 (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
1 310 000	USD	United States Cash Management Bill 17/04/23, ZCP	1 307 313	0,19
12 351 000	USD	United States Treasury Bill 04/04/23, ZCP	12 346 342	1,84
270 000	USD	United States Treasury Bill 06/04/23, ZCP	269 854	0,04
1 795 000	USD	United States Treasury Bill 11/04/23, ZCP	1 792 712	0,27
10 773 000	USD	United States Treasury Bill 18/04/23, ZCP	10 749 292	1,60
15 647 000	USD	United States Treasury Bill 25/04/23, ZCP	15 598 498	2,32
1 600 000	USD	United States Treasury Bill 27/04/23, ZCP	1 594 647	0,24
1 485 000	USD	United States Treasury Bill 02/05/23, ZCP	1 479 056	0,22
2 178 000	USD	United States Treasury Bill 04/05/23, ZCP	2 169 116	0,32
6 068 000	USD	United States Treasury Bill 09/05/23, ZCP	6 038 095	0,90
15 700 000	USD	United States Treasury Bill 11/05/23, ZCP	15 622 809	2,32
4 125 000	USD	United States Treasury Bill 16/05/23, ZCP	4 101 952	0,61
8 965 000	USD	United States Treasury Bill 23/05/23, ZCP	8 906 956	1,32
9 500 000	USD	United States Treasury Bill 25/05/23, ZCP	9 437 684	1,40
9 700 000	USD	United States Treasury Bill 30/05/23, ZCP	9 630 556	1,43
2 860 000	USD	United States Treasury Bill 01/06/23, ZCP	2 838 300	0,43
4 790 000	USD	United States Treasury Bill 06/06/23, ZCP	4 750 436	0,71
13 105 000	USD	United States Treasury Bill 08/06/23, ZCP	12 993 501	1,93
340 000	USD	United States Treasury Bill 13/06/23, ZCP	336 742	0,05
5 615 000	USD	United States Treasury Bill 15/06/23, ZCP	5 562 111	0,83
1 660 000	USD	United States Treasury Bill 20/06/23, ZCP	1 642 362	0,24
755 000	USD	United States Treasury Bill 22/06/23, ZCP	747 003	0,11
1 655 000	USD	United States Treasury Bill 27/06/23, ZCP	1 635 721	0,24
2 610 000	USD	United States Treasury Bill 29/06/23, ZCP	2 579 988	0,38
2 530 000	USD	United States Treasury Bill 05/07/23, ZCP	2 497 525	0,37
1 525 000	USD	United States Treasury Bill 11/07/23, ZCP	1 503 926	0,22
4 560 000	USD	United States Treasury Bill 13/07/23, ZCP	4 499 285	0,67

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
2 615 000	USD	United States Treasury Bill 20/07/23, ZCP	2 577 846	0,38
1 500 000	USD	United States Treasury Bill 27/07/23, ZCP	1 477 175	0,22
210 000	USD	United States Treasury Bill 03/08/23, ZCP	206 645	0,03
Summe Anleihen			218 564 959	32,49
Summe übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden			218 564 959	32,49

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Sonstige Wertpapiere	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
Anleihen				
Kanada				
1 250 000	CAD	Toronto Hydro 10/04/23, 2.91%	924 570	0,14
Summe Anleihen			924 570	0,14
Summe sonstige Wertpapiere			924 570	0,14

Anzahl der Anteile oder Nennbetrag	Währung	Optionsscheine	Markt- wert USD	% Netto- vermögen
USA				
3 660	USD	Metals Acquisition Warrants 12/07/26	2 672	-
2 024	USD	Rice Acquisition II Warrants 12/03/26	2 965	-
Summe Optionsscheine			5 637	-
Summe Kapitalinvestitionen			536 211 074	79,71
Sonstiges Nettovermögen			136 530 228	20,29
Nettoinventarwert			672 741 302	100,00

Die Anmerkungen auf den Seiten 62 bis 138 stellen einen wesentlichen Teil dieses Finanzberichts dar.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023

Die Gesellschaft

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

Die Investitionsstrategie der einzelnen Teilfonds beruht auf einer alternativen Investitionsstrategie, 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 Board of Directors ausgegeben. Anleger können sich bei der Verwaltungsgesellschaft oder bei ihrer Vertriebsstelle erkundigen, ob innerhalb der Anteilsklassen und Teilfonds ausschüttende Anteile erhältlich sind.

Das Board of Directors kann beschliessen, in jedem Teilfonds verschiedene Anteilsklassen einzuführen, deren Vermögenswerte in Übereinstimmung mit der besonderen Investitionspolitik des jeweiligen Teilfonds gemeinsam investiert werden, die sich aber durch besondere Gebührenstrukturen, Referenzwährungen oder sonstige spezielle Merkmale von den anderen Anteilsklassen unterscheiden können. Für jede Anteilsklasse wird ein eigener Nettoinventarwert je Anteil berechnet. Dieser Wert kann aufgrund dieser variablen Faktoren unterschiedlich ausfallen. 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 Board of Directors ganz oder teilweise erlassen werden kann.

Anteilsklassen	Ausgabeaufschlag
Anteile der Klassen A ¹ , A2 und K	Bis zu 3,09278% des Nettoinventarwerts je Anteil
Anteile der Klasse A1	Bis zu 2,04081% des Nettoinventarwerts je Anteil
Anteile der Klassen C, C1, E, F und P	Bis zu 1,01010% des Nettoinventarwerts je Anteil
Anteile der Klassen I, IF, IZ, N, PI, R, S, X, Y, Y1 und Y2	Kein Ausgabeaufschlag

Vertriebsgebühr

Zum Zeitpunkt dieses Berichts fällt für alle Anteile der Klasse A1 von Schroder GAIA eine Vertriebsgebühr von 0,50% an. Für andere für Investitionen 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 -abflüssen 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 2023, dem letzten Berechnungstag des Berichtszeitraums, wurden Swing-Pricing-Anpassungen für Schroder GAIA Blue Trend und Schroder GAIA IndusPacifiChoice vorgenommen. In der folgenden Tabelle sind die offiziellen Nettoinventarwerte je Anteil dieser Teilfonds nach Anwendung der Swing-Pricing-Anpassung zu diesem Termin aufgeführt. Alle sonstigen in diesem Bericht aufgeführten Finanzinformationen werden vor den Swing Pricing-Anpassungen ausgewiesen.

	Währung	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Nettoinventarwert je Anteil * (einschliesslich Swing-Pricing-Anpassung) zum 31. März 2023			
Klasse A Thes.	EUR	199,79	-
Klasse A Thes.	USD	-	114,20
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	CHF	-	101,67
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	EUR	-	103,45
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	GBP	190,41	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	SGD	-	156,60
Klasse A Thes., in USD abgesichert	USD	205,22	-
Klasse A Aussch. GBP	GBP	195,22	-
Klasse A1 Thes.	EUR	185,95	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	USD	196,28	-
Klasse C Thes.	EUR	217,62	-
Klasse C Thes.	USD	-	117,72
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	USD	-	147,22
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	CHF	-	105,12
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	EUR	-	106,69
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	GBP	205,78	89,85

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

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

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Swing-Pricing (Forts.)

	Währung	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	GBP	205,78	89,85
Klasse C Thes., in USD abgesichert	USD	223,76	-
Klasse C Aussch.	EUR	216,46	-
Klasse C Aussch. GBP	GBP	212,83	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	CHF	-	5 244,20
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	EUR	-	5 352,46
Klasse E Thes.	EUR	216,09	-
Klasse E Thes.	USD	-	121,27
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	CHF	-	107,94
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	EUR	-	109,75
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	GBP	-	92,44
Klasse X Thes.	EUR	216,62	-

Mindestanlage bei Erstzeichnung, Mindestanlage bei Folgezeichnungen und Mindestbeteiligung

Teilfonds	Anteilklassen	Mindestanlage	Mindestanlage bei Folgezeichnungen	Mindestanlagebe- stand
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *				
	A- und C-Anteile	USD 10 000	USD 5 000	USD 10 000
	I-Anteile	USD 5 000 000	USD 2 500 000	USD 5 000 000
	IZ-Anteile	USD 100 000 000	USD 20 000 000	USD 100 000 000
Schroder GAIA BlueTrend				
	A-, C-, E- und N-Anteile	USD 10 000	USD 5 000	USD 10 000
Schroder GAIA Cat Bond				
	A-, C-, F- und PI-Anteile	USD 100 000	USD 50 000	USD 100 000
	I-Anteile	USD 5 000 000	USD 2 500 000	USD 5 000 000
	IF-Anteile	USD 1 000 000	USD 500 000	USD 1 000 000
	Y-, Y1- und Y2*-Anteile	USD 100 000 000	USD 2 500 000	USD 100 000 000
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
	A-, A1-, C- und E-Anteile	USD 10 000	USD 5 000	USD 10 000
Schroder GAIA Egerton Equity				
	A-, A1-, C- und E-Anteile	EUR 10 000	EUR 5 000	EUR 10 000
	X-Anteile	EUR 100 000 000	EUR 2 500 000	EUR 100 000 000
Schroder GAIA Helix				
	A-, C-, C1-, E- und S-Anteile	USD 10 000	USD 5 000	USD 10 000
	I-Anteile	USD 5 000 000	USD 2 500 000	USD 5 000 000
	IZ-Anteile	USD 100 000 000	USD 20 000 000	USD 100 000 000
	X-Anteile	USD 100 000 000	USD 2 500 000	USD 100 000 000
Schroder GAIA Oaktree Credit				
	A2-, C- und E-Anteile	USD 10 000	USD 5 000	USD 10 000
	I-Anteile	USD 5 000 000	USD 2 500 000	USD 5 000 000
Schroder GAIA Sirius US Equity				
	A-, C- und E-Anteile	USD 10 000	USD 5 000	USD 10 000
	X-Anteile	USD 100 000 000	USD 2 500 000	USD 100 000 000
Schroder GAIA Tellworth 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 Two Sigma Diversified				
	C- und K-Anteile	USD 10 000	USD 5 000	USD 10 000
Schroder GAIA Wellington Pagosa				
	A-, C-, C1- und E-Anteile	USD 10 000	USD 5 000	USD 10 000

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden

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

Nettoinventarwert

Berechnung des Nettoinventarwerts je Anteil

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

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 einem Wertpapier, das nicht an einer amtlichen Börse oder einem anderen geregelten Markt gehandelt wird oder zum Handel zugelassen ist, oder bei Wertpapieren, die zwar gehandelt werden oder zum Handel zugelassen sind, deren letzter verfügbarer Kurs aber nicht ihren tatsächlichen Wert widerspiegelt, muss das Board of Directors 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 das Board of Directors 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

Das Board of Directors behält sich das Recht vor, Fair Value Pricing immer dann anzuwenden, wenn dies für angebracht erachtet wird.

Zum 31. März 2023 wurde die Fair-Value-Anpassung auf die folgenden Wertpapiere angewandt:

Teilfonds	Wertpapiername
Schroder GAIA Cat Bond	LionRock SideCar 2020-1C perpetual, ZCP
	LionRock SideCar 2021-1 perpetual, ZCP
	Putnam Re 07/06/24, 10.18%
	Voussoir Re perpetual, variabel
Schroder GAIA Helix	CFD auf MAGNIT PJSC
	CFD auf TRINITY LIMITED
	Fix Price Group
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Clementia Pharmaceuticals
	Credit Suisse Group perpetual, 7.25%
	Credit Suisse Group perpetual, 7.50%
	Credit Suisse Group perpetual *, 7.50%

Besteuerung

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

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

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

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

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (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	Managementgebühr
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *	A*-Anteile	2,00%
	C*- und IZ*-Anteile	1,25%
	I*-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA BlueTrend	A-Anteile	1,60%
	C-, E- und N-Anteile	1,00%
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Cat Bond	A- und F-Anteile	1,50%
	C- und IF-Anteile	1,10%
	PI-Anteile (Effektivzins)	bis zu 1,10% (0,46%)
	Y-Anteile (Effektivzins)	bis zu 1,10% (0,88%)
	Y1-Anteile (Effektivzins)	bis zu 1,50% (1,28%)
	Y2*-Anteile (Effektivzins)	bis zu 1,10% (0,24%)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Contour Tech Equity	A- und A1-Anteile	2,00%
	C-Anteile	1,25%
	E-Anteile	1,00%
	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-, C1- und IZ*-Anteile	1,00%
	E-Anteile	0,75%
	S*-Anteile (Effektivzins)	bis zu 1,00% (0,35%)
	X-Anteile (effektiver Satz)	bis zu 1,00% (0,60%)
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Oaktree Credit	Anteile der Klasse A2	1,25%
	C-Anteile	0,75%
	E-Anteile	0,60%
	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 Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *	C- und R-Anteile	0,75%
	K-Anteile	1,25%
	I-Anteile	Entfällt
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	C-Anteile	1,40%
	K-Anteile	1,90%
	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.

Honorare der Mitglieder des Board of Directors

Marie-Jeanne Chèvremont-Lorenzini erhielt für den Berichtszeitraum eine Vergütung in Höhe von 10 083 EUR. Bernard Herman und Eric Bertrand erhielten für den Berichtszeitraum jeweils eine Vergütung in Höhe von 9 243 EUR. Hugh Mullan erhielt für den Berichtszeitraum eine Vergütung in Höhe von 8 000 EUR. Die verbleibenden Mitglieder des Board of Directors verzichteten auf ihr Honorar.

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Performancegebühren

Die Performancegebühr wird dann fällig, wenn der Fonds eine sog. Outperformance erzielt, d. h. dass der Zuwachs des Nettoinventarwertes 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 je 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 «Zahlbare Performancegebühren» ausgewiesen. Die für die einzelnen Anteilsklassen während des Berichtszeitraums in Rechnung gestellten Performancegebühren sind auf den Seiten 137–138 aufgeführt.

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

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

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

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

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

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

** Der Anlageverwalter des Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund * ist mit Wirkung zum 5. Dezember 2022 statt «BennBridge Ltd.» nun «Tellworth Investments LLP».

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Gebühren für Verwahrstelle und Verwaltungsstelle

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

Wiederinvestition 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 2023 waren die folgenden Teilfonds in Devisenterminkontrakten engagiert:

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *					
Absicherung des Portfolios					
AUD	2 489 000	USD	1 736 518	17. Apr. 2023	(71 970)
GBP	470 000	USD	571 405	17. Apr. 2023	8 542
NZD	260 000	USD	165 358	17. Apr. 2023	(2 773)
SGD	1 270 000	USD	957 524	17. Apr. 2023	(2 822)
USD	82 925	AUD	124 000	17. Apr. 2023	(1)
USD	82 732	GBP	68 000	17. Apr. 2023	(1 176)
USD	63 655	SGD	85 332	17. Apr. 2023	(491)
					USD (70 691)
Schroder GAIA BlueTrend					
Absicherung des Portfolios					
AUD	37 100 000	USD	24 807 913	19. Apr. 2023	4 906
AUD	8 560 000	USD	5 728 863	20. Apr. 2023	(3 654)
BRL	1 641 410	USD	309 771	20. Apr. 2023	13 246
BRL	379 730	USD	70 800	25. Mai 2023	3 426
BRL	291 802 390	USD	55 178 568	21. Jun. 2023	1 556 231
CAD	87 406 514	USD	63 930 362	19. Apr. 2023	756 983
CAD	685 000	USD	501 715	20. Apr. 2023	5 244
CHF	26 367 427	USD	28 902 180	19. Apr. 2023	(37 307)
CHF	5 670 000	USD	6 171 201	20. Apr. 2023	36 519
CLP	31 842 861 584	USD	39 103 459	22. Jun. 2023	595 792
CNH	170 734 047	USD	24 879 311	19. Apr. 2023	(8 773)
EUR	43 600 000	USD	46 898 732	19. Apr. 2023	424 880
EUR	15 280 000	USD	16 422 446	20. Apr. 2023	163 462
GBP	34 300 000	USD	41 752 325	19. Apr. 2023	573 342
GBP	2 640 000	USD	3 254 303	20. Apr. 2023	3 484
HUF	11 327 343 292	USD	31 276 982	19. Apr. 2023	892 820
IDR	257 817 835 748	USD	17 010 653	21. Jun. 2023	148 261
ILS	76 662 537	USD	21 140 585	19. Apr. 2023	184 976
INR	4 837 067 172	USD	58 507 529	21. Jun. 2023	73 528
JPY	4 887 214 910	USD	36 703 586	19. Apr. 2023	191 393
JPY	143 515 000	USD	1 089 940	20. Apr. 2023	(6 320)
KRW	28 527 844 715	USD	22 066 834	21. Jun. 2023	(46 963)
MXN	1 217 809 319	USD	66 837 351	19. Apr. 2023	544 826
NOK	541 577 440	USD	51 166 128	19. Apr. 2023	597 600
NZD	41 500 000	USD	25 804 582	19. Apr. 2023	146 461

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
PHP	1 123 479 489	USD	20 493 807	21. Jun. 2023	129 008
PLN	159 772 023	USD	36 189 353	19. Apr. 2023	791 699
SEK	208 208 406	USD	19 820 769	19. Apr. 2023	256 819
SEK	20 415 000	USD	1 967 603	20. Apr. 2023	1 132
SGD	63 687 627	USD	47 400 800	19. Apr. 2023	478 372
THB	477 207 490	USD	13 931 222	19. Apr. 2023	47 004
TRY	26 315 000	USD	1 342 919	20. Apr. 2023	3 951
TWD	936 011 786	USD	31 026 003	21. Jun. 2023	(20 429)
USD	61 914 829	AUD	92 100 000	19. Apr. 2023	317 513
USD	12 423 615	AUD	18 550 000	20. Apr. 2023	16 766
USD	311 205	BRL	1 641 410	20. Apr. 2023	(11 812)
USD	21 233 646	BRL	113 628 207	21. Jun. 2023	(858 954)
USD	108 565 639	CAD	149 077 118	19. Apr. 2023	(1 762 563)
USD	8 685 156	CAD	11 855 000	20. Apr. 2023	(88 559)
USD	24 125 751	CHF	22 419 883	19. Apr. 2023	(417 678)
USD	7 586 077	CHF	6 960 000	20. Apr. 2023	(33 979)
USD	18 283 897	CLP	15 004 183 714	22. Jun. 2023	(422 175)
USD	30 118 737	CNH	208 497 583	19. Apr. 2023	(252 749)
USD	10 562	CZK	230 000	20. Apr. 2023	(57)
USD	37 419 895	EUR	35 100 000	19. Apr. 2023	(677 783)
USD	29 485 509	EUR	27 130 000	20. Apr. 2023	36 839
USD	33 281 676	GBP	27 700 000	19. Apr. 2023	(899 692)
USD	5 256 083	GBP	4 265 000	20. Apr. 2023	(6 970)
USD	806 633	GBP	700 000	21. Jun. 2023	(58 237)
USD	1 405 327	HKD	11 015 000	20. Apr. 2023	879
USD	16 482 886	HUF	6 166 913 141	19. Apr. 2023	(1 031 226)
USD	5 970	HUF	2 125 000	20. Apr. 2023	(63)
USD	14 408 374	IDR	221 745 409 516	21. Jun. 2023	(349 761)
USD	37 863 202	ILS	137 057 434	19. Apr. 2023	(262 679)
USD	54 702 286	INR	4 563 679 220	21. Jun. 2023	(567 807)
USD	53 328 328	JPY	7 242 192 443	19. Apr. 2023	(1 345 048)
USD	5 286 148	JPY	694 030 000	20. Apr. 2023	45 826
USD	5 590 224	KRW	7 271 484 040	20. Apr. 2023	(785)
USD	31 021 915	KRW	40 165 490 751	21. Jun. 2023	19 260
USD	38 197 679	MXN	721 678 768	19. Apr. 2023	(1 733 271)
USD	613 818	MXN	11 460 000	20. Apr. 2023	(20 148)
USD	72 893 244	NOK	762 707 076	19. Apr. 2023	(5 959)
USD	41 632 284	NZD	67 600 000	19. Apr. 2023	(639 780)
USD	514 515	NZD	825 000	20. Apr. 2023	(1 380)
USD	7 314 335	PHP	405 337 274	21. Jun. 2023	(126 118)
USD	17 933 356	PLN	79 177 531	19. Apr. 2023	(393 185)
USD	191 665	PLN	835 000	20. Apr. 2023	(1 592)
USD	31 108 159	SEK	326 879 251	19. Apr. 2023	(412 890)
USD	4 494 873	SEK	46 720 000	20. Apr. 2023	(10 605)
USD	24 727 123	SGD	33 298 118	19. Apr. 2023	(305 782)
USD	275 072	SGD	365 000	20. Apr. 2023	662
USD	16 175 992	THB	562 269 722	19. Apr. 2023	(293 853)
USD	473 613	THB	16 135 426	20. Apr. 2023	924
USD	2 375 182	TRY	46 325 000	20. Apr. 2023	4 148
USD	52 264 304	TWD	1 571 597 699	21. Jun. 2023	204 821

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
USD	35 771 487	ZAR	657 864 223	19. Apr. 2023	(1 128 016)
USD	1 180 460	ZAR	21 535 000	20. Apr. 2023	(27 327)
ZAR	473 856 381	USD	25 944 146	19. Apr. 2023	634 387
					USD (4 364 539)
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	238 958 049	USD	44 739 496	28. Apr. 2023	2 218 284
CHF	2 203 721	USD	2 408 674	28. Apr. 2023	6 122
EUR	113 201 995	USD	121 641 036	28. Apr. 2023	1 291 301
GBP	154 626 561	USD	188 988 590	28. Apr. 2023	1 853 973
SEK	134 851 570	USD	12 956 401	28. Apr. 2023	54 015
USD	3 460 000	BRL	18 236 551	28. Apr. 2023	(123 675)
USD	4 920	CHF	4 495	28. Apr. 2023	(6)
USD	927 376	EUR	858 041	28. Apr. 2023	(4 419)
USD	1 690 923	GBP	1 382 241	28. Apr. 2023	(15 063)
USD	122 430	SEK	1 274 903	28. Apr. 2023	(572)
					USD 5 279 960
					USD 915 421
Schroder GAIA Cat Bond					
Absicherung des Portfolios					
USD	70 444 487	EUR	64 500 000	13. Apr. 2023	459 709
					USD 459 709
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	235 230 905	USD	257 101 466	28. Apr. 2023	660 122
EUR	712 057 998	USD	765 094 319	28. Apr. 2023	8 169 014
GBP	7 720 851	USD	9 436 327	28. Apr. 2023	92 870
JPY	1 265 709	USD	9 800	28. Apr. 2023	(230)
SEK	6 901 956 213	USD	663 119 747	28. Apr. 2023	2 777 741
SGD	373 513	USD	280 359	28. Apr. 2023	521
USD	148 445	CHF	135 993	28. Apr. 2023	(574)
USD	1 561 629	EUR	1 448 826	28. Apr. 2023	(11 732)
USD	8 540	GBP	6 981	28. Apr. 2023	(76)
USD	6 186	SEK	64 388	28. Apr. 2023	(26)
					USD 11 687 630
					USD 12 147 339
Schroder GAIA Contour Tech Equity					
Absicherung des Portfolios					
AUD	2 844 205	USD	1 931 719	10. Mai 2023	(28 031)
EUR	3 285 275	USD	3 528 918	10. Mai 2023	41 255
JPY	448 732 383	USD	3 427 932	10. Mai 2023	(28 895)
NOK	53 714 674	USD	5 226 385	10. Mai 2023	(87 293)
USD	1 581 819	AUD	2 311 420	10. Mai 2023	34 733
USD	4 542 677	EUR	4 220 750	10. Mai 2023	(44 092)
USD	3 127 932	JPY	413 334 022	10. Mai 2023	(2 971)
USD	5 492 660	NOK	56 710 489	10. Mai 2023	66 944
					USD (48 350)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2 293 573	USD	2 506 842	28. Apr. 2023	6 411
EUR	54 392 824	USD	58 443 800	28. Apr. 2023	624 389
GBP	17 566 680	USD	21 469 655	28. Apr. 2023	211 422
SEK	86 420 138	USD	8 302 997	28. Apr. 2023	34 777

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)					
SGD	874 432	USD	656 346	28. Apr. 2023	1 222
USD	147 802	EUR	136 139	28. Apr. 2023	(41)
					USD 878 180
					USD 829 830
Schroder GAIA Egerton Equity					
Absicherung des Portfolios					
CHF	7 918 000	EUR	7 910 880	13. Apr. 2023	72 607
EUR	40 263 185	CAD	58 593 000	13. Apr. 2023	302 060
EUR	5 742 878	INR	508 015 000	17. Apr. 2023	51 805
EUR	5 056 436	JPY	732 359 000	13. Apr. 2023	(33 866)
EUR	3 844 333	SEK	42 866 000	13. Apr. 2023	36 004
EUR	319 407 155	USD	341 852 000	13. Apr. 2023	4 346 640
GBP	7 139 000	EUR	8 015 134	13. Apr. 2023	102 855
INR	265 749 000	EUR	2 985 273	17. Apr. 2023	(8 201)
KRW	2 772 839 000	EUR	1 991 381	14. Apr. 2023	(27 347)
TWD	27 764 000	EUR	854 277	14. Apr. 2023	(13 014)
USD	29 917 000	EUR	27 926 676	13. Apr. 2023	(354 318)
					EUR 4 475 225
Absicherung der Anteilsklasse					
EUR	293 489	GBP	258 459	28. Apr. 2023	(255)
EUR	2 485 962	USD	2 681 758	28. Apr. 2023	16 473
GBP	19 917 272	EUR	22 659 208	28. Apr. 2023	(22 730)
USD	194 734 467	EUR	181 198 189	28. Apr. 2023	(1 877 418)
					EUR (1 883 930)
					EUR 2 591 295
Schroder GAIA Helix					
Absicherung des Portfolios					
AUD	14 228 000	USD	9 926 930	17. Apr. 2023	(393 267)
AUD	12 402 517	USD	8 302 484	25. Mai 2023	19 826
BRL	3 273 000	USD	635 492	04. Apr. 2023	10 038
CAD	4 061 000	USD	2 961 917	25. Mai 2023	41 254
CHF	2 636 000	EUR	2 667 517	25. Mai 2023	(4 952)
CHF	5 229 000	USD	5 674 923	25. Mai 2023	81 313
DKK	4 430 000	EUR	595 514	25. Mai 2023	(543)
DKK	23 525 000	USD	3 390 872	25. Mai 2023	52 256
EUR	29 979 491	USD	32 159 821	25. Mai 2023	508 217
GBP	2 170 000	EUR	2 471 765	25. Mai 2023	(7 460)
GBP	231 000	USD	278 249	06. Apr. 2023	7 382
GBP	2 887 000	USD	3 509 907	17. Apr. 2023	60 682
GBP	15 778 000	USD	19 279 081	25. Mai 2023	250 540
HKD	436 232 000	USD	55 784 435	25. Mai 2023	(69 315)
INR	393 525 000	USD	4 741 551	25. Mai 2023	32 051
JPY	3 066 632 375	USD	23 564 618	25. Mai 2023	(343 015)
NOK	9 264 000	EUR	808 903	25. Mai 2023	5 271
NOK	12 369 000	USD	1 159 455	25. Mai 2023	24 460
NZD	1 650 000	USD	1 049 409	17. Apr. 2023	(17 044)
NZD	220 000	USD	136 971	25. Mai 2023	679
SEK	19 993 000	EUR	1 784 504	25. Mai 2023	(11 085)
SEK	58 477 569	USD	5 604 203	25. Mai 2023	50 958
SGD	7 596 000	USD	5 727 610	17. Apr. 2023	(12 069)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)					
SGD	4 909 000	USD	3 672 330	25. Mai 2023	25 969
USD	768 426	AUD	1 146 000	25. Mai 2023	(561)
USD	612 062	BRL	3 273 000	04. Apr. 2023	(33 469)
USD	337 554	CAD	461 000	25. Mai 2023	(3 363)
USD	403 056	CHF	369 000	25. Mai 2023	(3 149)
USD	203 696	DKK	1 405 000	25. Mai 2023	(1 940)
USD	2 820 838	EUR	2 620 931	25. Mai 2023	(35 137)
USD	402 705	GBP	331 000	17. Apr. 2023	(6 670)
USD	10 853 688	GBP	8 883 769	25. Mai 2023	(142 424)
USD	2 906 898	HKD	22 746 000	25. Mai 2023	1 802
USD	2 673 570	JPY	350 040 364	25. Mai 2023	22 943
USD	111 150	NOK	1 170 093	25. Mai 2023	(847)
USD	3 434 494	SEK	35 834 514	25. Mai 2023	(30 937)
USD	403 927	SGD	543 000	17. Apr. 2023	(4 648)
USD	150 627	SGD	200 000	25. Mai 2023	(47)
					USD 73 699
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	1 025 643	USD	1 121 029	28. Apr. 2023	4 570
EUR	196 617 104	USD	211 263 244	28. Apr. 2023	2 638 396
GBP	17 269 616	USD	21 106 504	28. Apr. 2023	257 104
JPY	1 271 399	USD	9 844	28. Apr. 2023	(254)
SEK	65 469	USD	6 291	28. Apr. 2023	32
SGD	31 072	USD	23 323	28. Apr. 2023	65
USD	3 885 873	EUR	3 601 388	28. Apr. 2023	(32 110)
USD	574 650	GBP	464 678	28. Apr. 2023	(188)
USD	197	SEK	2 039	28. Apr. 2023	0
					USD 2 867 615
					USD 2 941 314
Schroder GAIA Oaktree Credit					
Absicherung des Portfolios					
AUD	42 000	USD	29 737	19. Apr. 2023	(1 647)
EUR	17 436 702	USD	18 599 051	19. Apr. 2023	326 814
EUR	189 993	USD	206 045	20. Jul. 2023	1 231
GBP	33 730	USD	41 285	19. Apr. 2023	337
USD	1 087 330	AUD	1 570 944	19. Apr. 2023	36 668
USD	18 974 097	EUR	17 436 704	19. Apr. 2023	48 233
USD	19 686 718	EUR	18 340 296	20. Jul. 2023	(321 853)
USD	2 321 528	GBP	1 906 583	19. Apr. 2023	(31 165)
					USD 58 618
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	104 508	USD	114 227	28. Apr. 2023	289
EUR	10 739 859	USD	11 539 716	28. Apr. 2023	123 294
GBP	1 744 811	USD	2 133 230	28. Apr. 2023	20 242
USD	231	GBP	190	28. Apr. 2023	(3)
					USD 143 822
					USD 202 440

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirios US Equity					
Absicherung des Portfolios					
CAD	147 000	USD	107 594	21. Jun. 2023	1 315
CHF	486 000	USD	540 143	21. Jun. 2023	(4 386)
DKK	2 553 000	USD	370 993	21. Jun. 2023	2 638
GBP	2 293 000	USD	2 844 660	21. Jun. 2023	(11 592)
USD	3 808 685	CAD	5 210 000	21. Jun. 2023	(51 308)
USD	9 312 667	EUR	8 617 000	21. Jun. 2023	(74 555)
USD	24 274 946	GBP	19 874 000	21. Jun. 2023	(279 955)
					USD (417 843)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	2 980 327	USD	3 257 507	28. Apr. 2023	8 279
EUR	35 435 513	USD	38 074 599	28. Apr. 2023	406 793
GBP	4 423 847	USD	5 406 685	28. Apr. 2023	53 299
USD	554 525	EUR	508 244	28. Apr. 2023	2 596
					USD 470 967
					USD 53 124
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *					
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	782 489	GBP	699 868	28. Apr. 2023	(5 146)
EUR	14 434 693	GBP	12 687 705	28. Apr. 2023	13 022
GBP	7 751 802	EUR	8 801 048	28. Apr. 2023	7 980
GBP	5 473	USD	6 777	28. Apr. 2023	(19)
USD	1 373 357	GBP	1 123 708	28. Apr. 2023	(10 972)
					GBP 4 865
Schroder GAIA Two Sigma Diversified					
Absicherung des Portfolios					
AUD	12 871 001	USD	8 735 727	21. Jun. 2023	(107 021)
BRL	4 831 206	USD	919 949	06. Apr. 2023	32 982
BRL	4 831 206	USD	930 958	28. Apr. 2023	18 425
CAD	9 593 291	USD	7 054 566	21. Jun. 2023	52 928
CHF	2 576 524	USD	2 777 623	21. Jun. 2023	62 686
CNH	28 336 840	USD	4 139 490	21. Jun. 2023	10 160
CZK	7 261 459	USD	327 766	21. Jun. 2023	6 443
EUR	17 000 000	USD	18 365 751	21. Jun. 2023	153 777
GBP	14 447 674	USD	17 520 527	21. Jun. 2023	329 991
ILS	532 724	USD	145 574	21. Jun. 2023	3 038
INR	580 429	USD	7 039	10. Apr. 2023	21
JPY	2 036 973 057	USD	15 285 510	21. Jun. 2023	236 259
KRW	3 934 695 902	USD	3 049 000	21. Jun. 2023	(11 915)
MXN	257 139 852	USD	13 753 210	21. Jun. 2023	296 906
NOK	13 392 484	USD	1 306 407	21. Jun. 2023	(22 648)
NZD	9 220 921	USD	5 749 246	21. Jun. 2023	16 435
PLN	27 182 160	USD	6 116 537	21. Jun. 2023	149 939
SEK	13 828 772	USD	1 336 567	21. Jun. 2023	1 341
SGD	4 915 283	USD	3 689 539	21. Jun. 2023	13 443
TWD	3 409 000	USD	112 620	06. Apr. 2023	(632)
USD	3 967 117	AUD	5 846 185	21. Jun. 2023	47 840
USD	933 945	BRL	4 831 206	06. Apr. 2023	(18 986)
USD	13 380 400	CAD	18 188 174	21. Jun. 2023	(94 887)

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)					
USD	21 268 644	CHF	19 717 977	21. Jun. 2023	(468 064)
USD	7 653 822	CNH	52 346 240	21. Jun. 2023	(11 768)
USD	44 975 019	EUR	42 000 000	21. Jun. 2023	(779 107)
USD	11 318 689	GBP	9 377 586	21. Jun. 2023	(267 590)
USD	659 753	HUF	239 934 747	21. Jun. 2023	(8 233)
USD	522 096	ILS	1 908 000	21. Jun. 2023	(10 168)
USD	7 056	INR	580 429	10. Apr. 2023	(4)
USD	7 030	INR	580 429	28. Apr. 2023	(22)
USD	21 594 416	JPY	2 891 553 018	21. Jun. 2023	(439 265)
USD	4 103 990	KRW	5 354 854 598	21. Jun. 2023	(29 277)
USD	2 821 397	MXN	52 650 750	21. Jun. 2023	(55 438)
USD	2 324 091	NOK	23 824 536	21. Jun. 2023	40 349
USD	1 694 698	NZD	2 718 759	21. Jun. 2023	(5 294)
USD	1 710 704	SEK	17 694 924	21. Jun. 2023	(1 248)
USD	6 425 121	SGD	8 599 386	21. Jun. 2023	(53 321)
USD	111 807	TWD	3 409 000	06. Apr. 2023	(180)
USD	112 993	TWD	3 409 000	27. Apr. 2023	750
USD	324 075	TWD	9 764 684	21. Jun. 2023	618
USD	1 306 872	ZAR	23 953 911	21. Jun. 2023	(29 146)
ZAR	27 635 984	USD	1 506 716	21. Jun. 2023	34 669
					USD (905 214)
Absicherung der Anteilsklasse					
CHF	3 680 545	USD	4 022 902	28. Apr. 2023	10 170
EUR	132 393 013	USD	142 253 044	28. Apr. 2023	1 519 883
GBP	81 716 032	USD	99 872 441	28. Apr. 2023	982 786
USD	7 266	CHF	6 649	28. Apr. 2023	(20)
USD	2 570 212	EUR	2 369 032	28. Apr. 2023	(2 450)
USD	846	GBP	687	28. Apr. 2023	(2)
					USD 2 510 367
					USD 1 605 153
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Absicherung des Portfolios					
AUD	50 855 000	USD	34 103 774	04. Apr. 2023	(109 746)
AUD	16 975 000	USD	11 389 563	03. Mai 2023	(30 876)
AUD	650 000	USD	437 002	21. Jun. 2023	(1 243)
BRL	118 693 000	USD	22 702 463	04. Apr. 2023	715 545
BRL	52 203 000	USD	10 063 338	03. Mai 2023	185 931
BRL	9 278 000	USD	1 717 035	10. Mai 2023	102 026
BRL	14 925 000	USD	2 854 255	02. Jun. 2023	58 442
BRL	4 606 000	USD	832 460	16. Jun. 2023	63 957
CAD	46 885 000	USD	34 451 797	04. Apr. 2023	239 287
CAD	13 915 000	USD	10 225 144	03. Mai 2023	75 183
CAD	3 695 000	USD	2 685 342	21. Jun. 2023	52 216
CHF	48 712 000	USD	52 708 583	04. Apr. 2023	531 485
CHF	5 910 000	USD	6 467 348	03. Mai 2023	12 212
CHF	358 000	USD	388 594	21. Jun. 2023	6 059
CLP	23 894 525 000	USD	29 903 446	04. Apr. 2023	156 720
CLP	1 784 545 000	USD	2 208 595	06. Apr. 2023	35 781
CLP	148 465 000	USD	182 479	28. Apr. 2023	3 805

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
CLP	2 472 400 000	USD	3 083 408	03. Mai 2023	17 309
CLP	468 607 000	USD	585 759	16. Mai 2023	924
CLP	457 452 000	USD	565 803	24. Mai 2023	6 293
CLP	3 056 401 000	USD	3 771 025	22. Jun. 2023	39 462
CNH	117 218 000	USD	17 100 370	04. Apr. 2023	(45 642)
CNH	18 258 000	USD	2 656 831	04. Mai 2023	5 889
CNH	15 741 000	USD	2 295 956	21. Jun. 2023	9 158
COP	79 093 500 000	USD	16 679 661	04. Apr. 2023	304 127
COP	9 430 016 000	USD	1 945 776	10. Apr. 2023	77 379
COP	3 987 586 000	USD	862 554	26. Apr. 2023	(10 061)
COP	28 095 477 000	USD	6 030 884	03. Mai 2023	(33 919)
COP	5 189 780 000	USD	1 075 491	16. Jun. 2023	22 219
COP	13 324 506 000	USD	2 768 501	21. Jun. 2023	47 026
CZK	275 870 000	USD	12 389 612	04. Apr. 2023	358 600
CZK	32 530 000	USD	1 480 118	21. Jun. 2023	17 076
DKK	2 566 000	USD	365 712	04. Apr. 2023	7 831
DKK	1 553 000	USD	225 090	28. Apr. 2023	1 341
DKK	7 139 000	USD	1 040 741	03. Mai 2023	484
EGP	8 966 000	USD	303 932	10. Apr. 2023	(16 108)
EGP	5 044 000	USD	163 395	18. Apr. 2023	(3 871)
EGP	21 410 000	USD	806 099	01. Jun. 2023	(173 123)
EUR	47 585 000	USD	51 010 407	04. Apr. 2023	595 521
EUR	7 852 000	USD	8 525 664	28. Apr. 2023	1 260
EUR	13 910 000	USD	15 029 983	03. Mai 2023	79 926
EUR	9 698 000	USD	10 511 843	21. Jun. 2023	53 002
GBP	37 683 000	USD	45 660 805	04. Apr. 2023	824 918
GBP	403 000	USD	497 356	28. Apr. 2023	33
GBP	4 275 000	USD	5 275 272	03. Mai 2023	1 555
GBP	4 606 000	USD	5 570 598	21. Jun. 2023	120 248
HKD	12 320 000	USD	1 569 827	04. Apr. 2023	(380)
HKD	2 430 000	USD	311 004	21. Jun. 2023	(308)
HUF	7 476 281 000	USD	20 886 595	04. Apr. 2023	453 121
HUF	1 827 181 000	USD	5 166 344	03. Mai 2023	(879)
HUF	332 854 000	USD	911 055	02. Jun. 2023	20 711
HUF	1 336 300 000	USD	3 588 161	21. Jun. 2023	132 145
IDR	31 848 000 000	USD	2 094 619	04. Apr. 2023	29 359
IDR	30 313 000 000	USD	2 011 800	03. Mai 2023	8 210
IDR	23 449 000 000	USD	1 535 487	21. Jun. 2023	25 148
ILS	23 875 000	USD	6 714 335	04. Apr. 2023	(75 198)
ILS	525 000	USD	146 513	03. Mai 2023	(418)
ILS	1 138 000	USD	311 457	08. Jun. 2023	5 787
ILS	14 920 000	USD	4 164 371	21. Jun. 2023	(2 219)
INR	2 424 205 000	USD	29 438 348	03. Apr. 2023	59 476
INR	202 152 000	USD	2 462 266	28. Apr. 2023	(6 334)
INR	67 723 000	USD	821 084	02. Mai 2023	1 457
INR	2 230 225 000	USD	27 046 516	03. Mai 2023	39 223
INR	143 350 000	USD	1 737 483	21. Jun. 2023	(1 390)
JPY	13 762 808 000	USD	102 822 029	04. Apr. 2023	833 086

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
JPY	3 088 508 000	USD	23 400 988	02. Mai 2023	(33 349)
JPY	47 199 000	USD	352 867	21. Jun. 2023	6 790
KRW	33 889 770 000	USD	25 945 339	04. Apr. 2023	86 671
KRW	2 184 315 000	USD	1 665 998	12. Apr. 2023	12 613
KRW	855 100 000	USD	659 835	28. Apr. 2023	(2 001)
KRW	5 653 430 000	USD	4 348 445	03. Mai 2023	2 231
KRW	204 820 000	USD	155 994	02. Jun. 2023	1 909
KRW	1 702 210 000	USD	1 309 706	21. Jun. 2023	4 184
KZT	37 366 000	USD	78 889	24. Apr. 2023	2 709
KZT	96 084 000	USD	202 987	25. Apr. 2023	6 782
KZT	160 700 000	USD	338 851	15. Jun. 2023	7 729
KZT	267 900 000	USD	594 447	21. Jun. 2023	(17 464)
KZT	133 450 000	USD	275 155	24. Jul. 2023	10 097
KZT	115 100 000	USD	241 300	09. Aug. 2023	3 833
MXN	485 355 948	USD	26 242 509	04. Apr. 2023	691 784
MXN	112 227 000	USD	6 036 435	24. Apr. 2023	167 146
MXN	70 213 000	USD	3 701 132	27. Apr. 2023	177 785
MXN	142 084 000	USD	7 804 412	03. Mai 2023	35 917
MXN	4 076 000	USD	212 364	05. Jun. 2023	11 047
MXN	135 402 000	USD	7 126 455	21. Jun. 2023	271 907
NOK	389 146 000	USD	37 399 773	04. Apr. 2023	(231 345)
NOK	214 924 000	USD	20 616 558	03. Mai 2023	(60 760)
NZD	72 686 000	USD	44 999 961	04. Apr. 2023	450 577
NZD	6 795 000	USD	4 251 096	03. Mai 2023	(2 007)
NZD	635 000	USD	395 620	21. Jun. 2023	1 434
PEN	10 395 000	USD	2 738 190	04. Apr. 2023	24 380
PEN	10 395 000	USD	2 763 746	03. Mai 2023	(6 775)
PEN	6 180 000	USD	1 630 401	21. Jun. 2023	3 439
PHP	167 530 000	USD	3 066 730	04. Apr. 2023	14 847
PHP	100 380 000	USD	1 844 119	03. Mai 2023	888
PHP	91 315 000	USD	1 658 381	21. Jun. 2023	17 816
PLN	109 130 000	USD	25 044 025	04. Apr. 2023	238 030
PLN	10 566 000	USD	2 449 491	02. Mai 2023	(5 892)
PLN	22 234 000	USD	5 047 481	21. Jun. 2023	78 265
RON	9 465 000	USD	2 038 012	21. Jun. 2023	30 361
SEK	454 239 000	USD	43 183 501	04. Apr. 2023	581 698
SEK	5 972 000	USD	574 667	28. Apr. 2023	1 509
SEK	221 366 000	USD	21 278 216	03. Mai 2023	85 136
SGD	36 318 000	USD	27 008 745	04. Apr. 2023	281 608
SGD	19 341 000	USD	14 558 008	03. Mai 2023	(11 387)
SGD	1 965 000	USD	1 476 715	21. Jun. 2023	3 640
THB	370 355 000	USD	10 847 935	04. Apr. 2023	(17 258)
THB	19 128 000	USD	548 395	17. Apr. 2023	11 768
THB	9 345 000	USD	248 769	25. Apr. 2023	25 153
THB	200 268 000	USD	5 868 709	27. Apr. 2023	2 927
THB	12 413 000	USD	363 644	17. Mai 2023	1 055
THB	380 950 000	USD	11 207 913	21. Jun. 2023	22 560
THB	6 237 000	USD	185 957	29. Sep. 2023	(383)
TRY	296 000	USD	15 443	04. Apr. 2023	(10)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
TRY	10 147 000	USD	512 734	24. Apr. 2023	3 988
TRY	296 000	USD	14 830	03. Mai 2023	74
TRY	24 036 000	USD	1 196 190	21. Jun. 2023	(95 599)
TWD	55 008 000	USD	1 821 531	28. Apr. 2023	(10 170)
TWD	97 574 000	USD	3 235 534	03. Mai 2023	(20 766)
TWD	24 960 000	USD	826 775	21. Jun. 2023	29
USD	42 344 066	AUD	62 946 000	04. Apr. 2023	267 807
USD	19 039 117	AUD	28 386 000	03. Mai 2023	44 850
USD	1 371 672	AUD	2 065 000	21. Jun. 2023	(12 701)
USD	22 578 587	BRL	118 693 000	04. Apr. 2023	(839 420)
USD	3 003 835	BRL	15 965 000	02. Jun. 2023	(111 822)
USD	34 289 015	CAD	46 885 000	04. Apr. 2023	(402 070)
USD	854 584	CAD	1 178 000	05. Apr. 2023	(17 052)
USD	515 629	CAD	700 000	06. Apr. 2023	(2 327)
USD	973 040	CAD	1 250 000	10. Apr. 2023	48 071
USD	1 108 076	CAD	1 480 000	11. Apr. 2023	12 900
USD	1 008 813	CAD	1 350 000	12. Apr. 2023	9 818
USD	1 642 722	CAD	2 205 000	19. Apr. 2023	10 858
USD	1 131 011	CAD	1 520 000	20. Apr. 2023	6 082
USD	2 072 648	CAD	2 775 000	26. Apr. 2023	18 723
USD	674 463	CAD	900 000	27. Apr. 2023	8 315
USD	93 866	CAD	128 000	28. Apr. 2023	(877)
USD	374 978	CAD	500 000	01. Mai 2023	4 873
USD	8 417 485	CAD	11 396 000	03. Mai 2023	(18 198)
USD	317 158	CAD	400 000	11. Mai 2023	21 022
USD	373 096	CAD	500 000	17. Mai 2023	2 884
USD	369 642	CAD	500 000	18. Mai 2023	(576)
USD	361 704	CAD	500 000	23. Mai 2023	(8 548)
USD	822 155	CAD	1 125 000	25. Mai 2023	(10 943)
USD	727 902	CAD	1 000 000	30. Mai 2023	(12 699)
USD	294 072	CAD	400 000	31. Mai 2023	(2 174)
USD	2 619 980	CAD	3 595 000	14. Jun. 2023	(43 175)
USD	146 035	CAD	200 000	15. Jun. 2023	(2 126)
USD	1 282 285	CAD	1 750 000	16. Jun. 2023	(14 148)
USD	733 884	CAD	1 000 000	20. Jun. 2023	(6 986)
USD	6 749 870	CAD	9 315 000	21. Jun. 2023	(151 444)
USD	745 341	CAD	1 010 000	22. Jun. 2023	(2 961)
USD	404 551	CAD	550 000	23. Jun. 2023	(2 948)
USD	741 612	CAD	1 000 000	18. Jul. 2023	406
USD	664 345	CAD	910 000	28. Jul. 2023	(10 259)
USD	934 465	CAD	1 250 000	01. Aug. 2023	7 753
USD	300 256	CAD	400 000	09. Aug. 2023	3 671
USD	533 649	CAD	700 000	15. Aug. 2023	14 577
USD	368 293	CAD	500 000	25. Aug. 2023	(2 531)
USD	1 128 474	CAD	1 500 000	01. Sep. 2023	15 879
USD	549 345	CAD	750 000	06. Sep. 2023	(6 996)
USD	989 996	CAD	1 300 000	08. Sep. 2023	25 642
USD	228 482	CAD	310 000	25. Sep. 2023	(1 541)
USD	148 158	CAD	200 000	27. Sep. 2023	(248)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	526 422	CAD	700 000	29. Sep. 2023	6 983
USD	1 092 966	CAD	1 500 000	18. Okt. 2023	(20 432)
USD	46 970 877	CHF	43 422 000	04. Apr. 2023	(487 454)
USD	711 620	CHF	650 000	13. Apr. 2023	514
USD	547 813	CHF	500 000	20. Apr. 2023	396
USD	1 631 454	CHF	1 495 000	03. Mai 2023	(7 622)
USD	546 694	CHF	500 000	04. Mai 2023	(1 552)
USD	165 074	CHF	150 000	21. Jun. 2023	(283)
USD	28 843 701	CLP	23 894 525 000	04. Apr. 2023	(1 216 465)
USD	2 096 086	CLP	1 784 545 000	06. Apr. 2023	(148 290)
USD	14 610 799	CLP	11 611 125 000	03. Mai 2023	48 909
USD	1 754 922	CLP	1 429 735 000	08. Jun. 2023	(29 878)
USD	3 642 920	CLP	3 005 791 000	22. Jun. 2023	(104 471)
USD	16 966 115	CNH	117 218 000	04. Apr. 2023	(88 613)
USD	3 431 757	CNH	23 610 000	21. Jun. 2023	(25 694)
USD	537 759	CNH	3 653 000	28. Sep. 2023	(1 216)
USD	361 647	CNY	2 472 000	21. Jun. 2023	(535)
USD	16 621 932	COP	79 093 500 000	04. Apr. 2023	(361 854)
USD	1 983 596	COP	9 430 016 000	10. Apr. 2023	(39 558)
USD	394 733	COP	1 930 245 000	26. Apr. 2023	(17 928)
USD	2 402 175	COP	11 250 300 000	03. Mai 2023	804
USD	2 598 239	COP	12 574 052 000	21. Jun. 2023	(58 712)
USD	17 171 991	CZK	381 703 000	04. Apr. 2023	(466 862)
USD	911 692	CZK	19 977 000	28. Apr. 2023	(10 283)
USD	4 886 723	CZK	105 833 000	03. Mai 2023	3 611
USD	1 546 641	CZK	34 696 000	21. Jun. 2023	(50 243)
USD	1 539 799	DKK	10 757 000	04. Apr. 2023	(26 142)
USD	1 033 415	DKK	7 130 000	28. Apr. 2023	(6 155)
USD	1 197 656	DKK	8 191 000	03. Mai 2023	2 996
USD	504 213	DKK	3 495 000	21. Jun. 2023	(7 280)
USD	290 294	EGP	8 966 000	10. Apr. 2023	2 470
USD	166 194	EGP	5 044 000	18. Apr. 2023	6 670
USD	706 601	EGP	21 410 000	01. Jun. 2023	73 624
USD	50 718 078	EUR	47 585 000	04. Apr. 2023	(887 848)
USD	53 432 662	EUR	49 495 000	28. Apr. 2023	(316 708)
USD	30 257 648	EUR	27 910 000	03. Mai 2023	(59 930)
USD	20 216 485	EUR	18 809 000	21. Jun. 2023	(273 737)
USD	47 907 770	GBP	39 796 000	04. Apr. 2023	(1 184 547)
USD	18 653 581	GBP	15 206 000	28. Apr. 2023	(113 907)
USD	8 016 324	GBP	6 488 000	03. Mai 2023	7 890
USD	7 386 530	GBP	6 132 000	21. Jun. 2023	(189 733)
USD	248 304	GBP	200 000	24. Jul. 2023	1 096
USD	1 571 924	HKD	12 320 000	04. Apr. 2023	2 478
USD	624 194	HKD	4 892 000	28. Apr. 2023	198
USD	2 201 444	HKD	17 250 000	03. Mai 2023	578
USD	430 448	HKD	3 366 000	21. Jun. 2023	77
USD	21 216 758	HUF	7 846 400 000	04. Apr. 2023	(1 179 398)
USD	850 978	HUF	311 458 000	28. Apr. 2023	(30 960)
USD	6 212 854	HUF	2 197 300 000	03. Mai 2023	1 057

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	2 726 815	HUF	1 028 633 000	21. Jun. 2023	(136 936)
USD	2 097 020	IDR	31 848 000 000	04. Apr. 2023	(26 958)
USD	504 343	IDR	7 786 000 000	21. Jun. 2023	(13 850)
USD	15 450 601	ILS	56 000 000	04. Apr. 2023	(121 824)
USD	10 400 315	ILS	37 270 000	03. Mai 2023	28 941
USD	4 113 037	ILS	14 866 000	21. Jun. 2023	(34 052)
USD	29 402 063	INR	2 424 205 000	03. Apr. 2023	(95 762)
USD	2 137 898	INR	176 460 000	28. Apr. 2023	(5 903)
USD	6 005 950	INR	494 620 000	03. Mai 2023	(1 134)
USD	1 667 174	INR	137 890 000	21. Jun. 2023	(2 793)
USD	104 484 303	JPY	13 995 673 000	04. Apr. 2023	(924 642)
USD	1 602 051	JPY	209 700 000	10. Apr. 2023	21 339
USD	422 486	JPY	53 950 000	17. Apr. 2023	15 341
USD	1 227 458	JPY	172 650 000	20. Apr. 2023	(76 148)
USD	2 432 848	JPY	309 800 000	24. Apr. 2023	92 092
USD	11 774 369	JPY	1 536 647 000	28. Apr. 2023	156 017
USD	8 644 806	JPY	1 143 673 000	02. Mai 2023	(8 219)
USD	2 505 926	JPY	321 200 000	08. Mai 2023	73 578
USD	2 888 919	JPY	366 450 000	15. Mai 2023	111 260
USD	245 879	JPY	31 950 000	22. Mai 2023	3 470
USD	3 170 914	JPY	421 100 000	30. Mai 2023	(27 520)
USD	3 699 804	JPY	491 350 000	05. Jun. 2023	(35 360)
USD	127 605	JPY	17 200 000	12. Jun. 2023	(3 283)
USD	2 009 513	JPY	271 000 000	20. Jun. 2023	(55 202)
USD	717 279	JPY	95 100 000	21. Jun. 2023	(7 384)
USD	1 659 258	JPY	218 050 000	26. Jun. 2023	(3 529)
USD	2 376 045	JPY	305 200 000	03. Jul. 2023	46 238
USD	919 110	JPY	119 950 000	10. Jul. 2023	2 517
USD	25 837 802	KRW	33 889 770 000	04. Apr. 2023	(194 205)
USD	1 316 764	KRW	1 710 062 000	28. Apr. 2023	1 202
USD	11 346 644	KRW	14 739 600 000	03. Mai 2023	3 577
USD	2 562 669	KRW	3 324 505 000	21. Jun. 2023	(3 426)
USD	23 133 873	MXN	428 464 225	04. Apr. 2023	(643 277)
USD	591 969	MXN	12 310 000	24. Apr. 2023	(88 492)
USD	1 295 676	MXN	26 711 000	27. Apr. 2023	(179 975)
USD	4 668 893	MXN	85 000 000	03. Mai 2023	(21 487)
USD	865 362	MXN	16 395 000	05. Jun. 2023	(33 268)
USD	26 388 227	MXN	487 410 000	21. Jun. 2023	(243 841)
USD	17 897 555	NOK	189 252 000	04. Apr. 2023	(178 436)
USD	1 321 265	NOK	13 730 000	03. Mai 2023	8 098
USD	202 932	NOK	2 110 000	21. Jun. 2023	674
USD	51 820 166	NZD	83 740 000	04. Apr. 2023	(542 434)
USD	9 067 020	NZD	14 514 000	03. Mai 2023	(8 961)
USD	757 276	NZD	1 225 000	21. Jun. 2023	(8 695)
USD	2 769 046	PEN	10 395 000	04. Apr. 2023	6 476
USD	1 708 403	PEN	6 523 000	21. Jun. 2023	(16 118)
USD	3 054 527	PHP	167 530 000	04. Apr. 2023	(27 051)
USD	2 403 342	PHP	132 550 000	21. Jun. 2023	(29 772)
USD	23 376 147	PLN	103 234 000	04. Apr. 2023	(539 988)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Devisenterminkontrakte (Forts.)

Gekaufte Währungen	Gekaufter Betrag	Verkaufte Währungen	Verkaufter Betrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
USD	820 413	PLN	3 577 000	28. Apr. 2023	(7 051)
USD	1 082 635	PLN	4 670 000	02. Mai 2023	2 604
USD	1 104 305	PLN	4 903 000	21. Jun. 2023	(26 015)
USD	603 458	RON	2 775 000	21. Jun. 2023	(2 959)
USD	23 843 082	SEK	250 340 000	04. Apr. 2023	(276 776)
USD	549 336	SEK	5 673 000	28. Apr. 2023	2 008
USD	4 053 678	SEK	42 106 000	03. Mai 2023	(9 842)
USD	646 288	SEK	6 734 000	21. Jun. 2023	(5 214)
USD	27 159 533	SGD	36 318 000	04. Apr. 2023	(130 819)
USD	270 212	SGD	360 000	28. Apr. 2023	(506)
USD	1 789 155	SGD	2 377 000	03. Mai 2023	1 382
USD	2 703 430	SGD	3 615 000	21. Jun. 2023	(19 969)
USD	10 664 929	THB	370 355 000	04. Apr. 2023	(165 748)
USD	704 273	THB	23 241 000	17. Apr. 2023	23 662
USD	5 045 768	THB	172 637 000	25. Apr. 2023	(14 584)
USD	3 983 696	THB	135 605 000	03. Mai 2023	5 138
USD	731 577	THB	25 415 000	01. Jun. 2023	(16 236)
USD	11 364 912	THB	392 267 000	21. Jun. 2023	(199 190)
USD	15 401	TRY	296 000	04. Apr. 2023	(33)
USD	573 388	TRY	11 204 000	24. Apr. 2023	2 840
USD	1 599 871	TRY	32 320 000	21. Jun. 2023	119 961
USD	1 068 297	TWD	32 238 000	28. Apr. 2023	6 730
USD	1 522 478	TWD	46 055 000	03. Mai 2023	5 105
USD	647 135	TWD	19 690 000	21. Jun. 2023	(5 101)
USD	36 872 645	ZAR	675 499 000	04. Apr. 2023	(1 066 080)
USD	2 338 171	ZAR	42 695 000	06. Apr. 2023	(59 339)
USD	11 819 160	ZAR	214 700 000	03. Mai 2023	(208 170)
USD	5 316 136	ZAR	97 980 000	21. Jun. 2023	(148 656)
ZAR	675 499 000	USD	37 052 829	04. Apr. 2023	885 896
ZAR	28 999 000	USD	1 711 865	06. Apr. 2023	(83 445)
ZAR	138 209 000	USD	7 586 648	03. Mai 2023	155 714
ZAR	31 696 000	USD	1 727 302	08. Jun. 2023	42 520
ZAR	108 960 000	USD	5 999 492	21. Jun. 2023	77 704
					USD (4 504 764)
Absicherung der Anteilsklasse					
BRL	123 129 551	USD	23 053 733	28. Apr. 2023	1 142 525
CHF	11 333 868	USD	12 388 107	28. Apr. 2023	31 332
EUR	190 543 503	USD	204 735 489	28. Apr. 2023	2 186 286
GBP	98 641 405	USD	120 565 949	28. Apr. 2023	1 178 842
SGD	2 635 689	USD	1 978 359	28. Apr. 2023	3 665
USD	122 000	BRL	630 935	28. Apr. 2023	(1 985)
USD	4 523	CHF	4 142	28. Apr. 2023	(16)
USD	13 497 222	EUR	12 437 068	28. Apr. 2023	(8 882)
USD	220 944	GBP	180 701	28. Apr. 2023	(2 079)
					USD 4 529 688
					USD 24 924

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Die Devisenterminkontrakte waren mit den folgenden Kontrahenten verbunden:

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *	Banks of Hong Kong	(491)
	BNP Paribas	(1)
	Canadian Imperial Bank of Commerce	(2 773)
	Royal Bank of Canada	5 720
	Standard Chartered Bank	(71 970)
	State Street	(1 176)
	USD	(70 691)
Schroder GAIA BlueTrend	HSBC	5 279 960
	UBS	(4 364 539)
	USD	915 421
Schroder GAIA Cat Bond	Brown Brothers Harriman & Co	459 709
	HSBC	11 687 630
	USD	12 147 339
Schroder GAIA Contour Tech Equity	HSBC	878 180
	Morgan Stanley	(48 350)
	USD	829 830
Schroder GAIA Egerton Equity	Brown Brothers Harriman & Co	4 471 983
	HSBC	(1 880 688)
	EUR	2 591 295
Schroder GAIA Helix	Goldman Sachs	346 462
	HSBC	2 867 615
	J.P. Morgan	(272 763)
	USD	2 941 314
Schroder GAIA Oaktree Credit	HSBC	143 822
	State Street	58 618
	USD	202 440
Schroder GAIA Sirius US Equity	HSBC	470 967
	Morgan Stanley	(417 843)
	USD	53 124
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *	HSBC	4 865
	GBP	4 865
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	(263 500)
	Deutsche Bank	(14 084)
	HSBC	2 510 367
	Morgan Stanley	(40 574)
	Newedge Group	(587 056)
	USD	1 605 153

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Kontrahenten von Devisenterminkontrakten (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa	Bank of America	(50 768)
	Barclays Bank	(707 282)
	BNP Paribas	(1 238 144)
	Citi Bank	(875 113)
	Deutsche Bank	49 274
	Goldman Sachs	456 813
	HSBC	4 061 775
	J.P. Morgan	(250 149)
	Morgan Stanley	(695 892)
	Standard Chartered Bank	(269 799)
	UBS	(455 791)
		USD 24 924

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 2023 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					
EUR	2 153 331	USD	2 334 484	03. Apr. 2023	803
GBP	687	USD	846	03. Apr. 2023	2
JPY	103 545 702	USD	780 000	04. Apr. 2023	(142)
THB	2 577 600	USD	75 333	03. Apr. 2023	46
USD	1 268 186	EUR	1 161 584	03. Apr. 2023	8 447
USD	7 394	EUR	6 819	05. Apr. 2023	-
USD	109 208	GBP	88 709	03. Apr. 2023	(224)
					USD 8 932

Kontrahenten von Kassageschäften

Fonds	Kontrahent	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Brown Brothers Harriman & Co	578
	Deutsche Bank	46
	Morgan Stanley	8 308
		USD 8 932

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 2023 hielten die folgenden Teilfonds offene Terminkontrakte auf Indizes (mit Marktwert Risiken), Rentenwerte und Währungen:

Fälligkeitsdatum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long-Position	Marktpreis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Mrz. 24	4	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(971 325)	95,70	14 325
Jun. 24	1	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(240 000)	96,10	(237)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Sep. 24	2	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(481 688)	96,44	(487)
Dez. 25	18	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(4 362 363)	97,04	(4 437)
Mrz. 26	21	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(5 090 025)	97,07	(5 888)
Jun. 26	21	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(5 089 788)	97,07	(6 388)
Sep. 26	19	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(4 604 700)	97,07	(5 888)
Dez. 26	21	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(5 088 463)	97,05	(6 662)
Mrz. 27	21	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(5 056 525)	97,05	(38 337)
Jun. 27	18	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(4 360 975)	97,03	(5 375)
Jun. 23	87	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	57 651 691	9,91	(11 048)
Sep. 23	29	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	19 219 947	9,91	(4 050)
Dez. 23	16	90 Days Bank Bill Future	Morgan Stanley	AUD	10 604 126	9,91	(1 215)
Apr. 23	2	Amsterdam Index Future	Morgan Stanley	EUR	(322 726)	756,55	(5 466)
Jun. 23	71	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	5 845 970	122,89	(13 786)
Jun. 23	24	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	(1 737 824)	108,82	(7 884)
Sep. 23	38	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(6 701 683)	95,35	(333)
Dez. 23	17	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(3 004 726)	95,57	(620)
Mrz. 24	10	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(1 772 623)	95,86	(592)
Jun. 24	10	Bankers' Acceptance Future	J.P. Morgan	CAD	(1 778 709)	96,17	(240)
Apr. 23	596	BIST 30 Index Future	Morgan Stanley	TRY	1 760 325	5 350,00	(97 821)
Apr. 23	57	CAC 40 Index Future	Morgan Stanley	EUR	4 453 571	7 334,00	80 051
Jun. 23	57	Canada 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	CAD	(5 230 610)	126,16	(90 233)
Apr. 23	25	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(534 900)	20,76	15 795
Mai 23	34	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(767 750)	22,13	15 381
Jun. 23	10	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	J.P. Morgan	USD	(1 611 545)	33 460,00	(61 455)
Jun. 23	1	E-mini S&P 500 ESG Future	Morgan Stanley	USD	(170 440)	363,98	(11 550)
Jun. 23	6	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	1 229 750	4 137,75	11 575
Dez. 23	1	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(261 351)	96,46	(176)
Jun. 24	1	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(262 232)	96,78	(149)
Sep. 25	94	Euro 3 Months Euribor Future	Morgan Stanley	EUR	(24 703 703)	97,20	(67 171)
Jun. 23	8	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(1 226 222)	140,86	4 121
Jun. 23	107	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	4 748 158	4 261,00	196 370
Jun. 23	26	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(3 327 658)	117,88	3 796
Jun. 23	2	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(247 993)	115,35	(2 202)
Jun. 23	25	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(3 664 970)	135,84	(17 992)
Jun. 23	75	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(10 386 267)	130,23	(206 315)
Jun. 23	39	FTSE 100 Index Future	Morgan Stanley	GBP	3 657 334	7 639,00	17 819
Apr. 23	675	FTSE China A50 Future	Morgan Stanley	USD	(8 853 284)	13 306,00	(128 266)
Jun. 23	28	FTSE MIB Index Future	Morgan Stanley	EUR	3 975 669	26 656,00	71 512
Apr. 23	211	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	11 580 597	1 388,00	134 123
Jun. 23	11	FTSE/JSE Top 40 Future	Morgan Stanley	ZAR	(433 739)	71 234,00	(6 347)
Apr. 23	20	Hang Seng Index Future	Morgan Stanley	HKD	(2 578 937)	20 481,00	(30 141)
Apr. 23	86	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	(3 704 652)	7 012,00	(136 365)
Apr. 23	11	IBEX 35 Index Future	Morgan Stanley	EUR	(1 068 580)	9 193,20	(28 123)
Mrz. 24	6	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(1 766 762)	95,52	(648)
Jun. 24	6	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(1 777 047)	95,73	5 752
Sep. 24	6	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(1 775 073)	95,95	(293)
Dez. 25	96	ICE 3 Month SONIA Index Future	Morgan Stanley	GBP	(28 525 796)	96,35	1 511
Jun. 23	32	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	35 768 179	148,12	(69 893)
Jun. 23	86	KOSPI2 Index Future	J.P. Morgan	KRW	(5 163 344)	323,70	(182 548)
Jun. 23	55	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(7 021 528)	103,35	9 437
Apr. 23	2 609	Mini Bovespa Future	Morgan Stanley	BRL	(11 044 883)	102 128,00	530 743
Jun. 23	42	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	4 382 005	2 096,50	20 645
Jun. 23	155	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(7 451 870)	995,50	(263 255)
Apr. 23	11	MSCI Singapore Index ETS Future	Morgan Stanley	SGD	(251 228)	306,25	(1 909)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)							
Jun. 23	7	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1 722 293)	13 301,75	(139 952)
Jun. 23	10	Nikkei 225 (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	2 096 102	28 040,00	15 741
Jun. 23	23	Nikkei 225 (SGX) Future	Morgan Stanley	JPY	2 412 163	28 045,00	16 889
Apr. 23	87	OMXS30 Index Future	Morgan Stanley	SEK	1 799 860	2 216,75	58 288
Jun. 23	34	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(2 994 033)	1 813,50	(88 918)
Jun. 23	6	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(1 470 560)	2 529,70	(47 260)
Jun. 23	21	S&P/TSX 60 Index Future	J.P. Morgan	CAD	(3 664 284)	1 209,20	(93 496)
Jun. 23	531	SET 50 Index Future	J.P. Morgan	THB	(2 995 309)	968,30	(11 957)
Apr. 23	340	SGX Nifty 50 Future	Morgan Stanley	USD	(11 595 450)	17 417,50	(248 450)
Jun. 23	24	Short-Term Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	(2 738 536)	105,37	(4 034)
Jun. 23	11	South Korea 10 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	975 573	113,85	(13 596)
Jun. 23	4	South Korea 3 Year Bond Future	J.P. Morgan	KRW	(322 579)	104,88	330
Jun. 23	49	SPI 200 Future	Morgan Stanley	AUD	5 806 507	7 191,00	81 852
Jun. 23	19	Stoxx Euro ESG-X Index Future	Morgan Stanley	EUR	339 557	168,90	8 470
Jun. 23	19	Swiss Market Index Future	Morgan Stanley	CHF	(2 193 945)	10 996,00	(89 502)
Jun. 23	47	Topix Index Future	Morgan Stanley	JPY	7 043 272	2 003,50	48 764
Jun. 23	145	WIG20 Index Future	Morgan Stanley	PLN	1 160 732	1 775,00	31 785
							USD (863 875)
Schroder GAIA Helix							
Jun. 23	20	E-mini S&P 500 Future	J.P. Morgan	USD	4 031 200	4 137,75	106 550
Jun. 23	95	Euro Stoxx 50 Future	Goldman Sachs	EUR	(4 256 988)	4 261,00	(140 907)
Jun. 23	357	Euro Stoxx Future	J.P. Morgan	EUR	(8 466 491)	451,70	(293 387)
Jun. 23	123	FTSE 100 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(11 859 166)	7 639,00	241 520
Jun. 23	428	FTSE 250 Index Future	Goldman Sachs	GBP	(19 902 705)	18 906,50	(107 957)
Jun. 23	35	MSCI AC AXJ NTR Future	J.P. Morgan	USD	(1 733 865)	514,30	(66 185)
Jun. 23	277	MSCI Asia Future	J.P. Morgan	USD	(14 557 590)	546,70	(586 000)
Jun. 23	555	MSCI China Future	J.P. Morgan	USD	13 580 183	508,00	516 817
Jun. 23	132	MSCI EAFE Index Future	J.P. Morgan	USD	(13 260 060)	2 096,50	(576 840)
Jun. 23	161	MSCI Emerging Market Index Future	Goldman Sachs	USD	(7 749 245)	995,50	(264 530)
Jun. 23	205	MSCI Europe Future	J.P. Morgan	EUR	(6 259 145)	291,75	(238 777)
Jun. 23	30	MSCI Poland Future	Goldman Sachs	USD	(453 330)	145,60	16 530
Jun. 23	410	MSCI World Index Future	J.P. Morgan	USD	(33 918 169)	8 660,00	(1 587 831)
Apr. 23	57	SPI 200 Future	J.P. Morgan	AUD	(6 793 224)	7 182,00	(61 232)
Jun. 23	92	Topix Index Future	J.P. Morgan	JPY	(13 911 639)	2 003,50	62 214
Jun. 23	4	US 10 Year Note Future (CBT)	Goldman Sachs	USD	(446 875)	114,92	(12 813)
							USD (2 992 828)
Schroder GAIA Oaktree Credit							
Jun. 23	2	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(408 375)	103,23	(4 531)
Jun. 23	1	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	108 898	109,51	609
							USD (3 922)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Sep. 23	1	3 Month SOFR Future	Morgan Stanley	USD	(238 675)	95,13	863
Jun. 23	22	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	5 300 400	94,78	(87 500)
Dez. 23	145	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	35 182 275	95,44	(585 275)
Jun. 24	47	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	11 406 738	96,18	(106 175)
Dez. 24	6	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	1 465 638	96,62	(16 413)
Mrz. 25	41	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	9 954 263	96,71	(42 000)
Jun. 25	20	90 Days Eurodollar Future	Morgan Stanley	USD	4 851 750	96,75	(14 250)
Apr. 23	13	Amsterdam Index Future	Newedge Group	EUR	2 074 638	756,55	58 606
Jun. 23	58	Australia 10 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	(4 697 065)	122,89	(67 254)
Jun. 23	40	Australia 3 Year Bond Future	Newedge Group	AUD	2 888 893	108,82	20 620
Jun. 23	5	Australian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	331 906	67,01	3 144
Dez. 23	8	Bankers' Acceptance Future	Newedge Group	CAD	(1 405 568)	95,57	(8 713)
Jun. 23	4	British Pound Future	Morgan Stanley	USD	298 417	123,55	10 458

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Apr. 23	16	CAC 40 Index Future	Newedge Group	EUR	(1 237 143)	7 334,00	(35 452)
Jun. 23	148	Canada 10 Year Bond Future	Newedge Group	CAD	(13 367 236)	126,16	(448 287)
Jun. 23	4	Canadian Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(290 332)	73,99	(5 628)
Apr. 23	7	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(143 850)	20,76	(1 499)
Mai 23	49	CBOE VIX Future	Morgan Stanley	USD	(1 255 870)	22,13	171 573
Jun. 23	14	Dax Index Future	Newedge Group	EUR	(5 733 484)	15 797,00	(262 663)
Jun. 23	9	Dow Jones E-mini e-CBOT Future	Morgan Stanley	USD	(1 465 035)	33 460,00	(40 665)
Apr. 23	2	Dubai IRD FX Future	Newedge Group	USD	48 508	121,45	72
Jun. 23	114	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	22 319 800	4 137,75	1 265 375
Dez. 23	6	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(1 572 728)	96,46	3 565
Jun. 24	60	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	(15 816 497)	96,78	73 624
Sep. 24	60	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	15 836 886	96,91	(72 051)
Dez. 24	87	Euro 3 Months Euribor Future	Newedge Group	EUR	22 983 107	97,01	(100 510)
Jun. 23	4	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Newedge Group	EUR	(570 577)	140,86	(40 474)
Jun. 23	4	Euro FX Future	Morgan Stanley	USD	532 275	1,09	12 900
Jun. 23	274	Euro Stoxx 50 Future	Newedge Group	EUR	12 044 277	4 261,00	617 412
Jun. 23	35	Euro Stoxx Bank Future	Morgan Stanley	EUR	192 105	99,05	(4 120)
Jun. 23	56	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(7 001 546)	117,88	(157 542)
Jun. 23	36	Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	(4 359 809)	115,35	(143 685)
Jun. 23	465	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(66 201 534)	135,84	(2 301 558)
Jun. 23	11	Euro-OAT Future	Newedge Group	EUR	1 497 152	130,23	56 427
Jun. 23	90	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(10 211 232)	105,70	(105 129)
Jun. 23	86	FTSE 100 Index Future	Newedge Group	GBP	7 967 286	7 639,00	136 899
Apr. 23	137	FTSE China A50 Future	Newedge Group	USD	(1 809 371)	13 306,00	(13 551)
Jun. 23	8	FTSE MIB Index Future	Newedge Group	EUR	(1 114 432)	26 656,00	(41 905)
Jun. 23	65	FTSE/JSE Top 40 Future	Newedge Group	ZAR	(2 544 458)	71 234,00	(56 053)
Apr. 23	33	IBEX 35 Index Future	Newedge Group	EUR	3 212 278	9 193,20	77 830
Sep. 23	44	ICE 3 Month SONIA Index Future	Newedge Group	GBP	12 939 523	95,45	11 981
Jun. 23	34	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Newedge Group	JPY	37 241 875	148,12	687 554
Jun. 23	4	Japanese Yen Future	Morgan Stanley	USD	(375 044)	76,23	(6 081)
Jun. 23	96	KOSDAQ150 Index Future	Newedge Group	KRW	878 215	1 251,50	44 656
Jun. 23	175	KOSPI2 Index Future	Newedge Group	KRW	(10 651 429)	323,70	(226 841)
Jun. 23	335	Long Gilt Future	Newedge Group	GBP	41 727 553	103,35	982 454
Jun. 23	17	Mexican Peso Future	Morgan Stanley	USD	462 740	5,47	1 955
Jun. 23	33	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(3 315 180)	2 096,50	(144 045)
Jun. 23	199	MSCI Emerging Market Index Future	Morgan Stanley	USD	(9 594 423)	995,50	(310 802)
Apr. 23	175	MSCI Singapore Index ETS Future	Newedge Group	SGD	(3 983 649)	306,25	(43 534)
Jun. 23	158	Nasdaq 100 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(38 391 296)	13 301,75	(3 642 234)
Jun. 23	1	New Zealand Dollar Future	Morgan Stanley	USD	(61 075)	62,51	(1 435)
Jun. 23	27	Nikkei 225 (OSE) Future	Newedge Group	JPY	(5 710 864)	28 040,00	8 887
Jun. 23	34	Nikkei 225 (YEN) Future	Morgan Stanley	JPY	(3 577 330)	28 205,00	(33 930)
Apr. 23	5	OMXS30 Index Future	Newedge Group	SEK	104 736	2 216,75	2 055
Jun. 23	80	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(7 333 685)	1 813,50	79 685
Jun. 23	12	S&P MidCap 400 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	3 053 571	2 529,70	(17 931)
Jun. 23	43	S&P/TSX 60 Index Future	Newedge Group	CAD	7 501 582	1 209,20	192 920
Jun. 23	182	SET 50 Index Future	Newedge Group	THB	1 024 174	968,30	6 565
Apr. 23	135	SGX Nifty 50 Future	Newedge Group	USD	4 613 694	17 417,50	89 031
Jun. 23	58	Short-Term Euro-BTP Future	Newedge Group	EUR	6 558 297	105,37	69 582
Jun. 23	62	South Korea 10 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	5 421 108	113,85	945
Jun. 23	12	South Korea 3 Year Bond Future	Newedge Group	KRW	966 002	104,88	745
Jun. 23	88	SPI 200 Future	Newedge Group	AUD	10 375 664	7 191,00	199 348
Jun. 23	3	Stoxx 600 Bank Future	Newedge Group	EUR	(22 997)	143,05	(273)
Jun. 23	88	Stoxx Europe 600 Future	Newedge Group	EUR	2 089 706	454,50	79 077
Jun. 23	1	Swiss Franc Future	Morgan Stanley	USD	135 069	110,31	2 812

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Terminkontrakte (Forts.)

Fälligkeits- datum	Anzahl	Kontrakt	Kontrahent	Währung	(Short-)/ Long- Position	Markt- preis	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)							
Apr. 23	85	TAIEX Future	Morgan Stanley	TWD	8 583 900	15 864,00	273 576
Jun. 23	86	Topix Index Future	Newedge Group	JPY	(13 061 118)	2 003,50	84 203
Jun. 23	1	UD Dollar Index Future	Morgan Stanley	USD	105 212	102,19	(3 026)
Jun. 23	700	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	78 251 044	114,92	2 194 269
Jun. 23	13	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	(1 517 594)	121,14	(57 234)
Jun. 23	175	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	35 639 500	103,23	489 797
Jun. 23	4	US 3 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	831 602	105,95	15 961
Jun. 23	53	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(5 642 508)	109,51	(161 406)
Apr. 23	27	US Dollar Index Future	Newedge Group	KRW	272 136	1 299,40	(2 644)
Jun. 23	50	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(6 238 570)	131,16	(319 242)
Jun. 23	46	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(6 214 742)	141,13	(277 008)
Apr. 23	128	VSTOXX Mini Future	Newedge Group	EUR	(350 802)	20,75	62 759
Jun. 23	25	WIG20 Index Future	Newedge Group	PLN	(204 758)	1 775,00	(848)
							USD (1 916 681)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Jun. 23	1	Australia 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	81 888	122,89	256
Jun. 23	24	Australia 3 Year Bond Future	Morgan Stanley	AUD	1 731 931	108,82	13 777
Jun. 23	8	Canada 10 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	(746 970)	126,16	185
Jun. 23	8	Canada 5 Year Bond Future	Morgan Stanley	CAD	673 341	113,97	1 287
Jun. 23	3	E-mini S&P 500 Future	Morgan Stanley	USD	(597 838)	4 137,75	(22 825)
Jun. 23	5	Euro BUXL 30 Years Bond Future	Morgan Stanley	EUR	(735 508)	140,86	(28 305)
Jun. 23	73	Euro Stoxx 50 Future	Morgan Stanley	EUR	(3 259 416)	4 261,00	(113 954)
Jun. 23	25	Euro-BOBL Future	Morgan Stanley	EUR	(3 200 750)	117,88	4 728
Jun. 23	2	Euro-BTP Future	Morgan Stanley	EUR	253 751	115,35	(3 557)
Jun. 23	309	Euro-Bund Future	Morgan Stanley	EUR	(45 846 294)	135,84	324 884
Jun. 23	41	Euro-OAT Future	Morgan Stanley	EUR	(5 775 993)	130,23	(14 619)
Jun. 23	12	Euro-Schatz Future	Morgan Stanley	EUR	(1 185 546)	105,70	(189 969)
Apr. 23	8	FTSE Taiwan Index Future	Morgan Stanley	USD	(442 350)	1 388,00	(1 810)
Apr. 23	35	Hang Seng TECH Index Future	Morgan Stanley	HKD	956 382	4 320,00	6 688
Apr. 23	69	HSCEI Index Future	Morgan Stanley	HKD	2 940 006	7 012,00	141 741
Jun. 23	35	Japan 10 Years Bond (OSE) Future	Morgan Stanley	JPY	(38 412 446)	148,12	(632 555)
Jun. 23	218	Long Gilt Future	Morgan Stanley	GBP	(27 794 825)	103,35	1 447
Jun. 23	20	mini-10 Year JGB Index Future	Morgan Stanley	JPY	(2 211 689)	147,82	(14 935)
Jun. 23	13	Mini Dax Index Future	Morgan Stanley	EUR	(1 057 463)	15 797,00	(56 107)
Jun. 23	56	MSCI EAFE Index Future	Morgan Stanley	USD	(5 612 573)	2 096,50	(257 627)
Jun. 23	49	Russell 2000 E-mini Future	Morgan Stanley	USD	(4 397 258)	1 813,50	(45 818)
Jun. 23	180	US 10 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	21 028 953	114,92	(343 016)
Jun. 23	45	US 10 Year Ultra Future	Morgan Stanley	USD	5 452 172	121,14	(844)
Jun. 23	500	US 2 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	103 352 453	103,23	(125 890)
Jun. 23	237	US 5 Year Note Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(25 446 648)	109,51	(506 703)
Jun. 23	2	US Long Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	(216 758)	131,16	(45 555)
Jun. 23	10	US Ultra Bond Future (CBT)	Morgan Stanley	USD	1 560 531	141,13	(149 281)
							USD (2 058 377)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Optionskontrakte

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

Zum 31. März 2023 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						
(2 633 608)	Put auf UBS ETC Linked to a Systematica Strategy Delta-1 Basket on Commodity Future Ausübungskurs 52,75 Verfallstermin 31. Mrz. 2023	UBS	USD	(7 762)	-	7 762
				USD	-	7 762
Schroder GAIA Contour Tech Equity						
(410)	Call auf Chewy, Inc. Ausübungskurs 55,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(183 270)	(1 025)	182 245
(161)	Call auf Netflix, Inc. Ausübungskurs 430,00 Verfallstermin 19. Jan. 2024	Morgan Stanley	USD	(639 423)	(454 422)	185 001
(857)	Call auf Warner Music Group Ausübungskurs 40,00 Verfallstermin 21. Jul. 2023	Goldman Sachs	USD	(293 078)	(209 965)	83 113
				USD	(665 412)	450 359
Schroder GAIA Helix						
9 231	Call auf Bloomberg San Diego Telecommunications Index Ausübungskurs 114,08 Verfallstermin 28. Apr. 2023	Goldman Sachs	EUR	13 582	17 846	4 264
236	Put auf Deutsche Boerse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 13 800,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	UBS	EUR	213 612	17 115	(196 497)
97	Put auf Deutsche Boerse AG German Stock Index DAX Ausübungskurs 14 200,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	UBS	EUR	60 733	12 198	(48 535)
20	Put auf MSCI Emerging Markets Index Ausübungskurs 875,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	UBS	USD	19 754	1 200	(18 554)
8	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3 800,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	UBS	USD	30 670	5 240	(25 430)
				USD	53 599	(284 752)
Schroder GAIA Wellington Pagosa						
247 420	Call auf Alibaba Group Holding Limited Ausübungskurs 105,00 Verfallstermin 29. Jun. 2023	J.P. Morgan	HKD	191 635	250 065	58 430
(247 420)	Call auf Alibaba Group Holding Limited Ausübungskurs 115,00 Verfallstermin 29. Jun. 2023	J.P. Morgan	HKD	(115 989)	(151 499)	(35 510)
31	Call auf BILL Holdings, Inc. Ausübungskurs 105,00 Verfallstermin 19. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	36 993	7 905	(29 088)
(31)	Call auf BILL Holdings, Inc. Ausübungskurs 140,00 Verfallstermin 19. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(10 127)	(1 240)	8 887
26 800	Call auf Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 495,60 Verfallstermin 30. Mai 2023	Morgan Stanley	CNY	82 368	12 626	(69 742)
(26 800)	Call auf Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 585,71 Verfallstermin 30. Mai 2023	Morgan Stanley	CNY	(18 954)	(1 312)	17 642
1 275 000	Call auf Wechselkurs AUD/JPY Ausübungskurs 91,20 Verfallstermin 05. Apr. 2023	J.P. Morgan	AUD	11 521	155	(11 366)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1 970 000	Call auf Wechselkurs AUD/USD Ausübungskurs 0,66 Verfallstermin 26. Apr. 2023	HSBC	AUD	19 097	20 578	1 481
1 275 000	Call auf Wechselkurs AUD/USD Ausübungskurs 0,67 Verfallstermin 05. Apr. 2023	HSBC	AUD	11 749	1 986	(9 763)
1 935 000	Call auf Wechselkurs AUD/USD Ausübungskurs 0,67 Verfallstermin 02. Mai 2023	Morgan Stanley	AUD	17 056	15 228	(1 828)
1 171 000	Call auf Wechselkurs EUR/PLN Ausübungskurs 4,71 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Morgan Stanley	EUR	10 353	3 667	(6 686)
1 240 000	Call auf Wechselkurs EUR/PLN Ausübungskurs 4,73 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Bank of America	EUR	10 988	4 237	(6 751)
1 174 000	Call auf Wechselkurs EUR/USD Ausübungskurs 1,07 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Barclays Bank	EUR	14 314	18 842	4 528
1 018 000	Call auf Wechselkurs EUR/USD Ausübungskurs 1,08 Verfallstermin 13. Jun. 2023	Barclays Bank	EUR	19 109	23 940	4 831
1 049 000	Call auf Wechselkurs EUR/USD Ausübungskurs 1,09 Verfallstermin 25. Apr. 2023	Morgan Stanley	EUR	18 018	5 436	(12 582)
1 074 000	Call auf Wechselkurs GBP/AUD Ausübungskurs 1,84 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Citi Bank	GBP	13 036	11 409	(1 627)
725 000	Call auf Wechselkurs GBP/JPY Ausübungskurs 159,72 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Barclays Bank	GBP	14 368	23 991	9 623
691 000	Call auf Wechselkurs GBP/JPY Ausübungskurs 159,84 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Goldman Sachs	GBP	14 113	21 371	7 258
906 000	Call auf Wechselkurs GBP/USD Ausübungskurs 1,22 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Barclays Bank	GBP	13 480	15 011	1 531
414 000	Call auf Wechselkurs GBP/USD Ausübungskurs 1,42 Verfallstermin 04. Mai 2023	Barclays Bank	GBP	35 096	-	(35 096)
1 290 000	Call auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,20 Verfallstermin 05. Apr. 2023	Goldman Sachs	USD	23 143	1 802	(21 341)
1 252 000	Call auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,27 Verfallstermin 13. Apr. 2023	HSBC	USD	26 383	3 549	(22 834)
1 099 000	Call auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,56 Verfallstermin 28. Jun. 2023	Goldman Sachs	USD	15 399	11 898	(3 501)
3 680 000	Call auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,97 Verfallstermin 08. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	82 248	1 880	(80 368)
1 806 000	Call auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 6,11 Verfallstermin 14. Jun. 2023	Goldman Sachs	USD	43 097	3 295	(39 802)
1 288 000	Call auf Wechselkurs USD/CAD Ausübungskurs 1,38 Verfallstermin 07. Apr. 2023	Bank of America	USD	11 038	235	(10 803)
1 144 000	Call auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,91 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	18 709	10 529	(8 180)
1 108 000	Call auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,92 Verfallstermin 12. Jun. 2023	Goldman Sachs	USD	18 290	9 603	(8 687)
(2 621 000)	Call auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,95 Verfallstermin 23. Nov. 2023	Goldman Sachs	USD	(28 624)	(20 348)	8 276

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
261 000	Call auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 1,00 Verfallstermin 30. Mai 2023	Goldman Sachs	USD	33 356	43	(33 313)
(1 290 000)	Call auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 801,50 Verfallstermin 05. Apr. 2023	UBS	USD	(28 051)	(6 732)	21 319
(1 911 000)	Call auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 810,10 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Bank of America	USD	(72 094)	(23 015)	49 079
(3 736 000)	Call auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 876,40 Verfallstermin 06. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	(60 448)	(27 117)	33 331
5 700 000	Call auf Wechselkurs USD/CNH Ausübungskurs 6,79 Verfallstermin 26. Sep. 2023	UBS	USD	105 621	98 685	(6 936)
1 056 000	Call auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 21,93 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	20 061	6 824	(13 237)
(1 252 000)	Call auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 22,17 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Bank of America	USD	(16 519)	(2 583)	13 936
(1 320 000)	Call auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 22,42 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Bank of America	USD	(17 266)	(2 556)	14 710
(1 913 000)	Call auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 22,68 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Citi Bank	USD	(14 702)	(2 934)	11 768
(1 296 000)	Call auf Wechselkurs USD/HUF Ausübungskurs 352,80 Verfallstermin 02. Mai 2023	J.P. Morgan	USD	(25 460)	(27 732)	(2 272)
(1 913 000)	Call auf Wechselkurs USD/HUF Ausübungskurs 390,65 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Citi Bank	USD	(26 666)	(2 975)	23 691
1 049 000	Call auf Wechselkurs USD/IDR Ausübungskurs 15 231,00 Verfallstermin 15. Mai 2023	Citi Bank	USD	17 623	5 385	(12 238)
1 038 000	Call auf Wechselkurs USD/IDR Ausübungskurs 15 625,00 Verfallstermin 03. Apr. 2023	Citi Bank	USD	17 179	-	(17 179)
(1 288 000)	Call auf Wechselkurs USD/ILS Ausübungskurs 3,59 Verfallstermin 07. Apr. 2023	J.P. Morgan	USD	(18 451)	(11 473)	6 978
(4 715 000)	Call auf Wechselkurs USD/ILS Ausübungskurs 3,65 Verfallstermin 06. Jun. 2023	Citi Bank	USD	(110 142)	(68 151)	41 991
1 053 000	Call auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 82,15 Verfallstermin 26. Apr. 2023	J.P. Morgan	USD	11 604	6 661	(4 943)
1 023 000	Call auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 82,57 Verfallstermin 12. Jun. 2023	Barclays Bank	USD	11 294	9 589	(1 705)
5 740 000	Call auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 83,80 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	27 569	5 935	(21 634)
2 580 000	Call auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 83,84 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Deutsche Bank	USD	11 873	781	(11 092)
1 901 000	Call auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 84,15 Verfallstermin 27. Apr. 2023	UBS	USD	9 521	1 458	(8 063)
2 679 000	Call auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 84,80 Verfallstermin 31. Mai 2023	HSBC	USD	12 190	5 014	(7 176)
1 320 000	Call auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 130,02 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	19 668	32 350	12 682

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
875 000	Call auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 130,75 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Goldman Sachs	USD	12 408	18 069	5 661
(6 013 000)	Call auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 132,50 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Goldman Sachs	USD	(48 104)	(76 738)	(28 634)
(1 933 000)	Call auf Wechselkurs USD/KRW Ausübungskurs 1 311,00 Verfallstermin 31. Mai 2023	Bank of America	USD	(43 144)	(30 372)	12 772
(1 320 000)	Call auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 18,63 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(22 546)	(5 980)	16 566
(1 229 000)	Call auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 18,94 Verfallstermin 19. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(24 961)	(2 136)	22 825
1 735 000	Call auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 19,15 Verfallstermin 05. Jun. 2023	Deutsche Bank	USD	16 928	13 338	(3 590)
1 028 000	Call auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 19,18 Verfallstermin 09. Mai 2023	Bank of America	USD	22 541	3 553	(18 988)
1 229 000	Call auf Wechselkurs USD/NOK Ausübungskurs 10,75 Verfallstermin 19. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	22 872	38 983	16 111
1 035 000	Call auf Wechselkurs USD/PHP Ausübungskurs 54,71 Verfallstermin 24. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	15 090	4 899	(10 191)
1 023 000	Call auf Wechselkurs USD/PHP Ausübungskurs 55,30 Verfallstermin 13. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	16 130	7 541	(8 589)
1 078 000	Call auf Wechselkurs USD/PLN Ausübungskurs 4,55 Verfallstermin 04. Mai 2023	Barclays Bank	USD	11 136	2 679	(8 457)
(1 913 000)	Call auf Wechselkurs USD/PLN Ausübungskurs 4,57 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Bank of America	USD	(18 740)	(2 921)	15 819
1 056 000	Call auf Wechselkurs USD/SGD Ausübungskurs 1,31 Verfallstermin 27. Apr. 2023	HSBC	USD	11 843	16 784	4 941
978 000	Call auf Wechselkurs USD/SGD Ausübungskurs 1,34 Verfallstermin 14. Jun. 2023	HSBC	USD	11 629	15 150	3 521
(3 800 000)	Call auf Wechselkurs USD/THB Ausübungskurs 33,45 Verfallstermin 27. Sep. 2023	J.P. Morgan	USD	(103 360)	(108 789)	(5 429)
(5 701 000)	Call auf Wechselkurs USD/THB Ausübungskurs 34,10 Verfallstermin 15. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(108 690)	(72 838)	35 852
(2 900 000)	Call auf Wechselkurs USD/THB Ausübungskurs 34,74 Verfallstermin 30. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(58 783)	(22 758)	36 025
2 900 000	Call auf Wechselkurs USD/THB Ausübungskurs 36,10 Verfallstermin 30. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	24 389	6 058	(18 331)
1 075 000	Call auf Wechselkurs USD/ZAR Ausübungskurs 18,13 Verfallstermin 11. Apr. 2023	J.P. Morgan	USD	14 214	4 879	(9 335)
1 320 000	Call auf Wechselkurs USD/ZAR Ausübungskurs 18,55 Verfallstermin 20. Apr. 2023	HSBC	USD	25 905	4 706	(21 199)
3 736 000	Call auf Wechselkurs USD/ZAR Ausübungskurs 19,43 Verfallstermin 06. Jun. 2023	Bank of America	USD	48 363	21 503	(26 860)
575	Call auf MSCI Brazil 25/50 Index Ausübungskurs 6 430,00 Verfallstermin 19. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	69 000	29 765	(39 235)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
480	Call auf Murata Manufacturing Co., Ltd. Ausübungskurs 8 833,00 Verfallstermin 08. Jun. 2023	BNP Paribas	JPY	385	391	6
(480)	Call auf Murata Manufacturing Co., Ltd. Ausübungskurs 9 636,00 Verfallstermin 08. Jun. 2023	BNP Paribas	JPY	(87)	(88)	(1)
20	Call auf NASDAQ-100 Reduced Value Index Ausübungskurs 2 620,00 Verfallstermin 28. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	100 066	154 200	54 134
13	Call auf NASDAQ-100 Reduced Value Index Ausübungskurs 2 720,00 Verfallstermin 16. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	70 133	102 115	31 982
484	Call auf Nikkei 225 Index Ausübungskurs 28 071,05 Verfallstermin 14. Apr. 2023	Goldman Sachs	JPY	648	1 057	409
851	Call auf Samsung Electronics Co., Ltd. Ausübungskurs 64 612,83 Verfallstermin 11. Mai 2023	Morgan Stanley	KRW	663	1 191	528
5 000	Call auf Sinoma Science & Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 26,91 Verfallstermin 30. Mai 2023	Morgan Stanley	CNY	646	313	(333)
(5 000)	Call auf Sinoma Science & Technology Co., Ltd. Ausübungskurs 31,80 Verfallstermin 30. Mai 2023	Morgan Stanley	CNY	(108)	(45)	63
3 162	Call auf XPeng Inc. Ausübungskurs 45,43 Verfallstermin 29. Jun. 2023	BNP Paribas	HKD	1 762	2 324	562
(3 162)	Call auf XPeng Inc. Ausübungskurs 51,63 Verfallstermin 29. Jun. 2023	BNP Paribas	HKD	(1 061)	(1 469)	(408)
1 292	Put auf Euro Stoxx 50 Index Ausübungskurs 3 400,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	J.P. Morgan	EUR	75 009	1 101	(73 908)
1 292	Put auf Euro Stoxx 50 Index Ausübungskurs 3 400,00 Verfallstermin 16. Jun. 2023	J.P. Morgan	EUR	48 971	19 233	(29 738)
-	Put auf Euro Stoxx 50 Index Ausübungskurs 4 100,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	Goldman Sachs	EUR	589	193	(396)
30 562	Put auf FinecoBank Banca Fineco SpA Ausübungskurs 14,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	Goldman Sachs	EUR	13 741	12 648	(1 093)
1 275 000	Put auf Wechselkurs AUD/JPY Ausübungskurs 91,20 Verfallstermin 05. Apr. 2023	J.P. Morgan	AUD	11 521	23 763	12 242
5 305 000	Put auf Wechselkurs AUD/USD Ausübungskurs 0,66 Verfallstermin 26. Apr. 2023	HSBC	AUD	51 429	31 878	(19 551)
1 275 000	Put auf Wechselkurs AUD/USD Ausübungskurs 0,67 Verfallstermin 05. Apr. 2023	HSBC	AUD	11 749	8 551	(3 198)
1 935 000	Put auf Wechselkurs AUD/USD Ausübungskurs 0,67 Verfallstermin 02. Mai 2023	Morgan Stanley	AUD	17 056	18 713	1 657
1 171 000	Put auf Wechselkurs EUR/PLN Ausübungskurs 4,71 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Morgan Stanley	EUR	10 353	8 305	(2 048)
1 240 000	Put auf Wechselkurs EUR/PLN Ausübungskurs 4,73 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Bank of America	EUR	10 988	13 730	2 742
234 000	Put auf Wechselkurs EUR/SEK Ausübungskurs 10,60 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Barclays Bank	EUR	17 906	1 013	(16 893)
1 174 000	Put auf Wechselkurs EUR/USD Ausübungskurs 1,07 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Barclays Bank	EUR	14 314	2 659	(11 655)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
1 018 000	Put auf Wechselkurs EUR/USD Ausübungskurs 1,08 Verfallstermin 13. Jun. 2023	Barclays Bank	EUR	19 109	10 267	(8 842)
1 049 000	Put auf Wechselkurs EUR/USD Ausübungskurs 1,09 Verfallstermin 25. Apr. 2023	Morgan Stanley	EUR	18 019	14 599	(3 420)
1 074 000	Put auf Wechselkurs GBP/AUD Ausübungskurs 1,84 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Citi Bank	GBP	13 036	10 444	(2 592)
725 000	Put auf Wechselkurs GBP/JPY Ausübungskurs 159,72 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Barclays Bank	GBP	14 368	3 626	(10 742)
691 000	Put auf Wechselkurs GBP/JPY Ausübungskurs 159,84 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Goldman Sachs	GBP	14 113	1 859	(12 254)
906 000	Put auf Wechselkurs GBP/USD Ausübungskurs 1,22 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Barclays Bank	GBP	13 480	5 240	(8 240)
(3 680 000)	Put auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 4,95 Verfallstermin 08. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(65 798)	(32 582)	33 216
(1 806 000)	Put auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,05 Verfallstermin 14. Jun. 2023	Goldman Sachs	USD	(33 532)	(39 348)	(5 816)
1 290 000	Put auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,20 Verfallstermin 05. Apr. 2023	Goldman Sachs	USD	23 143	34 411	11 268
1 252 000	Put auf Wechselkurs USD/BRL Ausübungskurs 5,27 Verfallstermin 13. Apr. 2023	HSBC	USD	26 383	51 253	24 870
262 000	Put auf Wechselkurs USD/CAD Ausübungskurs 1,27 Verfallstermin 06. Apr. 2023	Bank of America	USD	17 816	-	(17 816)
254 000	Put auf Wechselkurs USD/CAD Ausübungskurs 1,28 Verfallstermin 25. Apr. 2023	Bank of America	USD	24 232	808	(23 424)
1 288 000	Put auf Wechselkurs USD/CAD Ausübungskurs 1,38 Verfallstermin 07. Apr. 2023	Bank of America	USD	11 038	25 402	14 364
1 144 000	Put auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,91 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	18 709	8 227	(10 482)
(3 956 000)	Put auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,92 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(43 259)	(40 113)	3 146
1 108 000	Put auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,92 Verfallstermin 12. Jun. 2023	Goldman Sachs	USD	18 290	24 673	6 383
(3 861 000)	Put auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,92 Verfallstermin 27. Okt. 2023	Bank of America	USD	(159 178)	(154 603)	4 575
(2 621 000)	Put auf Wechselkurs USD/CHF Ausübungskurs 0,93 Verfallstermin 23. Nov. 2023	Goldman Sachs	USD	(111 028)	(132 867)	(21 839)
1 896 000	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 754,00 Verfallstermin 12. Mai 2023	Bank of America	USD	23 857	7 620	(16 237)
1 915 000	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 761,60 Verfallstermin 22. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	24 436	14 528	(9 908)
3 736 000	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 765,50 Verfallstermin 06. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	48 979	42 157	(6 822)
(1 896 000)	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 800,00 Verfallstermin 12. Mai 2023	Bank of America	USD	(68 956)	(46 123)	22 833

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(1 290 000)	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 801,50 Verfallstermin 05. Apr. 2023	UBS	USD	(28 051)	(16 342)	11 709
(1 915 000)	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 808,50 Verfallstermin 22. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(70 223)	(63 031)	7 192
(1 911 000)	Put auf Wechselkurs USD/CLP Ausübungskurs 810,10 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Bank of America	USD	(63 965)	(54 534)	9 431
5 700 000	Put auf Wechselkurs USD/CNH Ausübungskurs 6,79 Verfallstermin 26. Sep. 2023	UBS	USD	99 864	101 989	2 125
3 544 000	Put auf Wechselkurs USD/COP Ausübungskurs 4 544,00 Verfallstermin 14. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	45 682	186 575	140 893
(3 544 000)	Put auf Wechselkurs USD/COP Ausübungskurs 4 825,50 Verfallstermin 14. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	(127 938)	(83 552)	44 386
1 913 000	Put auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 21,30 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Citi Bank	USD	12 071	7 114	(4 957)
1 056 000	Put auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 21,93 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	20 061	19 435	(626)
(1 252 000)	Put auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 22,17 Verfallstermin 13. Apr. 2023	Bank of America	USD	(16 519)	(31 988)	(15 469)
(1 320 000)	Put auf Wechselkurs USD/CZK Ausübungskurs 22,42 Verfallstermin 20. Apr. 2023	Bank of America	USD	(17 266)	(48 482)	(31 216)
1 913 000	Put auf Wechselkurs USD/HUF Ausübungskurs 346,75 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Citi Bank	USD	21 056	18 824	(2 232)
2 912 000	Put auf Wechselkurs USD/HUF Ausübungskurs 346,86 Verfallstermin 31. Mai 2023	Citi Bank	USD	30 940	44 262	13 322
(1 296 000)	Put auf Wechselkurs USD/HUF Ausübungskurs 352,80 Verfallstermin 02. Mai 2023	J.P. Morgan	USD	(25 460)	(24 151)	1 309
(2 912 000)	Put auf Wechselkurs USD/HUF Ausübungskurs 365,35 Verfallstermin 31. Mai 2023	Citi Bank	USD	(93 111)	(126 421)	(33 310)
1 049 000	Put auf Wechselkurs USD/IDR Ausübungskurs 15 231,00 Verfallstermin 15. Mai 2023	Citi Bank	USD	17 623	24 241	6 618
1 038 000	Put auf Wechselkurs USD/IDR Ausübungskurs 15 625,00 Verfallstermin 03. Apr. 2023	Citi Bank	USD	17 179	45 925	28 746
(1 288 000)	Put auf Wechselkurs USD/ILS Ausübungskurs 3,59 Verfallstermin 07. Apr. 2023	J.P. Morgan	USD	(18 451)	(8 363)	10 088
(4 715 000)	Put auf Wechselkurs USD/ILS Ausübungskurs 3,65 Verfallstermin 06. Jun. 2023	Citi Bank	USD	(102 009)	(145 907)	(43 898)
(5 740 000)	Put auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 80,62 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(22 616)	(2 646)	19 970
(1 901 000)	Put auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 80,85 Verfallstermin 27. Apr. 2023	UBS	USD	(7 224)	(1 260)	5 964
1 053 000	Put auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 82,15 Verfallstermin 26. Apr. 2023	J.P. Morgan	USD	11 604	4 545	(7 059)
1 023 000	Put auf Wechselkurs USD/INR Ausübungskurs 82,57 Verfallstermin 12. Jun. 2023	Barclays Bank	USD	11 294	9 722	(1 572)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
785 000	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 115,00 Verfallstermin 06. Okt. 2023	Morgan Stanley	USD	53 773	37 021	(16 752)
(2 588 000)	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 120,00 Verfallstermin 17. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	(23 603)	(178)	23 425
1 302 000	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 120,00 Verfallstermin 01. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	112 163	60 447	(51 716)
(6 013 000)	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 126,65 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Goldman Sachs	USD	(31 075)	(15 290)	15 785
296 000	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 127,00 Verfallstermin 11. Mai 2023	HSBC	USD	25 160	27 369	2 209
518 000	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 127,00 Verfallstermin 11. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	39 627	47 896	8 269
1 320 000	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 130,02 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	19 668	9 297	(10 371)
875 000	Put auf Wechselkurs USD/JPY Ausübungskurs 130,75 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Goldman Sachs	USD	12 409	7 600	(4 809)
(1 933 000)	Put auf Wechselkurs USD/KRW Ausübungskurs 1 311,00 Verfallstermin 31. Mai 2023	Bank of America	USD	(40 235)	(43 842)	(3 607)
(1 320 000)	Put auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 18,63 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(22 546)	(44 674)	(22 128)
(1 229 000)	Put auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 18,94 Verfallstermin 19. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	(24 961)	(61 077)	(36 116)
1 028 000	Put auf Wechselkurs USD/MXN Ausübungskurs 19,18 Verfallstermin 09. Mai 2023	Bank of America	USD	22 541	61 818	39 277
1 229 000	Put auf Wechselkurs USD/NOK Ausübungskurs 10,75 Verfallstermin 19. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	22 872	5 486	(17 386)
1 035 000	Put auf Wechselkurs USD/PHP Ausübungskurs 54,71 Verfallstermin 24. Apr. 2023	Barclays Bank	USD	15 090	12 936	(2 154)
1 023 000	Put auf Wechselkurs USD/PHP Ausübungskurs 55,30 Verfallstermin 13. Jun. 2023	Morgan Stanley	USD	16 130	25 505	9 375
1 913 000	Put auf Wechselkurs USD/PLN Ausübungskurs 4,20 Verfallstermin 26. Apr. 2023	Bank of America	USD	14 291	3 536	(10 755)
1 056 000	Put auf Wechselkurs USD/SGD Ausübungskurs 1,31 Verfallstermin 27. Apr. 2023	HSBC	USD	11 843	1 392	(10 451)
978 000	Put auf Wechselkurs USD/SGD Ausübungskurs 1,34 Verfallstermin 14. Jun. 2023	HSBC	USD	11 629	6 345	(5 284)
(3 800 000)	Put auf Wechselkurs USD/THB Ausübungskurs 33,45 Verfallstermin 27. Sep. 2023	J.P. Morgan	USD	(93 423)	(89 279)	4 144
(5 701 000)	Put auf Wechselkurs USD/THB Ausübungskurs 34,10 Verfallstermin 15. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(108 690)	(79 332)	29 358
(3 736 000)	Put auf Wechselkurs USD/ZAR Ausübungskurs 17,45 Verfallstermin 06. Jun. 2023	Bank of America	USD	(41 451)	(53 495)	(12 044)
1 320 000	Put auf Wechselkurs USD/ZAR Ausübungskurs 18,55 Verfallstermin 20. Apr. 2023	HSBC	USD	25 905	57 405	31 500

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Optionskontrakte (Forts.)

Call oder Put zugrunde liegender Nennwert	Kontrakt	Kontrahent	Währung	Prämie bezahlt/ (erhalten)	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
(575)	Put auf MSCI Brazil 25/50 Index Ausübungskurs 5 360,00 Verfallstermin 19. Mai 2023	Morgan Stanley	USD	(59 225)	(48 477)	10 748
47	Put auf Russell 2000 Index Ausübungskurs 1 680,00 Verfallstermin 21. Apr. 2023	Morgan Stanley	USD	64 076	33 135	(30 941)
(20)	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3 550,00 Verfallstermin 31. Mrz. 2023	Morgan Stanley	USD	(23 214)	(100)	23 114
43	Put auf S&P 500 Index Ausübungskurs 3 750,00 Verfallstermin 31. Mrz. 2023	Morgan Stanley	USD	208 445	215	(208 230)
(3 162)	Put auf XPeng Inc. Ausübungskurs 28,91 Verfallstermin 29. Jun. 2023	BNP Paribas	HKD	(642)	(513)	129
				USD	196 026	(408 789)

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 2023 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 7,69% Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2026", Put; 7,69%; 13. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	384 124	157 510 000	222 610	(161 514)
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	43 660	(52 265)
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	118 920	(422 756)
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 7,29% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2026", Call; 7,29%; 05. Mrz. 2026	J.P. Morgan	MXN	396 524	157 510 000	145 742	(250 782)
Kauf	IRS "Erhält Festzinssatz 8,50% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Apr. 2028", Call; 8,50%; 06. Apr. 2028	J.P. Morgan	MXN	95 925	17 150 000	52 210	(43 715)
Kauf	SWP "Erhält Festzinssatz 7,95% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2024", Call; 7,95%; 13. Mrz. 2024	J.P. Morgan	MXN	210 150	332 045 000	152 919	(57 231)
Verkauf	SWP "Erhält Festzinssatz 7,20% Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE Mrz. 2024", Call; 7,20%; 13. Mrz. 2024	J.P. Morgan	MXN	(61 294)	332 045 000	(56 563)	4 731
				USD		679 498	(983 532)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total Return Swap-Kontrakte

Der Fonds darf Total Return Swaps abschliessen. Ein Total Return Swap ist ein bilateraler finanzieller Vertrag, der es dem Fonds ermöglicht, von allen Cash-Flow-Vorteilen eines Vermögenswerts zu profitieren, ohne diesen Vermögenswert tatsächlich zu besitzen (die «Referenz-Vermögenswert»). Die Teilfonds müssen eine wiederkehrende Prämie (feste oder variable Zahlung) für ihre Rechte darauf bezahlen, die Gesamrendite des Basiswerts (Coupons und/oder Kapitalgewinne und/oder -verluste) zu erhalten. Beim Basiswert kann es sich um fast jeden beliebigen Investitionswert handeln, der eine für die Teilfonds zulässige Investition 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 Gesamtrenditewert der Basiswerte beruht, dargestellt. Letzterer setzt sich aus dem aktuellen beizulegenden Zeitwert der Aktien und den für diese Aktien für das betreffende Swap-Jahr ausgeschütteten Dividenden zusammen. Der nicht realisierte Wertzuwachs/(Wertverlust) ist in der Nettovermögensaufstellung unter «Nicht realisierter Nettowertzuwachs/(-wertverlust) aus Total Return Swap-Kontrakten» aufgeführt.

Zum 31. März 2023 waren folgende Teilfonds in Total Return Swap-Kontrakten engagiert:

Schutzposition	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/(Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	21 830 631	92 272	28. Feb. 2025	4 022 418
Kauf Long	Fluggesellschaften	J.P. Morgan	EUR	16 279 912	(177 726)	21. Mrz. 2024	74 220
Kauf Long	Bekleidung	Morgan Stanley	EUR	12 898 993	564 718	28. Feb. 2025	2 583 081
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	GBP	11 514 671	(1 280 537)	28. Feb. 2025	(1 263 258)
Kauf Long	Unterhaltung	Morgan Stanley	GBP	3 804 969	251 653	28. Feb. 2025	391 168
Kauf Long	Wohngebäude-Bausträger	Goldman Sachs	GBP	13 093 468	(2 468 530)	07. Aug. 2024	(2 564 289)
Kauf Long	Einzelhandel	Goldman Sachs	CHF	7 466 055	1 195 140	18. Jun. 2024	1 637 677
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	J.P. Morgan	USD	2 338 731	43 242	20. Feb. 2024	34 057
Verkauf Short	Bekleidung	J.P. Morgan	USD	2 369 191	(169 856)	18. Sep. 2023	(188 163)
Verkauf Short	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	EUR	839 754	95 438	28. Feb. 2025	37 649
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	817 422	(12 915)	30. Apr. 2024	(12 915)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	441 358	(2 228)	28. Feb. 2025	(2 228)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	500 852	(5 569)	26. Apr. 2023	(124 891)
Verkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	USD	689 088	(43 514)	26. Feb. 2024	(43 514)
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	CHF	941 698	8 889	28. Jan. 2026	8 889
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	941 060	103 580	24. Jul. 2024	369 285
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 071 143	81 054	26. Aug. 2025	98 843
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	862 285	56 629	31. Okt. 2023	97 671
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	CHF	1 116 107	40 111	24. Jul. 2025	1 971
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	2 228 054	110 695	14. Jun. 2023	63 062
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	2 412 931	59 847	28. Feb. 2025	221 696
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	JPY	1 542 936	(10 003)	28. Feb. 2025	1 629
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	981 938	(39 778)	10. Dez. 2025	(36 832)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1 220 823	(2 444)	27. Mrz. 2024	29 863
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Morgan Stanley	USD	436 757	5 751	28. Feb. 2025	5 751
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	USD	1 660 099	(116 471)	08. Jan. 2024	(115 531)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	1 064 285	12 144	28. Feb. 2025	86 765
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	1 775 204	(46 260)	28. Feb. 2025	(253 468)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	2 444 688	260 151	16. Jan. 2024	280 978
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	USD	1 174 071	386 008	17. Sep. 2024	510 807
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	1 551 897	51 062	31. Okt. 2023	(501)
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Morgan Stanley	HKD	1 458 485	(71 317)	26. Feb. 2025	(71 317)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	553 511	(116 893)	26. Apr. 2023	50 140
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	851 427	(92 015)	18. Sep. 2025	(107 942)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	1 143 201	(11 028)	23. Feb. 2024	(11 028)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	1 537 519	(66 528)	11. Mrz. 2024	(66 135)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	909 324	(47 687)	28. Feb. 2025	(52 086)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	1 896 518	81 674	28. Feb. 2025	11 486
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Goldman Sachs	USD	2 423 234	(399 929)	31. Jul. 2024	(128 505)
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Merrill Lynch	USD	2 310 139	(16 910)	31. Mai 2023	27 995

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Merrill Lynch	USD	916 612	76 977	29. Feb. 2024	77 569
Verkauf Short	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	USD	522 858	(27 345)	28. Feb. 2025	(6 063)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	752 282	48 236	27. Feb. 2025	(25 439)
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	1 460 271	(19 517)	16. Apr. 2025	49 597
Verkauf Short	Internet	J.P. Morgan	USD	832 904	(141 885)	15. Apr. 2024	(141 885)
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	USD	1 455 774	5 781	15. Apr. 2024	6 219
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	SEK	2 001 219	(125 466)	09. Jul. 2025	(162 294)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	CHF	423 103	(19 926)	24. Jul. 2024	25 533
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	EUR	460 201	41 326	28. Feb. 2025	1 588
Verkauf Short	Büro- und Geschäftsausstattung	Morgan Stanley	JPY	1 938 907	114 106	28. Feb. 2025	(87 007)
Verkauf Short	Verpackung und Behälter	J.P. Morgan	USD	2 462 124	84 653	21. Mrz. 2024	387 002
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1 498 665	70 791	23. Feb. 2024	4 524
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	2 324 051	(11 297)	28. Feb. 2025	118 489
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	1 812 676	176 169	30. Nov. 2023	169 076
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	1 439 082	369 880	28. Feb. 2025	478 318
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	EUR	686 537	(89 844)	21. Jan. 2026	(89 844)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	SEK	916 018	(220 944)	07. Mai 2025	(184 146)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	CAD	702 695	(120 751)	21. Nov. 2023	(115 556)
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	1 115 146	15 838	29. Dez. 2023	(37 315)
Verkauf Short	Einzelhandel	Merrill Lynch	USD	847 160	(12 405)	30. Apr. 2024	(12 405)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	2 632 795	(229 894)	30. Jun. 2023	122 722
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	706 236	(209 422)	28. Apr. 2023	(139 336)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	1 347 827	(47 281)	28. Mrz. 2024	(47 281)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	416 218	85 888	08. Okt. 2025	84 871
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	852 321	127 594	18. Dez. 2023	116 981
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	1 813 974	(20 820)	02. Jan. 2024	(9 785)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	1 264 272	4 956	08. Mrz. 2024	3 753
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	1 773 553	(51 644)	28. Apr. 2023	141 359
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	5 711 753	(150 357)	31. Okt. 2023	(78 351)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	2 735 066	200 825	28. Feb. 2025	51 193
Verkauf Short	Spielwaren/Spiele/Hobbys	Merrill Lynch	USD	2 647 660	220 733	30. Nov. 2023	294 119
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	USD	1 678 564	(171 861)	07. Nov. 2023	(231 042)
Verkauf Short	Diverse *	Morgan Stanley	EUR	1 920 397	(172 999)	28. Feb. 2025	(161 333)
Verkauf Short	Diverse *	Morgan Stanley	USD	18 574 393	(301 036)	28. Feb. 2025	(412 330)
EUR							5 795 999
Schroder GAIA Helix							
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	JPY	19 419 026	(679 844)	05. Sep. 2023	(679 844)
Verkauf Short	Aktienindex	Barclays Bank	USD	24 737 830	(832 825)	05. Sep. 2023	(832 825)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	123 826 650	(839 326)	05. Sep. 2023	(839 326)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	EUR	15 822 163	(668 669)	05. Sep. 2023	(668 669)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	135 303 744	(6 558 985)	05. Sep. 2023	(6 558 985)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	JPY	82 963 135	(681 028)	05. Sep. 2023	(681 028)
USD							(10 260 677)
Schroder GAIA Sirius US Equity							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	6 227 661	1 091 618	13. Dez. 2023	1 091 648
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	6 242 690	263 884	25. Mrz. 2024	263 884
Kauf Long	Getränke	Merrill Lynch	USD	3 397 564	286 994	21. Nov. 2023	286 994
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	13 328 796	1 034 382	25. Mrz. 2024	1 034 382
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	USD	3 750 667	26 260	28. Jun. 2023	26 347
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Barclays Bank	USD	1 936 950	(22 584)	05. Mai 2023	(34 111)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	1 629 164	24 246	11. Dez. 2023	24 246

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

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Merrill Lynch	USD	1 845 181	29 762	08. Jan. 2024	29 762
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	360 889	65 107	13. Dez. 2023	79 758
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	1 127 522	105 797	25. Mrz. 2024	105 797
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	361 055	35 198	15. Apr. 2024	35 198
Verkauf Short	Banken	Merrill Lynch	USD	2 445 790	673 341	16. Apr. 2024	673 341
Verkauf Short	Baustoffe	Merrill Lynch	USD	554 502	(73)	29. Sep. 2023	(73)
Verkauf Short	Chemie	Merrill Lynch	USD	232 636	6 737	02. Okt. 2023	6 737
Verkauf Short	Chemie	Merrill Lynch	USD	184 139	4 384	09. Apr. 2024	4 384
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	545 686	(25 040)	12. Jun. 2024	(25 040)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1 043 349	88 439	16. Okt. 2023	88 439
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Merrill Lynch	USD	4 200 727	(242 990)	25. Mrz. 2024	(242 990)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	1 053 933	(51 976)	13. Sep. 2023	(51 976)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	369 954	(1 646)	26. Jun. 2023	(1 646)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	256 596	(23 313)	22. Apr. 2024	(23 313)
Verkauf Short	Computer	Merrill Lynch	USD	560 865	(11 547)	29. Apr. 2024	(11 547)
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Merrill Lynch	USD	991 421	(57 553)	30. Mai 2023	(57 553)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	933 903	37 477	12. Mai 2023	37 477
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	915 638	(157 915)	13. Sep. 2023	(157 915)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Merrill Lynch	USD	1 530 288	160 846	24. Mai 2023	160 846
Verkauf Short	Umweltschutz	Goldman Sachs	USD	942 605	(148 601)	13. Dez. 2023	(131 915)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	8 589 952	(124 631)	12. Mai 2023	(124 631)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	1 967 727	125 055	13. Sep. 2023	125 055
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	8 983 427	1 105 638	13. Dez. 2023	1 105 638
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	10 180 131	(212 650)	12. Jun. 2024	(212 650)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	4 401 558	54 852	26. Mai 2023	54 852
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	358 400	(46 039)	12. Jun. 2023	(46 039)
Verkauf Short	Lebensmittel	Merrill Lynch	USD	266 885	(11 774)	24. Nov. 2023	(11 774)
Verkauf Short	Forstprodukte und Papier	Merrill Lynch	USD	168 876	1 990	18. Sep. 2023	1 990
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Merrill Lynch	USD	1 272 159	56 771	30. Okt. 2023	56 771
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	345 569	(63 255)	24. Mai 2023	(63 255)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	1 058 942	(44 392)	11. Dez. 2023	(44 392)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Merrill Lynch	USD	636 023	(21 992)	10. Apr. 2024	(21 992)
Verkauf Short	Versicherungen	Merrill Lynch	USD	426 990	22 976	15. Dez. 2023	22 976
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	865 152	(52 118)	13. Jul. 2023	(52 118)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	813 959	(302 726)	10. Nov. 2023	(302 915)
Verkauf Short	Internet	Merrill Lynch	USD	313 418	(31 342)	24. Nov. 2023	(31 342)
Verkauf Short	Metallprodukte/Eisenwaren	Merrill Lynch	USD	1 489 906	7 183	09. Jan. 2024	7 183
Verkauf Short	Öl und Gas	Merrill Lynch	USD	420 935	(14 505)	04. Dez. 2023	(14 505)
Verkauf Short	Öl und Gas	Merrill Lynch	USD	1 209 410	164 986	11. Mrz. 2024	164 986
Verkauf Short	Öl und Gas	Merrill Lynch	USD	187 118	6 316	24. Apr. 2024	6 316
Verkauf Short	Verpackung und Behälter	Merrill Lynch	USD	431 500	(4 331)	04. Dez. 2023	(4 331)
Verkauf Short	Verpackung und Behälter	Merrill Lynch	USD	184 479	(10 067)	22. Apr. 2024	(10 067)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	1 192 549	14 209	13. Jun. 2023	14 209
Verkauf Short	Pharmazeutika	Merrill Lynch	USD	671 439	(37 143)	25. Sep. 2023	(37 143)
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	1 093 159	27 926	24. Okt. 2023	27 926
Verkauf Short	REITS	Merrill Lynch	USD	186 104	26 557	26. Dez. 2023	26 557
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	560 937	(8 013)	12. Mai 2023	(8 013)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	1 150 899	11 944	10. Nov. 2023	11 944
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	610 884	(55 247)	18. Dez. 2023	(55 247)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	373 291	(41 103)	09. Feb. 2024	(41 103)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)							
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	803 365	(39 461)	25. Mrz. 2024	(39 461)
Verkauf Short	Halbleiter	Merrill Lynch	USD	188 390	(8 960)	29. Apr. 2024	(8 960)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	271 869	(65 557)	13. Dez. 2023	(65 557)
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	804 155	70 752	07. Aug. 2023	70 752
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	220 607	28 412	16. Okt. 2023	28 412
Verkauf Short	Software	Merrill Lynch	USD	1 274 516	(35 111)	05. Feb. 2024	(35 111)
USD							3 706 122
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Kauf Long	Diverse *	Morgan Stanley	USD	478 995 521	2 191 713	23. Okt. 2023	2 191 713
USD							2 191 713
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	EUR	205 634	19 637	24. Mai 2033	19 637
Kauf Long	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	147 874	17 834	18. Mai 2033	17 834
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Goldman Sachs	GBP	93 387	(887)	24. Mai 2033	(887)
Kauf Long	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	GBP	545 566	(22 434)	18. Mai 2033	(22 434)
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Goldman Sachs	USD	71 785	5 031	25. Mai 2033	5 031
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	J.P. Morgan	USD	17 713	13	08. Mai 2028	13
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	292 727	1 547	18. Mai 2033	1 547
Kauf Long	Autoteile und -zubehör	Morgan Stanley	USD	112 332	5 846	19. Mai 2033	5 846
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	EUR	1 550 721	46 113	24. Mai 2033	46 113
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	JPY	227 761	6 185	24. Mai 2033	6 185
Kauf Long	Banken	Goldman Sachs	USD	3 025 410	8 780	24. Mai 2033	8 780
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	CAD	200 278	(11 797)	05. Mai 2028	(11 797)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	EUR	1 593 623	(158 204)	05. Mai 2028	(158 204)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	JPY	1 466 431	(149 804)	08. Mai 2028	(149 804)
Kauf Long	Banken	J.P. Morgan	USD	3 466 694	(299 356)	05. Mai 2028	(299 356)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	CAD	2 502 463	(25 179)	18. Mai 2033	(25 179)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	EUR	825 899	40 671	18. Mai 2033	40 671
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	JPY	1 194 823	278 754	18. Mai 2033	(20 140)
Kauf Long	Banken	Morgan Stanley	USD	571 183	14 155	18. Mai 2033	14 155
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	DKK	490 419	16 754	24. Mai 2033	16 754
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	HKD	187 981	(30 628)	24. Mai 2033	(30 628)
Kauf Long	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	3 204 166	(22 730)	24. Mai 2033	(22 730)
Kauf Long	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	602 897	(5 105)	05. Mai 2028	(5 105)
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	DKK	230 149	7 395	18. Mai 2033	7 395
Kauf Long	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	5 432 035	18 313	18. Mai 2033	18 313
Kauf Long	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	384 728	19 221	18. Mai 2033	19 221
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	EUR	405 044	19 898	24. Mai 2033	19 898
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	HKD	67 301	4 095	24. Mai 2033	4 095
Kauf Long	Chemie	Goldman Sachs	USD	66 687	1 665	25. Mai 2033	1 665
Kauf Long	Chemie	Morgan Stanley	USD	20 936	1 886	19. Mai 2033	1 886
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	788 706	(2 528)	24. Mai 2033	(2 528)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	364 273	(13 383)	18. Mai 2033	(13 383)
Kauf Long	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	246 498	(33 330)	19. Mai 2033	(33 330)
Kauf Long	Computer	Goldman Sachs	USD	560 376	(12 940)	24. Mai 2033	(12 940)
Kauf Long	Computer	J.P. Morgan	USD	101 876	16 993	05. Mai 2028	16 993
Kauf Long	Computer	Morgan Stanley	USD	2 691 176	393 040	18. Mai 2033	393 040
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	CHF	246 321	11 175	24. Mai 2033	11 175
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	124 572	620	24. Mai 2033	620

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

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	-	-	24. Mai 2033	-
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	537 011	19 703	24. Mai 2033	19 703
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	891 049	(35 019)	05. Mai 2028	(35 019)
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	CHF	466 929	84 496	18. Mai 2033	84 496
Kauf Long	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	2 985 976	112 709	18. Mai 2033	112 709
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	EUR	20 368	746	24. Mai 2033	746
Kauf Long	Elektrik	Goldman Sachs	USD	557 454	9 116	24. Mai 2033	9 116
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	EUR	1 173 644	46 630	05. Mai 2028	46 630
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	HKD	77 545	(8 812)	05. Mai 2028	(8 812)
Kauf Long	Elektrik	J.P. Morgan	USD	933 401	33 203	05. Mai 2028	33 203
Kauf Long	Elektrik	Morgan Stanley	EUR	6 989	387	18. Mai 2033	387
Kauf Long	Elektrik	Morgan Stanley	USD	644 868	12 605	18. Mai 2033	12 605
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	SGD	64 237	5 274	24. Mai 2033	5 274
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	581 778	15 152	24. Mai 2033	15 152
Kauf Long	Elektronik	Goldman Sachs	USD	385	-	25. Mai 2033	-
Kauf Long	Elektronik	J.P. Morgan	USD	603 792	(13 772)	05. Mai 2028	(13 772)
Kauf Long	Elektronik	Morgan Stanley	USD	256 459	30 377	18. Mai 2033	31 827
Kauf Long	Energie – Alternative Energieträger	Goldman Sachs	USD	110 429	(11 980)	24. Mai 2033	(11 980)
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	70 106	2 223	24. Mai 2033	2 223
Kauf Long	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	311 438	25 240	18. Mai 2033	25 240
Kauf Long	Aktienindex	Goldman Sachs	EUR	713 875	30 305	24. Mai 2033	30 305
Kauf Long	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	1 638 760	71 377	24. Mai 2033	73 477
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	802 342	41 536	18. Mai 2033	41 536
Kauf Long	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	2 514 477	71 411	18. Mai 2033	71 860
Kauf Long	Gas	Morgan Stanley	USD	94 665	(801)	18. Mai 2033	(801)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	CHF	100 412	5 466	24. Mai 2033	5 466
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	EUR	1 962	(81)	24. Mai 2033	(81)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	GBP	36 093	(1 242)	24. Mai 2033	(1 242)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	HKD	3 055	44	24. Mai 2033	44
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	3 084 933	92 160	24. Mai 2033	92 160
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	108 427	4 517	25. Mai 2033	4 517
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	3 401 516	148 123	05. Mai 2028	148 123
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	CHF	138 232	6 072	18. Mai 2033	6 072
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	GBP	145 551	(7 167)	18. Mai 2033	(7 167)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	HKD	107 608	(1 145)	18. Mai 2033	(1 145)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	300 693	11 261	18. Mai 2033	11 261
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	3 096 256	(2 687)	24. Mai 2033	(2 687)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	CHF	47 977	(1 451)	05. Mai 2028	(1 451)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	2 107 867	(59 556)	05. Mai 2028	(59 556)
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	CHF	234 815	13 252	18. Mai 2033	13 252
Kauf Long	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	821 428	5 012	18. Mai 2033	5 012
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	463 406	11 796	24. Mai 2033	11 796
Kauf Long	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	98 837	1 100	18. Mai 2033	1 100
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Goldman Sachs	JPY	122 907	4 289	24. Mai 2033	4 289
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	J.P. Morgan	JPY	119 723	2 328	20. Mai 2033	2 328
Kauf Long	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	JPY	671 166	3 430	18. Mai 2033	3 430
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	EUR	206 072	(10 702)	05. Mai 2028	(10 702)
Kauf Long	Versicherungen	J.P. Morgan	JPY	271 668	(50 011)	08. Mai 2028	(50 011)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	209 294	14 998	18. Mai 2033	14 998
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	JPY	499 224	(16 786)	18. Mai 2033	(16 786)
Kauf Long	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	221 227	5 672	18. Mai 2033	5 672
Kauf Long	Internet	Goldman Sachs	USD	11 826	1 115	24. Mai 2033	1 115
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	HKD	372 905	17 189	18. Mai 2033	17 189
Kauf Long	Internet	Morgan Stanley	USD	371 344	36 000	18. Mai 2033	36 000
Kauf Long	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	JPY	90 712	627	18. Mai 2033	627
Kauf Long	Maschinen – Bau und Bergbau	Morgan Stanley	USD	350 812	7 445	18. Mai 2033	7 445
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	GBP	546 301	31 609	24. Mai 2033	31 609
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	181 024	5 128	24. Mai 2033	5 128
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	EUR	558 740	52 338	18. Mai 2033	52 338
Kauf Long	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	322 319	6 747	18. Mai 2033	6 747
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	GBP	167 383	3 346	24. Mai 2033	3 346
Kauf Long	Bergbau	Goldman Sachs	USD	291 988	2 978	24. Mai 2033	2 978
Kauf Long	Bergbau	J.P. Morgan	GBP	387 717	(34 834)	05. Mai 2028	(34 834)
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	CAD	673 758	76 884	18. Mai 2033	76 884
Kauf Long	Bergbau	Morgan Stanley	USD	282 879	17 639	18. Mai 2033	17 639
Kauf Long	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	109 072	4 057	18. Mai 2033	4 057
Kauf Long	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	3 254 407	(157 327)	05. Mai 2028	(157 327)
Kauf Long	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	70 587	3 535	18. Mai 2033	3 535
Kauf Long	Öl und Gas	Morgan Stanley	GBP	283 586	14 240	18. Mai 2033	14 240
Kauf Long	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	2 886 857	236 160	18. Mai 2033	236 160
Kauf Long	Öl- und Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	156 236	(63 301)	05. Mai 2028	(63 301)
Kauf Long	Öl- und Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	148 419	(18 463)	18. Mai 2033	(18 463)
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	360 646	33 307	24. Mai 2033	33 307
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	1 476 135	76 930	24. Mai 2033	76 930
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	1 118 942	30 979	24. Mai 2033	30 979
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	1 752 694	90 537	24. Mai 2033	90 537
Kauf Long	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	1 386 109	28 720	24. Mai 2033	28 720
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	CHF	144 381	8 505	05. Mai 2028	8 505
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	458 800	21 084	05. Mai 2028	21 084
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	HUF	111 034	(4 467)	05. Mai 2028	(4 467)
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	16 196	1 472	08. Mai 2028	1 472
Kauf Long	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	1 583 627	(21 658)	05. Mai 2028	(21 658)
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	202 360	10 923	18. Mai 2033	10 923
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	GBP	262 574	3 645	18. Mai 2033	3 645
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	194 431	7 175	18. Mai 2033	7 175
Kauf Long	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	1 236 107	15 295	18. Mai 2033	15 295
Kauf Long	Pipelines	Goldman Sachs	USD	152 421	8 069	24. Mai 2033	8 069
Kauf Long	Pipelines	J.P. Morgan	USD	815 207	(18 075)	05. Mai 2028	(19 907)
Kauf Long	Pipelines	Morgan Stanley	USD	658 226	33 574	18. Mai 2033	33 574
Kauf Long	Private Equity	J.P. Morgan	USD	1 156 228	(4 005)	05. Mai 2028	(4 005)
Kauf Long	Private Equity	Morgan Stanley	USD	83 650	8 969	18. Mai 2033	8 969
Kauf Long	REITS	J.P. Morgan	USD	558 168	(16 189)	05. Mai 2028	(16 189)
Kauf Long	REITS	Morgan Stanley	USD	100 815	814	18. Mai 2033	814
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	EUR	81 143	1 504	24. Mai 2033	1 504
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	JPY	3 152 587	42 198	24. Mai 2033	42 198
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	1 018 728	34 497	24. Mai 2023	34 497

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf Long	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	482 306	58 055	24. Mai 2033	58 055
Kauf Long	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	1 106 381	180 443	05. Mai 2028	180 443
Kauf Long	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	1 664 116	93 243	18. Mai 2033	93 243
Kauf Long	Software	J.P. Morgan	USD	81 802	(8 503)	05. Mai 2028	(8 503)
Kauf Long	Software	Morgan Stanley	USD	1 085 798	62 259	18. Mai 2033	62 259
Kauf Long	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	386 037	44 237	24. Mai 2033	44 237
Kauf Long	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	171 411	27 888	05. Mai 2028	27 888
Kauf Long	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	25 995	4 250	18. Mai 2033	4 250
Kauf Long	Transport	Morgan Stanley	EUR	955 015	(53 826)	18. Mai 2033	(53 826)
Kauf Long	Diverse *	Morgan Stanley	USD	38 062 389	(283 408)	25. Mai 2033	(283 408)
Verkauf Short	Werbung	Goldman Sachs	GBP	184 707	(3 671)	24. Mai 2033	(3 671)
Verkauf Short	Werbung	Goldman Sachs	USD	567 764	(39 947)	24. Mai 2033	(39 947)
Verkauf Short	Werbung	J.P. Morgan	GBP	106 362	7 909	05. Mai 2028	7 909
Verkauf Short	Werbung	Morgan Stanley	USD	98 531	(11 923)	18. Mai 2033	(11 923)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Goldman Sachs	USD	769 935	(28 802)	24. Mai 2033	(28 802)
Verkauf Short	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	USD	64 418	(4 621)	18. Mai 2033	(4 621)
Verkauf Short	Agrarwirtschaft	Morgan Stanley	USD	594 151	(8 007)	18. Mai 2033	(8 007)
Verkauf Short	Bekleidung	Goldman Sachs	USD	143 502	2 711	24. Mai 2033	2 711
Verkauf Short	Bekleidung	Morgan Stanley	GBP	143 001	(14 095)	18. Mai 2033	(14 095)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	EUR	313 824	(13 253)	24. Mai 2033	(13 253)
Verkauf Short	Automobilhersteller	Goldman Sachs	USD	1 733 423	(177 388)	24. Mai 2033	(189 218)
Verkauf Short	Automobilhersteller	J.P. Morgan	EUR	2 365 505	88 745	05. Mai 2028	88 745
Verkauf Short	Automobilhersteller	Morgan Stanley	USD	807 877	(73 906)	18. Mai 2033	(73 906)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	CHF	490 284	(56 140)	24. Mai 2033	(56 140)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	DKK	71 895	(986)	24. Mai 2033	(986)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	EUR	8 210 997	63 921	24. Mai 2033	63 234
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	GBP	2 493 335	(66 174)	24. Mai 2033	(66 174)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	JPY	1 340 638	(36 197)	24. Mai 2033	(36 197)
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	SEK	2 423 602	67 764	24. Mai 2033	67 764
Verkauf Short	Banken	Goldman Sachs	USD	5 645 803	(107 985)	24. Mai 2033	(154 044)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	AUD	1 392 057	8 867	05. Mai 2028	8 867
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	CZK	581 249	29 738	05. Mai 2028	29 738
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	EUR	2 014 690	164 253	05. Mai 2028	194 717
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	GBP	515 701	(29 340)	05. Mai 2028	(29 340)
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	JPY	543 774	26 235	08. Mai 2028	26 235
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	SEK	3 758 596	445 133	05. Mai 2028	445 133
Verkauf Short	Banken	J.P. Morgan	USD	354 414	320	05. Mai 2028	320
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CAD	5 565 953	(107 530)	18. Mai 2033	(107 530)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	CZK	101 639	(6 857)	18. Mai 2033	(6 857)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	EUR	1 016 826	11 714	18. Mai 2033	11 714
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	JPY	2 214 863	14 994	18. Mai 2033	16 814
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	SEK	1 853 540	(9 069)	18. Mai 2033	(9 069)
Verkauf Short	Banken	Morgan Stanley	USD	4 964 165	(246 286)	18. Mai 2033	(246 286)
Verkauf Short	Getränke	Goldman Sachs	HKD	700	(47)	24. Mai 2033	(47)
Verkauf Short	Getränke	J.P. Morgan	HKD	531	(15)	05. Mai 2028	(15)
Verkauf Short	Getränke	Morgan Stanley	HKD	8 686	(214)	18. Mai 2033	(214)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	AUD	117 112	(1 405)	24. Mai 2033	(1 405)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	CHF	448 207	42 549	24. Mai 2033	42 549

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

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	NOK	44 779	(292)	24. Mai 2033	(292)
Verkauf Short	Biotechnologie	Goldman Sachs	USD	614 624	12 663	24. Mai 2033	12 663
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	AUD	21 791	464	05. Mai 2028	464
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	NOK	12 020	2 517	05. Mai 2028	2 517
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	509 421	17 818	05. Mai 2028	17 818
Verkauf Short	Biotechnologie	J.P. Morgan	USD	34 635	(3 081)	08. Mai 2028	(3 081)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	AUD	397 780	(5 910)	18. Mai 2033	(5 910)
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	NOK	111 153	3 464	19. Mai 2033	3 464
Verkauf Short	Biotechnologie	Morgan Stanley	USD	3 625 534	134 707	18. Mai 2033	135 193
Verkauf Short	Baustoffe	Goldman Sachs	USD	945 414	(47 501)	24. Mai 2033	(47 501)
Verkauf Short	Baustoffe	J.P. Morgan	USD	127 651	5 843	20. Mai 2033	5 843
Verkauf Short	Baustoffe	Morgan Stanley	USD	536 957	(25 374)	18. Mai 2033	(25 374)
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	EUR	638 573	(15 895)	24. Mai 2033	(15 895)
Verkauf Short	Chemie	Goldman Sachs	USD	944 189	(22 545)	24. Mai 2033	(22 545)
Verkauf Short	Chemie	Morgan Stanley	USD	1 353 757	(72 398)	18. Mai 2033	(71 787)
Verkauf Short	Kohle	J.P. Morgan	USD	1 372 641	(13 298)	05. Mai 2028	(13 298)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 416 313	(65 287)	24. Mai 2033	(65 287)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	212 436	(1 778)	05. Mai 2028	(1 778)
Verkauf Short	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	2 553 200	(86 060)	18. Mai 2033	(86 175)
Verkauf Short	Computer	Goldman Sachs	USD	478 198	(37 908)	24. Mai 2033	(37 908)
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	NOK	90 485	(7 686)	19. Mai 2033	(7 686)
Verkauf Short	Computer	Morgan Stanley	USD	2 922 241	(225 797)	18. Mai 2033	(225 797)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Goldman Sachs	EUR	156 703	(9 909)	24. Mai 2033	(9 909)
Verkauf Short	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	54 791	(6 045)	18. Mai 2033	(6 045)
Verkauf Short	Rentenfonds	Goldman Sachs	USD	146 414	(3 761)	24. Mai 2033	(3 761)
Verkauf Short	Rentenfonds	Morgan Stanley	USD	2 112 980	(59 364)	18. Mai 2033	(59 364)
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Goldman Sachs	EUR	677 063	(25 574)	24. Mai 2033	(23 040)
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Goldman Sachs	USD	598 684	(16 957)	24. Mai 2033	(16 957)
Verkauf Short	Vertrieb/Grosshandel	Morgan Stanley	USD	1 033 186	(27 847)	18. Mai 2033	(27 847)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	1 698 375	(27 655)	24. Mai 2033	(27 655)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	GBP	548 929	3 884	24. Mai 2033	3 884
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	SEK	86 094	909	24. Mai 2033	909
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	6 338 363	(228 801)	24. Mai 2033	(228 801)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	593 833	72 231	05. Mai 2028	72 231
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	GBP	667 590	57 257	05. Mai 2028	60 439
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	SEK	554 384	74 990	05. Mai 2028	74 990
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	SGD	2 956	(155)	05. Mai 2028	(155)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1 089 685	81 905	05. Mai 2028	81 905
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	1 057 439	(60 789)	18. Mai 2033	(60 789)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	SEK	287 154	(4 618)	18. Mai 2033	(4 618)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	SGD	319	(30)	18. Mai 2033	(30)
Verkauf Short	Diversifizierte Finanzdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	8 606 714	(273 534)	18. Mai 2033	(269 710)
Verkauf Short	Elektrik	Goldman Sachs	USD	5 934 150	(40 554)	24. Mai 2033	(40 554)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	JPY	693 165	(25 076)	05. Mai 2028	(25 144)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	1 572 490	(42 966)	05. Mai 2028	(42 966)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	138 665	(5 155)	16. Mai 2033	(5 155)
Verkauf Short	Elektrik	J.P. Morgan	USD	295 233	(649)	20. Mai 2033	(649)
Verkauf Short	Elektrik	Morgan Stanley	USD	3 048 415	(34 555)	18. Mai 2033	(34 555)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Elektrische Bauteile und Geräte	Goldman Sachs	USD	48 957	(3 612)	11. Dez. 2023	(3 612)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	JPY	956 055	(5 786)	24. Mai 2033	(5 786)
Verkauf Short	Elektronik	Goldman Sachs	USD	93 328	(4 744)	24. Mai 2033	(4 744)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	JPY	987 836	(25 869)	08. Mai 2028	(14 167)
Verkauf Short	Elektronik	J.P. Morgan	USD	440 123	14 425	05. Mai 2028	14 425
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	EUR	56 183	7 176	18. Mai 2033	7 176
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	JPY	846 464	(18 431)	18. Mai 2033	(18 431)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	SEK	791 344	(20 788)	18. Mai 2033	(20 788)
Verkauf Short	Elektronik	Morgan Stanley	USD	822 778	(32 981)	18. Mai 2033	(32 981)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Goldman Sachs	DKK	914 060	(18 870)	24. Mai 2033	(18 870)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Goldman Sachs	NOK	141 471	2 566	24. Mai 2033	2 566
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Goldman Sachs	SEK	12 477	(134)	24. Mai 2033	(134)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Goldman Sachs	USD	257 720	(77 680)	24. Mai 2033	(77 680)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	J.P. Morgan	EUR	54 599	(3 244)	05. Mai 2028	(3 244)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	J.P. Morgan	JPY	115 326	(3 034)	15. Mai 2033	(3 034)
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	J.P. Morgan	SEK	82 522	15 334	05. Mai 2028	15 334
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	J.P. Morgan	USD	1 422 060	128 281	05. Mai 2028	128 281
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	J.P. Morgan	USD	54 602	(2 372)	16. Mai 2033	560
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Morgan Stanley	JPY	169 595	1 567	18. Mai 2033	1 567
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Morgan Stanley	NOK	33 047	108	19. Mai 2033	108
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Morgan Stanley	SEK	39 304	943	18. Mai 2033	943
Verkauf Short	Energie – Alternative Energieträger	Morgan Stanley	USD	461 291	(32 172)	18. Mai 2033	(31 210)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	EUR	810 204	(30 468)	24. Mai 2033	(30 468)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Goldman Sachs	USD	963 256	(77 028)	24. Mai 2033	(77 028)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	340 649	(19 173)	18. Mai 2033	(19 173)
Verkauf Short	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	USD	206 590	(20 699)	18. Mai 2033	(20 699)
Verkauf Short	Unterhaltung	Goldman Sachs	USD	477 595	(27 008)	24. Mai 2033	(27 008)
Verkauf Short	Umweltschutz	Morgan Stanley	USD	747 007	(55 313)	18. Mai 2033	(55 313)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	1 710 823	(34 062)	01. Apr. 2024	(34 062)
Verkauf Short	Aktienindex	Goldman Sachs	USD	3 992 137	(90 720)	24. Mai 2033	(90 720)
Verkauf Short	Aktienindex	J.P. Morgan	USD	4 329 736	73 389	05. Mai 2028	226
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	EUR	1 469 636	(49 270)	18. Mai 2033	(51 812)
Verkauf Short	Aktienindex	Morgan Stanley	USD	26 743 343	(1 621 186)	18. Mai 2033	(1 643 935)
Verkauf Short	ETC-Fonds	Morgan Stanley	USD	283 371	34 175	18. Mai 2033	34 175
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	EUR	68 191	(361)	24. Mai 2033	(361)
Verkauf Short	Lebensmittel	Goldman Sachs	GBP	437 504	(29 071)	24. Mai 2033	(29 071)
Verkauf Short	Lebensmittel	J.P. Morgan	EUR	45 953	(330)	05. Mai 2028	(330)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	252 007	(5 612)	18. Mai 2033	(5 612)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	GBP	39 331	(10 369)	18. Mai 2033	(10 369)
Verkauf Short	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	61 423	69 569	18. Mai 2033	(835)
Verkauf Short	Forstprodukte und Papier	Goldman Sachs	EUR	562 445	6 333	24. Mai 2033	6 333
Verkauf Short	Gas	J.P. Morgan	USD	324 791	2 992	05. Mai 2028	2 992
Verkauf Short	Gas	Morgan Stanley	USD	197 408	2 464	18. Mai 2033	2 464
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	Goldman Sachs	USD	30 589	(1 122)	24. Mai 2033	(1 122)
Verkauf Short	Hand- und Maschinenwerkzeuge	J.P. Morgan	USD	143 478	728	05. Mai 2028	728
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	CHF	278 674	(29 256)	24. Mai 2033	(29 256)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	DKK	352 325	(1 386)	24. Mai 2033	(1 386)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	EUR	1 101 324	52 414	24. Mai 2033	52 414

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	HKD	45 574	(222)	24. Mai 2033	(222)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	SEK	645 276	(9 855)	24. Mai 2033	(9 855)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Goldman Sachs	USD	1 291 033	(91 983)	24. Mai 2033	(91 983)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	DKK	235 800	24 102	05. Mai 2028	24 102
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	HKD	52 851	236	05. Mai 2028	236
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	SEK	236 821	9 074	05. Mai 2028	9 074
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	J.P. Morgan	USD	174 789	(47 454)	05. Mai 2028	(47 454)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	HKD	164 149	(2 691)	18. Mai 2033	(2 691)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	SEK	228 693	875	18. Mai 2033	875
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Produkte	Morgan Stanley	USD	2 073 374	(161 479)	18. Mai 2033	(161 479)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	EUR	1 437 426	(45 434)	24. Mai 2033	(45 434)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 967 821	(100 291)	24. Mai 2033	(100 291)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	EUR	254 907	(7 757)	05. Mai 2028	(7 757)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	J.P. Morgan	USD	145 169	(7 804)	05. Mai 2028	(7 804)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	972 994	(23 057)	18. Mai 2033	(23 057)
Verkauf Short	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	659 006	(45 261)	18. Mai 2033	(45 261)
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Goldman Sachs	USD	401 727	(10 895)	24. Mai 2033	(10 895)
Verkauf Short	Wohngebäude-Bauträger	Morgan Stanley	USD	1 708 065	(33 664)	18. Mai 2033	(33 664)
Verkauf Short	Heimeinrichtungsgegenstände	Morgan Stanley	USD	136 350	(3 591)	18. Mai 2033	(3 591)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	EUR	1 679 500	(84 759)	24. Mai 2033	(84 759)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	GBP	656 990	(24 551)	24. Mai 2033	(24 349)
Verkauf Short	Versicherungen	Goldman Sachs	USD	307 113	(4 315)	24. Mai 2033	(4 315)
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	EUR	820 062	(2)	05. Mai 2028	(2)
Verkauf Short	Versicherungen	J.P. Morgan	JPY	1 139	177	08. Mai 2028	177
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	CHF	490 473	(22 470)	18. Mai 2033	(22 470)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	EUR	1 435 470	(102 310)	18. Mai 2033	(102 310)
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	JPY	796 719	32 079	18. Mai 2033	32 079
Verkauf Short	Versicherungen	Morgan Stanley	USD	1 783 756	3 426	18. Mai 2033	11 150
Verkauf Short	Internet	Goldman Sachs	USD	264 521	50 461	24. Mai 2033	(33 424)
Verkauf Short	Internet	Morgan Stanley	USD	1 391 038	(47 752)	18. Mai 2033	(51 815)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Goldman Sachs	USD	655 224	(38 399)	24. Mai 2033	(38 399)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	J.P. Morgan	USD	300 241	(10 900)	05. Mai 2028	(10 900)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	AUD	6 372	(256)	18. Mai 2033	(256)
Verkauf Short	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	USD	233 046	(9 957)	18. Mai 2033	(13 256)
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	JPY	144 574	(14 931)	24. Mai 2023	(14 931)
Verkauf Short	Freizeit	Goldman Sachs	USD	43 327	(1 257)	24. Mai 2033	(1 257)
Verkauf Short	Freizeit	J.P. Morgan	USD	235 798	18 812	05. Mai 2028	18 812
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	JPY	3 055	(198)	18. Mai 2033	(198)
Verkauf Short	Freizeit	Morgan Stanley	USD	97 967	(2 928)	18. Mai 2033	(2 928)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	EUR	75 989	(5 163)	24. Mai 2033	(5 163)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Goldman Sachs	USD	403 022	(21 894)	24. Mai 2033	(21 894)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	EUR	689 442	74 694	05. Mai 2028	74 694
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	J.P. Morgan	JPY	307 738	(2 852)	08. Mai 2028	(2 852)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	JPY	447 115	(4 077)	18. Mai 2033	(4 077)
Verkauf Short	Maschinen – Diversifiziert	Morgan Stanley	USD	728 245	(61 382)	18. Mai 2033	(61 382)
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	SEK	118 480	801	24. Mai 2033	801
Verkauf Short	Medien	Goldman Sachs	USD	20 292	(824)	24. Mai 2033	(824)
Verkauf Short	Medien	Morgan Stanley	USD	346 824	(14 001)	18. Mai 2033	(14 001)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Metallprodukte/Eisenwaren	Goldman Sachs	EUR	67 708	(2 126)	24. Mai 2033	(2 126)
Verkauf Short	Bergbau	Goldman Sachs	GBP	379 661	(14 229)	24. Mai 2033	(14 229)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Goldman Sachs	USD	1 362 558	(86 069)	24. Mai 2033	(86 069)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	J.P. Morgan	USD	54 310	5 807	05. Mai 2028	5 807
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	HKD	342 034	(35 376)	18. Mai 2033	(35 376)
Verkauf Short	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	895 996	(38 383)	18. Mai 2033	(38 383)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	AUD	184 552	(4 403)	24. Mai 2033	(4 403)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	CAD	70 198	(2 876)	25. Mai 2033	(2 876)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	EUR	1 500 241	(96 093)	24. Mai 2033	(96 093)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	GBP	109 579	(3 630)	24. Mai 2033	(3 630)
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	NOK	133 788	343	24. Mai 2033	343
Verkauf Short	Öl und Gas	Goldman Sachs	USD	858 213	(30 415)	24. Mai 2033	(30 415)
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	AUD	42 531	240	05. Mai 2028	240
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	CAD	871 447	11 351	05. Mai 2028	11 351
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	EUR	8 442	436	05. Mai 2028	436
Verkauf Short	Öl und Gas	J.P. Morgan	USD	7 499 335	273 011	05. Mai 2028	327 938
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	AUD	102 655	3 885	18. Mai 2033	3 885
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	CAD	1 880 015	(48 052)	18. Mai 2033	(48 052)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	NOK	133 146	(213)	19. Mai 2033	(213)
Verkauf Short	Öl und Gas	Morgan Stanley	USD	3 455 472	(215 135)	18. Mai 2033	(216 523)
Verkauf Short	Öl- und Gasdienstleistungen	Goldman Sachs	USD	1 467 336	(39 741)	24. Mai 2033	(39 741)
Verkauf Short	Öl- und Gasdienstleistungen	J.P. Morgan	USD	1 373 029	189 382	05. Mai 2028	191 632
Verkauf Short	Öl- und Gasdienstleistungen	Morgan Stanley	USD	332 941	(11 698)	18. Mai 2033	(11 698)
Verkauf Short	Verpackung und Behälter	Goldman Sachs	USD	58 533	(2 808)	24. Mai 2033	(2 808)
Verkauf Short	Verpackung und Behälter	Morgan Stanley	USD	121 738	(7 443)	18. Mai 2033	(7 443)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	CHF	165 829	(6 679)	24. Mai 2033	(6 679)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	DKK	393 941	(38 848)	24. Mai 2033	(38 848)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	EUR	1 423 755	12 808	24. Mai 2033	12 808
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	GBP	47 400	(1 841)	24. Mai 2033	(1 841)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	134 801	(9 769)	24. Mai 2033	(9 769)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	JPY	296 854	(12 834)	24. Mai 2033	(12 834)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	58 819	2 666	24. Mai 2033	2 666
Verkauf Short	Pharmazeutika	Goldman Sachs	USD	738 770	(34 946)	24. Mai 2033	(34 946)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	DKK	24 374	(1 925)	05. Mai 2028	(1 925)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	EUR	45 672	3 339	05. Mai 2028	3 339
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	GBP	150 800	6 135	05. Mai 2028	6 135
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	21 651	(1 549)	09. Mai 2023	(1 549)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	JPY	1 457	(116)	08. Mai 2028	(116)
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	5 015	67	09. Mai 2023	67
Verkauf Short	Pharmazeutika	J.P. Morgan	USD	380 702	(6 053)	05. Mai 2028	(6 053)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	DKK	354 999	(33 868)	18. Mai 2033	(33 868)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	EUR	1 220 557	(75 622)	18. Mai 2033	(75 622)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	JPY	281 518	(20 243)	18. Mai 2033	(20 243)
Verkauf Short	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	3 862 909	(44 430)	18. Mai 2033	(44 430)
Verkauf Short	Pipelines	Goldman Sachs	USD	244 732	(13 900)	24. Mai 2033	(13 900)
Verkauf Short	Pipelines	J.P. Morgan	USD	1 604 056	24 508	05. Mai 2028	54 601
Verkauf Short	Pipelines	Morgan Stanley	USD	1 688 078	(103 907)	18. Mai 2033	(103 907)
Verkauf Short	Private Equity	Goldman Sachs	USD	1 451 533	(77 051)	24. Mai 2033	(77 051)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Total Return Swapkontrakte (Forts.)

Schutz- position	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Marktwert	Fälligkeits- datum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf Short	Private Equity	J.P. Morgan	USD	396 641	46 750	05. Mai 2028	46 750
Verkauf Short	Private Equity	Morgan Stanley	USD	3 687 832	(114 406)	18. Mai 2033	(114 406)
Verkauf Short	Immobilien	Goldman Sachs	USD	108 371	631	24. Mai 2033	631
Verkauf Short	Immobilien	J.P. Morgan	SEK	41 990	3 988	05. Mai 2028	3 988
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	EUR	247 400	300	18. Mai 2033	300
Verkauf Short	Immobilien	Morgan Stanley	SEK	176 288	1 032	18. Mai 2033	1 032
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	EUR	10 389	714	24. Mai 2033	714
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	GBP	121 113	(2 342)	24. Mai 2033	(2 342)
Verkauf Short	REITS	Goldman Sachs	USD	167 332	5 514	24. Mai 2033	5 514
Verkauf Short	REITS	J.P. Morgan	EUR	733 994	(11 152)	05. Mai 2028	(11 152)
Verkauf Short	REITS	Morgan Stanley	USD	945 289	15 366	18. Mai 2033	15 285
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	EUR	24 970	(3 697)	24. Mai 2033	(3 697)
Verkauf Short	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	2 545 439	(149 118)	24. Mai 2033	(149 118)
Verkauf Short	Einzelhandel	J.P. Morgan	USD	1 180 067	23 055	05. Mai 2028	23 055
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	206 788	(25 619)	18. Mai 2033	(25 619)
Verkauf Short	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	2 124 071	(173 707)	18. Mai 2033	(170 515)
Verkauf Short	Halbleiter	Goldman Sachs	USD	1 435 249	(62 119)	24. Mai 2033	(62 119)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	37 877	(7 445)	09. Mai 2023	(7 381)
Verkauf Short	Halbleiter	J.P. Morgan	USD	110 825	679	05. Mai 2028	679
Verkauf Short	Halbleiter	Morgan Stanley	USD	3 566 113	(158 979)	18. Mai 2033	(160 454)
Verkauf Short	Schiffbau	Morgan Stanley	USD	133 581	(4 761)	18. Mai 2033	(4 761)
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	PLN	82 632	12 432	24. Mai 2033	12 432
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	SEK	287 438	13 290	24. Mai 2033	13 290
Verkauf Short	Software	Goldman Sachs	USD	928 079	(63 099)	24. Mai 2033	(63 099)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	AUD	194 902	(6 711)	05. Mai 2028	(6 711)
Verkauf Short	Software	J.P. Morgan	USD	407 779	(7 403)	05. Mai 2028	(7 403)
Verkauf Short	Software	Morgan Stanley	USD	3 489 623	(129 257)	18. Mai 2033	(129 614)
Verkauf Short	Telekommunikation	Goldman Sachs	USD	912 806	(58 359)	24. Mai 2033	(58 359)
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	JPY	1 049 741	(27 549)	08. Mai 2028	(27 549)
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	184 024	30 991	05. Mai 2028	30 991
Verkauf Short	Telekommunikation	J.P. Morgan	USD	4 667	(225)	20. Mai 2033	(225)
Verkauf Short	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	698 356	(30 193)	18. Mai 2033	(27 293)
Verkauf Short	Spielwaren/Spiele/Hobbys	J.P. Morgan	JPY	467 742	(3 775)	08. Mai 2028	(1 327)
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	JPY	687 418	20 305	24. Mai 2033	20 305
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	USD	125 657	(3 917)	24. Mai 2023	(3 917)
Verkauf Short	Transport	Goldman Sachs	USD	171 783	(4 474)	24. Mai 2033	(4 474)
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	HKD	5 631	(747)	05. Mai 2028	(761)
Verkauf Short	Transport	J.P. Morgan	JPY	236 988	27 014	08. Mai 2028	27 014
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	JPY	81 131	6 551	18. Mai 2033	6 551
Verkauf Short	Transport	Morgan Stanley	USD	446 757	(37 103)	18. Mai 2033	(37 103)
Verkauf Short	Wasser	Goldman Sachs	USD	25 338	(503)	24. Mai 2033	(503)
Verkauf Short	Wasser	Morgan Stanley	USD	319 623	(2 732)	18. Mai 2033	(2 732)
USD							(4 192 718)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Differenzkontrakte

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

Zum 31. März 2023 wiesen die folgenden Teilfonds Differenzkontrakte auf Finanzindizes und Futures-Kontrakte auf:

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *				
CFD auf australische Aktien	UBS	237 596	(2 077)	(1 122)
CFD auf chinesische Aktien	UBS	198 250	160 564	160 564
CFD auf Aktien aus Hongkong	UBS	49 684	6 632	6 632
CFD auf italienische Aktien	UBS	30 500	(2 137)	(2 137)
CFD auf Aktien aus Macau	UBS	23 000	440	440
CFD auf neuseeländische Aktien	UBS	50 794	3 335	3 335
CFD auf Aktien aus Singapur	UBS	134 977	50 715	50 715
CFD auf südkoreanische Aktien	UBS	(7 851)	(50 882)	(50 882)
CFD auf US-Aktien	UBS	69 410	28 467	28 467
CFD auf MSCI AC Pacific ex Japan Index	UBS	(7 318)	(352 127)	(352 171)
			USD	(157 070)
Schroder GAIA BlueTrend				
CFD auf Stoxx Europe 600 Automobiles & Parts Price Index	Bank of America	1 242	833 007	61 176
CFD auf Stoxx Europe 600 Banks Price Index	Bank of America	2 716	429 808	(10 878)
CFD auf Stoxx Europe 600 Basic Resources Price Index	Bank of America	309	199 217	(161 181)
CFD auf Stoxx Europe 600 Chemicals Price Index	Bank of America	363	479 553	1 152
CFD auf Stoxx Europe 600 Construction & Materials Price Index	Bank of America	1 033	656 713	(7 825)
CFD auf Stoxx Europe 600 Financial Services Price Index	Bank of America	(1 310)	(850 982)	13 230
CFD auf Stoxx Europe 600 Food & Beverage Price Index	Bank of America	190	164 216	(115 855)
CFD auf Stoxx Europe 600 Health Care Price Index	Bank of America	83	92 764	(185)
CFD auf Stoxx Europe 600 Industrial Goods & Services Price Index	Bank of America	1 271	984 591	(28 281)
CFD auf Stoxx Europe 600 Insurance Price Index	Bank of America	430	149 969	(358 405)
CFD auf Stoxx Europe 600 Media Price Index	Bank of America	2 908	1 156 692	58 912
CFD auf Stoxx Europe 600 Oil & Gas Price Index	Bank of America	(601)	(219 534)	(2 506)
CFD auf Stoxx Europe 600 Personal & Household Goods Index	Bank of America	763	907 639	37 139
CFD auf Stoxx Europe 600 Retail Price Index	Bank of America	1 533	606 511	7 290
CFD auf Stoxx Europe 600 Technology Price Index	Bank of America	1 054	796 223	18 180
CFD auf Stoxx Europe 600 Telecommunications Price Index	Bank of America	(2 083)	(489 235)	66 074
CFD auf Stoxx Europe 600 Travel & Leisure Index	Bank of America	3 044	781 893	17 847
CFD auf Stoxx Europe 600 Utilities Price Index	Bank of America	4 918	2 050 171	73 651
CFD auf S&P 500 Consumer Discretionary Sector Index	Goldman Sachs	(1 680)	(1 955 488)	(117 828)
CFD auf S&P 500 Consumer Staples Sector Index	Goldman Sachs	498	388 630	603
CFD auf S&P 500 Energy Sector Index	Goldman Sachs	(1 891)	(1 200 598)	(24 438)
CFD auf S&P 500 Financials Sector Index	Goldman Sachs	(3 136)	(1 678 626)	(423 522)
CFD auf S&P 500 Health Care Sector Index	Goldman Sachs	(1 728)	(2 610 543)	(409 903)
CFD auf S&P 500 Industrials Sector Index	Goldman Sachs	769	658 719	(739 651)
CFD auf S&P 500 Information Technology Sector Index	Goldman Sachs	254	670 300	(26 900)
CFD auf S&P 500 Materials Sector Index	Goldman Sachs	(2 412)	(1 225 098)	(715 425)
CFD auf S&P 500 Utilities Sector Index	Goldman Sachs	(5 030)	(1 730 363)	(200 481)
			USD	46 149
Schroder GAIA Contour Tech Equity				
CFD auf australische Aktien	Morgan Stanley	(47 582)	(360 379)	(360 379)
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	(84 978)	(25 805)	(25 805)
CFD auf kanadische Aktien	Morgan Stanley	(18 689)	(915)	(915)

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Contour Tech Equity (Forts.)				
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	(14 256)	14 440	14 440
CFD auf deutsche Aktien	Morgan Stanley	208 000	991 819	991 819
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	(9 477)	(94 062)	(94 062)
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	(91 942)	(204 135)	(204 135)
CFD auf neuseeländische Aktien	Morgan Stanley	(29 950)	(18 634)	(18 634)
CFD auf norwegische Aktien	Morgan Stanley	346 337	148 858	148 858
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	(579 632)	(2 736 996)	(2 737 190)
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(1 214 384)	(4 152 263)	(4 152 407)
			USD (6 438 072)	(6 438 410)
Schroder GAIA Helix				
CFD auf australische Aktien	Goldman Sachs	495 440	121 191	121 191
CFD auf australische Aktien	J.P. Morgan	11 620 760	529 693	529 693
CFD auf österreichische Aktien	Goldman Sachs	22 718	(151 300)	(151 300)
CFD auf österreichische Aktien	J.P. Morgan	10 273	5 469	5 469
CFD auf belgische Aktien	Goldman Sachs	(4 249)	(96 864)	(96 864)
CFD auf brasilianische Aktien	Goldman Sachs	147	13 424	13 424
CFD auf brasilianische Aktien	J.P. Morgan	1 322	178 880	178 880
CFD auf britische Aktien	Goldman Sachs	8 951 972	92 393	92 393
CFD auf britische Aktien	J.P. Morgan	590 187	417 494	417 494
CFD auf kanadische Aktien	Goldman Sachs	40 690	(72 024)	(72 024)
CFD auf kanadische Aktien	J.P. Morgan	17 598	40 711	40 711
CFD auf chinesische Aktien	Goldman Sachs	5 600 951	683 844	683 844
CFD auf chinesische Aktien	J.P. Morgan	6 296 510	2 788 968	2 788 968
CFD auf tschechische Aktien	Goldman Sachs	(30 732)	(43 579)	(43 579)
CFD auf dänische Aktien	Goldman Sachs	13 703	10 755	10 755
CFD auf dänische Aktien	J.P. Morgan	46 412	201 696	201 696
CFD auf niederländische Aktien	Goldman Sachs	376 504	31 656	31 656
CFD auf niederländische Aktien	J.P. Morgan	76 882	147 709	147 709
CFD auf finnische Aktien	Goldman Sachs	(29 123)	34 014	34 014
CFD auf französische Aktien	Goldman Sachs	87 429	(169 431)	(169 431)
CFD auf französische Aktien	J.P. Morgan	126 408	152 242	152 242
CFD auf georgische Aktien	Goldman Sachs	(39 116)	89 475	89 475
CFD auf deutsche Aktien	Goldman Sachs	100 736	126 894	126 894
CFD auf deutsche Aktien	J.P. Morgan	91 717	348 613	348 613
CFD auf Aktien aus Hongkong	Goldman Sachs	1 936 882	(133 635)	(221 296)
CFD auf Aktien aus Hongkong	J.P. Morgan	870 837	717 879	717 879
CFD auf indische Aktien	Goldman Sachs	7 987	(8 386)	(8 386)
CFD auf indische Aktien	J.P. Morgan	57 534	168 575	168 575
CFD auf irische Aktien	Goldman Sachs	(5 272)	(16 516)	(16 516)
CFD auf israelische Aktien	Goldman Sachs	1 367	21 216	21 216
CFD auf italienische Aktien	Goldman Sachs	77 468	6 861	6 861
CFD auf italienische Aktien	J.P. Morgan	251 084	112 225	112 225
CFD auf japanische Aktien	Goldman Sachs	1 351 749	(892 189)	(892 189)
CFD auf japanische Aktien	J.P. Morgan	7 626 900	5 058 403	5 058 403
CFD auf Aktien aus Macau	Goldman Sachs	108 000	(6 705)	(6 705)
CFD auf Aktien aus Macau	J.P. Morgan	137 000	40 140	40 140
CFD auf neuseeländische Aktien	Goldman Sachs	40 686	(4 316)	(4 316)
CFD auf neuseeländische Aktien	J.P. Morgan	299 761	30 007	30 007
CFD auf norwegische Aktien	Goldman Sachs	120 746	(93 351)	(93 351)
CFD auf norwegische Aktien	J.P. Morgan	129 582	56 620	56 620

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Differenzkontrakte (Forts.)

Kontrakt	Kontrahent	Anzahl	Marktwert	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Helix (Forts.)				
CFD auf peruanische Aktien	J.P. Morgan	13 918	111 901	111 901
CFD auf polnische Aktien	Goldman Sachs	(211)	(10 741)	(10 741)
CFD auf polnische Aktien	J.P. Morgan	(30 723)	122 355	122 355
CFD auf portugiesische Aktien	J.P. Morgan	83 830	48 453	48 453
CFD auf russische Aktien	Goldman Sachs	6 978	-	-
CFD auf saudi-arabische Aktien	J.P. Morgan	229 160	376 972	376 972
CFD auf Aktien aus Singapur	Goldman Sachs	782 178	(33 133)	(33 133)
CFD auf Aktien aus Singapur	J.P. Morgan	832 696	468 398	468 398
CFD auf südafrikanische Aktien	Goldman Sachs	(91 064)	(1 970)	(1 970)
CFD auf südkoreanische Aktien	Goldman Sachs	(48 780)	(28 472)	(28 472)
CFD auf südkoreanische Aktien	J.P. Morgan	(2 164)	(73 244)	(73 244)
CFD auf spanische Aktien	Goldman Sachs	131 625	(135 920)	(135 920)
CFD auf spanische Aktien	J.P. Morgan	136 082	158 023	158 023
CFD auf schwedische Aktien	Goldman Sachs	(293 739)	(96 886)	(96 886)
CFD auf schwedische Aktien	J.P. Morgan	251 583	157 926	157 926
CFD auf Aktien aus der Schweiz	Goldman Sachs	2 696	(42 707)	(42 707)
CFD auf Aktien aus der Schweiz	J.P. Morgan	69 893	460 640	460 640
CFD auf taiwanische Aktien	Goldman Sachs	7 198	23 250	23 250
CFD auf türkische Aktien	Goldman Sachs	1 706 898	(213 126)	(213 126)
CFD auf Aktien aus den Vereinigten Arabischen Emiraten	J.P. Morgan	(125 380)	32 329	32 329
CFD auf US-Aktien	Goldman Sachs	583 456	1 178 283	1 242 175
CFD auf US-Aktien	J.P. Morgan	552 955	1 293 392	1 293 392
CFD auf FTSE 250 Index	Goldman Sachs	(454)	(243 159)	(243 159)
CFD auf GS UK Custom Index	Goldman Sachs	(36 338)	(173 880)	(173 880)
CFD auf HXE High Vol Reversal Index	Goldman Sachs	(33 288)	207 051	207 051
CFD auf HXE Pharma Index	Goldman Sachs	67 611	105 351	105 351
CFD auf HXE Semis Index	Goldman Sachs	(59 640)	(364 278)	(364 278)
CFD auf HXE Staples Index	Goldman Sachs	165 998	836 514	836 514
CFD auf MSCI AC Pacific ex Japan Growth Index	Goldman Sachs	(43 001)	(407 649)	(407 649)
CFD auf MSCI EM Europe 10/40 Index	Goldman Sachs	(1 251)	98 566	98 566
CFD auf MSCI EM Latin America 10/40 Gross Total Return Index	Goldman Sachs	(11 682)	37 247	36 316
CFD auf JPHEUKT3 Index	J.P. Morgan	122 578	418 977	418 977
CFD auf MSCI PROV Saudi Arabia Gross Total Return Index	J.P. Morgan	(802)	(54 139)	(54 139)
			USD	14 795 075
				14 770 375
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *				
CFD auf britische Aktien	Bank of America	(6 802)	(1 819)	(1 819)
CFD auf britische Aktien	Morgan Stanley	492 745	159 054	165 670
CFD auf niederländische Aktien	Morgan Stanley	27 157	5 118	5 572
CFD auf irische Aktien	Morgan Stanley	(7 635)	(8 653)	(8 653)
CFD auf US-Aktien	Morgan Stanley	(29 467)	(56 033)	(56 033)
CFD auf FTSE UK Mid Cap Tradable Plus Index	Bank of America	(1 394)	(161 328)	(161 009)
CFD auf MSBEUK01 Index	Morgan Stanley	(18 670)	(54 330)	(65 438)
			GBP	(117 991)
				(121 710)

Credit Default Index Swap-Kontrakte

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

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Credit Default Index-Swapkontrakte (Forts.)

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-Swapkontrakte» aufgeführt.

Am 31. März 2023 waren die folgenden Teilfonds an Credit Default Indizes-Kontrakte auf Finanzindizes gebunden:

Schutzposition	Beschreibung	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Zinsen (bezahlt)/erhalten%	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 39 20/06/2028	J.P. Morgan	EUR	8 000 000	5,00	20. Jun. 2028	193 574
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 39 20/06/2028	J.P. Morgan	EUR	30 000 000	1,00	20. Jun. 2028	199 472
Verkauf	CDX North America High Yield Series 40 20/06/2028	J.P. Morgan	USD	5 000 000	5,00	20. Jun. 2028	68 832
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 40 20/06/2028	J.P. Morgan	USD	43 000 000	1,00	20. Jun. 2028	405 517
USD							867 395
Schroder GAIA Two Sigma Diversified							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 39 20/06/2028	Citi Bank	EUR	10 000 000	1,00	20. Jun. 2028	(184 644)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 39 20/06/2028	Citi Bank	EUR	16 000 000	1,00	20. Jun. 2028	192 882
Verkauf	CDX North America High Yield Series 40 20/06/2028	Citi Bank	USD	20 000 000	5,00	20. Jun. 2028	252 329
Verkauf	CDX North America Investment Grade Series 40 20/06/2028	Citi Bank	USD	20 000 000	1,00	20. Jun. 2028	(155 599)
USD							104 968
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	CDX iTraxx Europe Crossover Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	2 065 000	5,00	20. Dez. 2027	35 657
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	6 980 000	1,00	20. Dez. 2027	34 022
Verkauf	CDX iTraxx Europe Senior Financial Series 39 20/06/2028	Morgan Stanley	EUR	17 234 000	1,00	20. Jun. 2028	(123 981)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	24 000 000	1,00	20. Dez. 2027	(245 247)
Verkauf	CDX iTraxx Europe Series 39 20/06/2028	Morgan Stanley	EUR	155 000	1,00	20. Jun. 2028	689
Verkauf	CDX iTraxx Europe Subordinated Financial Series 38 20/12/2027	Morgan Stanley	EUR	3 970 000	1,00	20. Dez. 2027	(122 352)
Verkauf	CDX North America High Yield Series 40 20/06/2028	Morgan Stanley	USD	260 000	5,00	20. Jun. 2028	(3 644)
USD							(424 856)

Credit Default Swap-Kontrakte

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

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

Zum 31. März 2023 war der folgende Teilfonds an Credit Default Swap-Kontrakte gebunden:

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa							
Verkauf	Österreich	Telekommunikation	Morgan Stanley	EUR	6 720 000	20. Jun. 2028	(31 073)
Verkauf	Belgien	Chemie	Morgan Stanley	EUR	1 990 000	20. Jun. 2028	(3 384)
Verkauf	Kanada	Pipelines	Morgan Stanley	USD	795 000	20. Jun. 2028	(3 906)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Credit Default-Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Kauf	China	Banken	Goldman Sachs	USD	2 390 000	20. Jun. 2028	7 291
Verkauf	China	Banken	Morgan Stanley	USD	6 330 000	20. Jun. 2028	20 664
Verkauf	China	Öffentliche Hand	Morgan Stanley	USD	8 630 000	20. Jun. 2028	(7 339)
Verkauf	Finnland	Verpackung und Behälter	Morgan Stanley	EUR	5 190 000	20. Jun. 2028	(11 895)
Verkauf	Frankreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1 380 000	20. Jun. 2028	(154)
Verkauf	Frankreich	Baustoffe	Morgan Stanley	EUR	2 850 000	20. Jun. 2028	2 526
Verkauf	Frankreich	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	2 325 000	20. Jun. 2028	(33 294)
Verkauf	Frankreich	Vertrieb/Grosshandel	Morgan Stanley	EUR	2 140 000	20. Jun. 2028	(10 358)
Verkauf	Frankreich	Bau- und Ingenieurwesen	Morgan Stanley	EUR	3 970 000	20. Jun. 2028	(2 995)
Verkauf	Frankreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	8 440 000	20. Jun. 2028	(57 313)
Verkauf	Frankreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	4 060 000	20. Jun. 2028	2 957
Verkauf	Frankreich	REITS	Morgan Stanley	EUR	4 480 000	20. Jun. 2028	72 086
Verkauf	Deutschland	Fluggesellschaften	Morgan Stanley	EUR	2 150 000	20. Jun. 2028	(34 190)
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Barclays Bank	EUR	1 440 000	20. Jun. 2027	36 071
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1 440 000	20. Jun. 2027	(13 003)
Verkauf	Deutschland	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	7 550 000	20. Jun. 2028	(27 770)
Verkauf	Deutschland	Chemie	Morgan Stanley	EUR	2 290 000	20. Jun. 2028	7 698
Verkauf	Deutschland	Haushaltswaren/-produkte	Morgan Stanley	EUR	4 390 000	20. Jun. 2028	(4 011)
Kauf	Italien	Banken	BNP Paribas	EUR	1 530 000	20. Jun. 2028	5 608
Verkauf	Luxemburg	Eisen und Stahl	Morgan Stanley	EUR	3 610 000	20. Jun. 2028	(44 053)
Verkauf	Malaysia	Banken	Morgan Stanley	EUR	4 785 000	20. Jun. 2028	(126 454)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Werbung	Morgan Stanley	EUR	1 560 000	20. Jun. 2028	(2 059)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Luft- und Raumfahrt/Verteidigung	Morgan Stanley	EUR	2 000 000	20. Jun. 2028	(18 960)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	410 000	20. Dez. 2025	(4 021)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	805 000	20. Jun. 2027	(28 788)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	950 000	20. Dez. 2027	(21 730)
Kauf	Vereinigtes Königreich	Banken	Goldman Sachs	EUR	4 130 000	20. Jun. 2028	(45 409)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	2 950 000	20. Jun. 2028	(12 763)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Kosmetik und Körperpflege	Morgan Stanley	EUR	6 360 000	20. Jun. 2028	8 720
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Unterhaltung	Morgan Stanley	EUR	400 000	20. Jun. 2028	5 041
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Lebensmittel	Morgan Stanley	EUR	780 000	20. Dez. 2024	1 623
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Gastronomie	Morgan Stanley	EUR	2 170 000	20. Jun. 2028	(5 131)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Medien	Morgan Stanley	EUR	9 230 000	20. Jun. 2028	(32 650)
Verkauf	Vereinigtes Königreich	Einzelhandel	Morgan Stanley	EUR	3 730 000	20. Jun. 2028	(33 281)
Verkauf	USA	Automobilhersteller	Morgan Stanley	EUR	1 720 000	20. Jun. 2028	(13 248)
Verkauf	USA	Kraftfahrzeuge	Morgan Stanley	USD	1 590 000	20. Jun. 2028	(30 891)
Verkauf	USA	Banken	Goldman Sachs	USD	1 035 000	20. Jun. 2028	(292)
Verkauf	USA	Banken	J.P. Morgan	USD	1 035 000	20. Jun. 2028	8 218
Verkauf	USA	Banken	Morgan Stanley	USD	3 070 000	20. Jun. 2028	32 372
Verkauf	USA	Kabel-Satellit	Morgan Stanley	USD	1 885 000	20. Jun. 2028	2 286
Verkauf	USA	Chemie	Morgan Stanley	USD	795 000	20. Jun. 2028	(1 218)
Kauf	USA	Gewerbliche Dienstleistungen	Goldman Sachs	USD	500 000	20. Dez. 2024	26 339
Verkauf	USA	Gewerbliche Dienstleistungen	Morgan Stanley	EUR	2 950 000	20. Jun. 2028	(7 355)
Verkauf	USA	Elektronik	Morgan Stanley	USD	1 590 000	20. Jun. 2028	3 214
Kauf	USA	Lebensmittel	J.P. Morgan	USD	215 000	20. Jun. 2028	(2 144)
Verkauf	USA	Lebensmittel	Morgan Stanley	USD	910 000	20. Jun. 2025	(38 910)
Verkauf	USA	Gesundheitswesen – Dienstleistungen	Morgan Stanley	USD	1 885 000	20. Jun. 2028	2 682
Verkauf	USA	Medien	Morgan Stanley	USD	1 155 000	20. Dez. 2024	141 405

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Credit Default-Swapkontrakte (Forts.)

Schutzposition	Land des Risikos	Branche	Kontrahent	Währung	Nennbetrag	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)							
Verkauf	USA	Diverse Fertigungsbetriebe	Morgan Stanley	USD	795 000	20. Jun. 2028	(2 927)
Verkauf	USA	Pharmazeutika	Morgan Stanley	USD	795 000	20. Jun. 2028	3 140
Kauf	USA	Immobilien	J.P. Morgan	USD	705 000	20. Jun. 2024	(14 825)
Verkauf	USA	Immobilien	Morgan Stanley	USD	355 000	20. Jun. 2028	(12 741)
Verkauf	USA	REITS	Morgan Stanley	USD	795 000	20. Jun. 2028	(17 409)
Kauf	USA	Einzelhandel	Goldman Sachs	USD	630 000	20. Dez. 2027	(17 586)
Verkauf	USA	Einzelhandel	Morgan Stanley	USD	960 000	20. Dez. 2027	(26 797)
Verkauf	USA	Telekommunikation	Morgan Stanley	USD	2 680 000	20. Jun. 2028	(4 278)
USD							(416 664)

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 2023 war der folgende Teilfonds in Cross Currency Swap-Kontrakten engagiert:

Kontrahent	Zu zahlende Währung	Nennwert	Erhaltene Währung	Nennwert	Fälligkeit	Zu zahlender Satz	Erhaltener Satz	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa								
BNP Paribas	CNH	14 096 000	USD	2 060 638	20. Sep. 2025	2,92%	USD SOFR 1 Tag	(12 451)
Morgan Stanley	USD	25 589 564	AUD	35 059 000	20. Sep. 2028	USD SOFR 1 Tag	AUD BBR 3 Monate	(4 391)
Morgan Stanley	USD	23 695 077	CAD	32 249 000	20. Sep. 2028	USD SOFR 1 Tag	CAD BA 3 Monate	347 708
Morgan Stanley	USD	27 950 187	NOK	247 334 000	20. Sep. 2028	USD SOFR 1 Tag	NOK NIBOR 3 Monate	(6 052)
Morgan Stanley	USD	25 690 740	NZD	37 825 000	20. Sep. 2028	USD SOFR 1 Tag	NZD BBR 3 Monate	485
Morgan Stanley	USD	25 668 137	SEK	248 465 000	20. Sep. 2028	USD SOFR 1 Tag	SEK STIBOR 3 Monate	21 609
USD								346 908

Inflation Rate Swap-Kontrakte

Ein Inflation Rate Swap ermöglicht die Übertragung von Inflationsrisiken. Eine Vertragspartei versucht, ihr Risiko zu reduzieren (durch Absicherung), die andere Vertragspartei hingegen setzt sich einem höheren Risiko aus (durch Spekulation). Die Partei, die ihr Inflationsrisiko absichern möchte, zahlt die an einen Inflationsindex gebundene variable Prämie und erhält ihrerseits festgelegte Cashflows. Durch den Austausch von «variabel» gegen «fest» verringert sich für die absichernde Partei das Inflationsrisiko und erhöht sich die Sicherheit bezüglich zukünftiger Cashflows. Inflation-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 Inflation Rate Swap-Kontrakten» aufgeführt.

Zum 31. März 2023 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Inflationsraten engagiert:

Nennbetrag	Währung	Kontrahent	Wertpapierbeschreibung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
5 675 000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,43%, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	7 867
10 222 000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,45%, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	(9 990)
5 675 000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,46%, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	(9 635)
5 675 000	EUR	J.P. Morgan	Zahlt Festzinssatz 2,49%, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	(9 882)
10 222 000	EUR	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,48%, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	10 864
5 675 000	EUR	J.P. Morgan	Erhält Festzinssatz 2,53%, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	21 445
6 155 000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,32%, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	71 760
6 157 000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,35%, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	58 300
6 464 000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,38%, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	38 766

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Inflations-Swapkontrakte (Forts.)

Nennbetrag	Währung	Kontrahent	Wertpapierbeschreibung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
6 463 000	EUR	Morgan Stanley	Zahlt Festzinssatz 2,40%, erhält variablen Zinssatz auf HICPX, 10 Jahre	15. Feb. 2033	28 840
12 312 000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,31%, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	(94 489)
6 463 000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,40%, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	(18 386)
6 464 000	EUR	Morgan Stanley	Erhält Festzinssatz 2,41%, zahlt variablen Zinssatz auf HICPX, 5 Jahre	15. Feb. 2028	(17 717)
USD					77 743

Zinsswap-Kontrakte

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

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

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

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

Zum 31. März 2023 waren folgende Teilfonds in Swaps auf Zinssätze engagiert:

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend					
Zahlt Festzinssatz 3,68%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	8 475 467	USD	21. Jun. 2043	(711 662)
Erhält Festzinssatz 0,88%					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	339 794 661	JPY	21. Jun. 2043	(64 367)
Erhält Festzinssatz 2,91%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	6 475 467	USD	21. Jun. 2043	(186 777)
Zahlt Festzinssatz 3,46%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	8 169 036	USD	21. Jun. 2048	(629 681)
Erhält Festzinssatz 2,82%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	6 369 036	USD	21. Jun. 2048	(209 928)
Erhält Festzinssatz 3,42%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	23 148 633	USD	21. Jun. 2025	(189 535)
Zahlt Festzinssatz 4,59%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	31 148 633	USD	21. Jun. 2025	(440 124)
Zahlt Festzinssatz 2,16%					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	11 639 448	CHF	21. Jun. 2033	(261 686)
Zahlt Festzinssatz 3,84%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	16 375 118	USD	21. Jun. 2030	(676 387)
Zahlt Festzinssatz 2,05%					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	14 919 292	CHF	21. Jun. 2028	(111 070)
Erhält Festzinssatz 2,89%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	12 375 118	USD	21. Jun. 2030	(216 690)
Erhält Festzinssatz 1,37%					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	8 439 448	CHF	21. Jun. 2033	(490 530)
Erhält Festzinssatz 1,18%					
Zahlt variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	5 919 292	CHF	21. Jun. 2028	(228 865)
Zahlt Festzinssatz 4,19%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	19 882 593	USD	21. Jun. 2027	(606 677)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 2,86%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	J.P. Morgan	15 882 593	USD	21. Jun. 2027	(286 080)
Zahlt Festzinssatz 1,36%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	819 794 661	JPY	21. Jun. 2043	(399 821)
Erhält Festzinssatz 11,75%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	26 277 260	BRL	01. Feb. 2026	25 768
Zahlt Festzinssatz 13,60%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	117 690 479	BRL	02. Jan. 2025	(463 025)
Erhält Festzinssatz 11,42%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	27 690 479	BRL	02. Jan. 2025	16 223
Zahlt Festzinssatz 13,48%					
Erhält variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	66 277 260	BRL	01. Feb. 2026	(452 693)
Erhält Festzinssatz 11,06%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	90 000 000	BRL	02. Jan. 2025	3 740
Erhält Festzinssatz 2,25%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	4 828 387	SEK	21. Jun. 2033	(23 777)
Zahlt Festzinssatz 4,64%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	14 000 000	NZD	21. Jun. 2025	45 598
Erhält Festzinssatz 2,70%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	92 808 063	SEK	21. Jun. 2025	(127 349)
Zahlt Festzinssatz 3,98%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	264 808 063	SEK	21. Jun. 2025	(257 778)
Erhält Festzinssatz 7,28%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	316 445 744	ZAR	21. Jun. 2025	(183 372)
Zahlt Festzinssatz 8,27%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	316 445 744	ZAR	21. Jun. 2025	(132 488)
Zahlt Festzinssatz 4,69%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	6 000 000	NZD	21. Jun. 2028	(54 923)
Zahlt Festzinssatz 8,56%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	105 347 088	ZAR	21. Jun. 2028	(85 457)
Zahlt Festzinssatz 3,55%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	161 536 290	SEK	21. Jun. 2028	(395 066)
Erhält Festzinssatz 7,68%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	175 347 088	ZAR	21. Jun. 2028	(204 831)
Zahlt Festzinssatz 9,57%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	88 834 086	ZAR	21. Jun. 2033	(147 164)
Erhält Festzinssatz 8,67%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	J.P. Morgan	48 834 086	ZAR	21. Jun. 2033	(82 156)
Erhält Festzinssatz 2,40%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	89 536 290	SEK	21. Jun. 2028	(230 045)
Zahlt Festzinssatz 3,91%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	J.P. Morgan	64 828 387	SEK	21. Jun. 2033	(566 006)
Erhält Festzinssatz 3,99%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	161 569	NZD	21. Jun. 2033	(2 269)
Zahlt Festzinssatz 4,74%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	J.P. Morgan	3 161 569	NZD	21. Jun. 2033	(74 988)
Erhält Festzinssatz 3,98%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	1 618 940	EUR	21. Jun. 2025	19 717

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA BlueTrend (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 2,74%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	J.P. Morgan	9 618 940	EUR	21. Jun. 2025	128 699
Zahlt Festzinssatz 1,02%					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	J.P. Morgan	120 000 000	JPY	21. Jun. 2043	1 874
Zahlt Festzinssatz 9,14%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	114 374 536	MXN	14. Jun. 2028	(195 175)
Zahlt Festzinssatz 8,98%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	99 713 590	MXN	08. Jun. 2033	(258 418)
Zahlt Festzinssatz 8,88%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	435 992 481	MXN	18. Jun. 2025	296 415
Erhält Festzinssatz 8,28%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	49 713 590	MXN	08. Jun. 2033	187
Erhält Festzinssatz 10,02%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	265 992 481	MXN	18. Jun. 2025	116 191
Erhält Festzinssatz 7,73%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	J.P. Morgan	34 374 536	MXN	14. Jun. 2028	(47 501)
Zahlt Festzinssatz 1,97%					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	1 600 000	CHF	21. Jun. 2033	(6 152)
Zahlt Festzinssatz 1,96%					
Erhält variablen Zinssatz CHF SARON 1 Day	J.P. Morgan	3 000 000	CHF	21. Jun. 2028	(8 680)
				USD	(9 054 781)
Schroder GAIA Wellington Pagosa					
Zahlt Festzinssatz 1,63%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	160 000	USD	06. Feb. 2028	7 816
Erhält Festzinssatz 2,81%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4 421 000	USD	15. Dez. 2032	10 561
Erhält Festzinssatz 2,78%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	2 549 000	GBP	20. Dez. 2024	(27 131)
Zahlt Festzinssatz 0,63%					
Erhält variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	78 928 000	JPY	15. Dez. 2032	1 178
Zahlt Festzinssatz 5,78%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	50 952 000	PLN	20. Mrz. 2025	(18 448)
Zahlt Festzinssatz 3,16%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	5 173 000	USD	20. Mrz. 2025	12 439
Erhält Festzinssatz 3,22%					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	5 290 000	CAD	19. Mrz. 2028	87 309
Zahlt Festzinssatz 11,08%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	67 306 000	ZAR	15. Mrz. 2033	(55 153)
Zahlt Festzinssatz 11,14%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	40 091 000	ZAR	15. Mrz. 2033	(36 067)
Erhält Festzinssatz 2,74%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	23 599 000	CNY	19. Mrz. 2028	(30 415)
Erhält Festzinssatz 4,78%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	10 714 000	NZD	21. Dez. 2032	166 498
Zahlt Festzinssatz 4,67%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1 670 000	NZD	15. Mrz. 2033	(20 310)
Erhält Festzinssatz 8,87%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	32 474 000	MXN	09. Mrz. 2033	36 920

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 8,82%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	63 806 000	MXN	09. Mrz. 2033	67 790
Erhält Festzinssatz 8,83%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	63 235 000	MXN	09. Mrz. 2033	68 731
Erhält Festzinssatz 4,22%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	8 209 000	GBP	21. Jun. 2025	(20 412)
Erhält Festzinssatz 3,63%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	7 500 000	GBP	21. Jun. 2028	(1 624)
Erhält Festzinssatz 2,84%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	13 073 000	USD	18. Jun. 2028	(4 877)
Erhält Festzinssatz 2,87%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	5 337 000	SGD	20. Mrz. 2025	(2 006)
Erhält Festzinssatz 13,01%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	6 112 355	BRL	01. Apr. 2027	39 693
Erhält Festzinssatz 4,70%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 318 049 000	CLP	21. Jun. 2033	18 361
Erhält Festzinssatz 9,65%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	84 235 000	MXN	18. Dez. 2024	(50 905)
Erhält Festzinssatz 13,19%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Citi Bank	5 569 384	BRL	04. Jan. 2027	43 951
Erhält Festzinssatz 13,19%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	BNP Paribas	5 570 364	BRL	04. Jan. 2027	43 740
Zahlt Festzinssatz 10,45%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	12 555 000	ZAR	21. Jun. 2033	2 637
Erhält Festzinssatz 12,97%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	HSBC	7 203 973	BRL	04. Jan. 2027	44 170
Zahlt Festzinssatz 10,51%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	37 771 000	ZAR	21. Jun. 2033	4 878
Erhält Festzinssatz 12,71%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	5 075 163	BRL	04. Jan. 2027	21 087
Zahlt Festzinssatz 9,93%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	1 982 902 000	COP	21. Jun. 2028	(23 411)
Zahlt Festzinssatz 9,93%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2 799 941 000	COP	21. Jun. 2028	(33 086)
Erhält Festzinssatz 12,11%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	4 089 595	BRL	04. Jan. 2027	(1 789)
Erhält Festzinssatz 12,05%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	J.P. Morgan	3 351 325	BRL	04. Jan. 2027	(2 858)
Zahlt Festzinssatz 5,02%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	2 660 000	PLN	21. Jun. 2033	17 107
Zahlt Festzinssatz 9,38%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2 753 195 000	COP	21. Jun. 2033	(33 627)
Erhält Festzinssatz 11,98%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Barclays Bank	2 370 494	BRL	01. Apr. 2027	(4 326)
Erhält Festzinssatz 3,03%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	3 750 000	USD	21. Jun. 2033	13 143
Erhält Festzinssatz 8,26%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	20 091 000	MXN	25. Jan. 2033	(9 281)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 12,89%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Bank of America	2 331 023	BRL	04. Jan. 2027	13 005
Zahlt Festzinssatz 7,64%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	142 861 000	HUF	21. Jun. 2033	10 504
Zahlt Festzinssatz 3,74%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	772 288	ILS	21. Jun. 2033	(424)
Erhält Festzinssatz 3,07%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	770 000	SGD	21. Jun. 2033	11 793
Zahlt Festzinssatz 3,91%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	10 270 000	USD	21. Jun. 2028	(190 173)
Zahlt Festzinssatz 5,92%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 598 820 000	CLP	22. Jun. 2028	(95 030)
Erhält Festzinssatz 5,42%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4 950 625 000	CLP	22. Jun. 2033	221 101
Zahlt Festzinssatz 5,88%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	9 334 545 000	CLP	22. Jun. 2028	(323 983)
Erhält Festzinssatz 7,40%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	10 853 200 000	CLP	22. Jun. 2025	168 013
Zahlt Festzinssatz 9,50%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	18 246 985 000	COP	21. Jun. 2033	(253 633)
Erhält Festzinssatz 9,74%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	11 031 120 000	COP	21. Jun. 2028	112 392
Zahlt Festzinssatz 3,47%					
Erhält variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	5 705 000	SGD	20. Sep. 2028	(127 773)
Erhält Festzinssatz 3,22%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	8 342 000	SGD	17. Sep. 2028	83 712
Erhält Festzinssatz 3,76%					
Zahlt variablen Zinssatz SGD SORA 1 Day	Morgan Stanley	20 978 000	SGD	20. Sep. 2025	247 379
Zahlt Festzinssatz 3,00%					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	67 328 000	CNY	20. Sep. 2028	(30 541)
Zahlt Festzinssatz 5,19%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	4 108 350 000	CLP	20. Sep. 2033	(160 912)
Zahlt Festzinssatz 3,97%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	6 467 000	MYR	17. Sep. 2028	(6 674)
Zahlt Festzinssatz 3,53%					
Erhält variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	6 074 000	GBP	20. Sep. 2033	(154 078)
Erhält Festzinssatz 4,48%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	13 945 000	USD	21. Jun. 2025	194 274
Erhält Festzinssatz 4,50%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	13 950 000	USD	21. Jun. 2025	199 602
Erhält Festzinssatz 3,22%					
Zahlt variablen Zinssatz GBP SONIA 1 Day	Morgan Stanley	149 000	GBP	20. Sep. 2033	1 350
Zahlt Festzinssatz 3,50%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	16 446 000	USD	20. Sep. 2028	(55 281)
Erhält Festzinssatz 12,20%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	Morgan Stanley	29 269 294	BRL	02. Jan. 2025	16 509
Erhält Festzinssatz 4,50%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	7 551 000	USD	20. Sep. 2025	(16 935)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 3,62%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	6 725 000	USD	21. Jun. 2025	(20 568)
Erhält Festzinssatz 6,21%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	64 904 000	INR	21. Jun. 2028	(2 488)
Zahlt Festzinssatz 3,97%					
Erhält variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	5 176 000	USD	20. Sep. 2024	4 884
Erhält Festzinssatz 3,13%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	7 166 000	USD	20. Sep. 2033	50 723
Erhält Festzinssatz 0,66%					
Zahlt variablen Zinssatz JPY TONA 1 Day	Morgan Stanley	52 054 000	JPY	20. Sep. 2033	262
Erhält Festzinssatz 12,30%					
Zahlt variablen Zinssatz BRL CDI 1 Day	HSBC	10 584 726	BRL	02. Jan. 2025	9 546
Zahlt Festzinssatz 1,36%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Citi Bank	13 095 000	ILS	19. Jun. 2027	191 445
Erhält Festzinssatz 2,89%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	22 406 000	CZK	16. Jun. 2032	(41 776)
Erhält Festzinssatz 2,97%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1 311 000	NZD	16. Mrz. 2032	(39 523)
Zahlt Festzinssatz 4,16%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	5 720 000	PLN	18. Sep. 2027	24 581
Erhält Festzinssatz 2,16%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	9 385 000	ILS	15. Sep. 2032	(153 934)
Zahlt Festzinssatz 8,33%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	10 028 000	MXN	09. Jun. 2032	(5 511)
Zahlt Festzinssatz 8,32%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18 257 000	MXN	09. Jun. 2032	(9 637)
Zahlt Festzinssatz 8,33%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27 621 000	MXN	09. Jun. 2032	(15 269)
Zahlt Festzinssatz 8,32%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27 469 000	MXN	09. Jun. 2032	(14 665)
Zahlt Festzinssatz 8,32%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18 353 000	MXN	09. Jun. 2032	(9 741)
Zahlt Festzinssatz 8,28%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27 374 000	MXN	09. Jun. 2032	(12 988)
Zahlt Festzinssatz 8,23%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	36 569 000	MXN	09. Jun. 2032	(14 301)
Zahlt Festzinssatz 8,29%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27 417 000	MXN	09. Jun. 2032	(13 120)
Zahlt Festzinssatz 8,28%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18 270 000	MXN	09. Jun. 2032	(8 674)
Zahlt Festzinssatz 8,28%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27 475 000	MXN	09. Jun. 2032	(12 700)
Zahlt Festzinssatz 8,25%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18 286 000	MXN	09. Jun. 2032	(7 706)
Zahlt Festzinssatz 8,20%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	18 286 000	MXN	09. Jun. 2032	(6 119)
Zahlt Festzinssatz 8,32%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19 666 000	MXN	08. Sep. 2032	(8 859)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 8,32%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19 708 000	MXN	08. Sep. 2032	(8 878)
Zahlt Festzinssatz 8,45%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29 921 000	MXN	08. Sep. 2032	(19 561)
Zahlt Festzinssatz 8,47%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29 778 000	MXN	08. Sep. 2032	(20 564)
Zahlt Festzinssatz 8,11%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	60 639 000	MXN	08. Sep. 2032	(7 322)
Zahlt Festzinssatz 8,79%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	195 604 000	MXN	18. Sep. 2024	141 262
Zahlt Festzinssatz 9,61%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	3 555 000	ZAR	15. Sep. 2032	4 008
Erhält Festzinssatz 3,62%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	43 933 000	CZK	15. Sep. 2032	(24 138)
Zahlt Festzinssatz 9,76%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	8 530 000	ZAR	15. Sep. 2032	7 720
Zahlt Festzinssatz 8,65%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	62 816 000	MXN	09. Jun. 2032	(67 016)
Zahlt Festzinssatz 8,52%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	35 149 500	MXN	08. Sep. 2032	(27 165)
Zahlt Festzinssatz 8,52%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	46 924 500	MXN	08. Sep. 2032	(35 785)
Zahlt Festzinssatz 9,97%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	41 861 000	ZAR	15. Sep. 2032	24 410
Zahlt Festzinssatz 8,58%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	45 850 500	MXN	08. Sep. 2032	(39 406)
Zahlt Festzinssatz 8,82%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29 081 000	MXN	08. Sep. 2032	(36 528)
Erhält Festzinssatz 3,05%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	9 821 000	ILS	15. Sep. 2032	(68 568)
Erhält Festzinssatz 5,78%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 159 043 000	CLP	15. Dez. 2032	119 144
Erhält Festzinssatz 5,84%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 338 964 000	CLP	15. Dez. 2032	134 682
Erhält Festzinssatz 2,38%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4 117 000	EUR	15. Dez. 2032	(45 562)
Zahlt Festzinssatz 2,91%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	160 101 000	SEK	18. Dez. 2027	178 487
Zahlt Festzinssatz 3,22%					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	272 504 000	NOK	18. Dez. 2027	(315 540)
Erhält Festzinssatz 9,64%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	77 665 000	MXN	17. Sep. 2025	7 532
Zahlt Festzinssatz 10,27%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	42 554 000	ZAR	15. Sep. 2032	4 883
Erhält Festzinssatz 9,35%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	28 500 000	MXN	25. Jun. 2025	(13 659)
Erhält Festzinssatz 6,15%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12 423 000	PLN	15. Dez. 2032	75 789

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 8,76%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	155 183 000	MXN	08. Dez. 2032	(165 263)
Zahlt Festzinssatz 8,55%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	16 045 000	MXN	21. Jul. 2027	4 474
Zahlt Festzinssatz 8,16%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	59 280 000	MXN	06. Aug. 2027	61 418
Erhält Festzinssatz 8,53%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	16 125 000	MXN	08. Aug. 2025	(21 286)
Erhält Festzinssatz 8,48%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	103 955 000	MXN	08. Aug. 2025	(143 290)
Zahlt Festzinssatz 10,42%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	12 224 000	ZAR	15. Dez. 2032	372
Zahlt Festzinssatz 3,18%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	23 830 000	ILS	20. Dez. 2024	53 397
Zahlt Festzinssatz 3,18%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	22 315 000	ILS	20. Dez. 2024	50 003
Zahlt Festzinssatz 8,17%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	95 281 000	ZAR	20. Dez. 2024	(20 094)
Zahlt Festzinssatz 10,63%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	44 722 000	ZAR	15. Dez. 2032	(12 815)
Zahlt Festzinssatz 4,36%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	25 208 000	CZK	19. Mrz. 2028	(9 859)
Zahlt Festzinssatz 3,96%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Bank of America	6 565 000	MYR	19. Mrz. 2028	(8 819)
Erhält Festzinssatz 3,33%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	17 861 000	ILS	15. Mrz. 2033	(80 907)
Erhält Festzinssatz 3,41%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 141 138 000	KRW	19. Mrz. 2028	9 660
Zahlt Festzinssatz 3,26%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 489 107 000	KRW	15. Mrz. 2033	(9 519)
Erhält Festzinssatz 3,75%					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	6 804 000	CAD	20. Mrz. 2025	111 661
Erhält Festzinssatz 3,06%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7 926 000	NZD	20. Mrz. 2025	(29 341)
Zahlt Festzinssatz 4,16%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5 086 000	NZD	15. Mrz. 2033	(5 347)
Zahlt Festzinssatz 9,17%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	96 402 000	MXN	17. Sep. 2027	(102 283)
Zahlt Festzinssatz 3,64%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 004 580 000	KRW	15. Mrz. 2033	(18 023)
Erhält Festzinssatz 6,93%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	10 775 000	PLN	15. Mrz. 2033	125 536
Zahlt Festzinssatz 4,34%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4 640 000	NZD	15. Mrz. 2033	(29 862)
Zahlt Festzinssatz 10,93%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	50 672 000	ZAR	15. Mrz. 2033	(30 624)
Zahlt Festzinssatz 10,91%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	24 365 000	ZAR	15. Mrz. 2033	(13 748)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 3,69%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	631 437 000	KRW	15. Mrz. 2033	(12 249)
Erhält Festzinssatz 2,75%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	15 732 000	CNY	19. Mrz. 2028	(19 961)
Zahlt Festzinssatz 3,68%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3 465 000	ILS	19. Mrz. 2028	(9 834)
Zahlt Festzinssatz 3,92%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2 432 274 000	KRW	15. Mrz. 2033	(64 184)
Zahlt Festzinssatz 10,96%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	47 018 000	ZAR	15. Mrz. 2033	(30 096)
Zahlt Festzinssatz 10,94%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13 838 000	ZAR	15. Mrz. 2033	(8 595)
Zahlt Festzinssatz 11,09%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13 963 000	ZAR	15. Mrz. 2033	(11 645)
Erhält Festzinssatz 4,28%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	560 542 000	CLP	19. Mrz. 2028	2 842
Erhält Festzinssatz 4,43%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 163 627 000	CLP	19. Mrz. 2028	11 138
Erhält Festzinssatz 8,99%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	43 689 000	MXN	09. Mrz. 2033	58 189
Erhält Festzinssatz 8,86%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29 526 000	MXN	09. Mrz. 2033	33 119
Erhält Festzinssatz 8,88%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	14 673 000	MXN	09. Mrz. 2033	17 084
Erhält Festzinssatz 8,87%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29 400 000	MXN	09. Mrz. 2033	33 855
Erhält Festzinssatz 8,87%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	29 434 000	MXN	09. Mrz. 2033	33 464
Erhält Festzinssatz 6,28%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	14 044 000	PLN	15. Mrz. 2033	95 392
Erhält Festzinssatz 5,86%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 958 000	PLN	15. Mrz. 2033	10 863
Erhält Festzinssatz 4,53%					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	16 203 000	CAD	21. Jun. 2024	(16 242)
Zahlt Festzinssatz 3,94%					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	7 728 000	CAD	21. Jun. 2025	3 185
Zahlt Festzinssatz 3,34%					
Erhält variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	23 986 000	CAD	21. Jun. 2028	(77 730)
Erhält Festzinssatz 3,41%					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	6 769 000	CAD	21. Jun. 2033	55 262
Erhält Festzinssatz 3,38%					
Zahlt variablen Zinssatz CAD BA 3 Months	Morgan Stanley	12 431 000	CAD	21. Jun. 2033	20 953
Erhält Festzinssatz 4,93%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	13 801 000	CZK	21. Jun. 2025	(9 897)
Erhält Festzinssatz 3,15%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	37 329 000	ILS	21. Jun. 2028	(228 427)
Erhält Festzinssatz 8,64%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	611 701 000	MXN	18. Jun. 2025	(562 674)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 8,09%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	15 159 000	MXN	14. Jun. 2028	9 123
Zahlt Festzinssatz 5,57%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	49 004 000	PLN	21. Jun. 2033	(141 191)
Erhält Festzinssatz 6,69%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	59 023 000	PLN	21. Jun. 2024	825
Zahlt Festzinssatz 5,16%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 3 Months	Morgan Stanley	75 043 000	PLN	19. Jun. 2025	10 669
Erhält Festzinssatz 5,49%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	57 366 000	PLN	21. Jun. 2028	45 195
Erhält Festzinssatz 9,36%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	170 257 000	ZAR	21. Jun. 2033	147 300
Erhält Festzinssatz 9,38%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	114 432 000	ZAR	21. Jun. 2033	106 154
Zahlt Festzinssatz 7,95%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	101 449 000	ZAR	21. Jun. 2025	(9 622)
Zahlt Festzinssatz 8,56%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	90 475 000	ZAR	21. Jun. 2028	(73 801)
Zahlt Festzinssatz 8,56%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	186 206 000	ZAR	21. Jun. 2028	(151 049)
Erhält Festzinssatz 2,70%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	52 228 000	CNY	21. Jun. 2025	15 900
Zahlt Festzinssatz 10,13%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6 059 356 000	COP	21. Jun. 2025	(13 850)
Zahlt Festzinssatz 8,80%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3 305 356 000	COP	18. Jun. 2028	(16 702)
Erhält Festzinssatz 6,14%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	66 811 000	PLN	21. Jun. 2025	7 188
Zahlt Festzinssatz 7,94%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	163 036 000	MXN	19. Mrz. 2025	56 315
Zahlt Festzinssatz 7,86%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	84 467 000	MXN	19. Mrz. 2025	32 395
Zahlt Festzinssatz 7,83%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	88 913 000	MXN	19. Mrz. 2025	35 341
Zahlt Festzinssatz 8,39%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	46 958 000	MXN	09. Mrz. 2033	(18 863)
Zahlt Festzinssatz 8,50%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	162 505 000	MXN	30. Nov. 2027	38 487
Zahlt Festzinssatz 4,22%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4 997 432	NZD	21. Jun. 2028	21 102
Zahlt Festzinssatz 8,41%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	39 113 000	MXN	09. Mrz. 2033	(16 780)
Erhält Festzinssatz 4,67%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 322 717 000	CLP	21. Jun. 2033	6 872
Erhält Festzinssatz 4,67%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	376 657 000	CLP	21. Jun. 2033	1 034
Zahlt Festzinssatz 2,53%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 471 000	EUR	21. Jun. 2033	68 096

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 2,56%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7 170 000	EUR	21. Jun. 2028	(150 099)
Erhält Festzinssatz 6,31%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	394 768 000	INR	21. Jun. 2028	4 212
Erhält Festzinssatz 3,68%					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	13 799 000	MYR	21. Jun. 2028	(1 593)
Erhält Festzinssatz 2,66%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	245 239 000	SEK	21. Jun. 2028	(300 825)
Zahlt Festzinssatz 2,90%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	612 806 000	KRW	15. Mrz. 2033	2 824
Erhält Festzinssatz 3,00%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	17 563 000	CNY	18. Jun. 2028	(7 330)
Zahlt Festzinssatz 10,54%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	21 600 000	ZAR	21. Jun. 2033	1 869
Zahlt Festzinssatz 11,23%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	7 938 312 000	COP	21. Jun. 2025	(51 261)
Zahlt Festzinssatz 11,12%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	10 699 338 000	COP	21. Jun. 2025	(64 749)
Zahlt Festzinssatz 10,07%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	970 317 000	COP	21. Jun. 2033	(21 259)
Zahlt Festzinssatz 9,88%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	946 758 000	COP	21. Jun. 2033	(18 215)
Zahlt Festzinssatz 9,89%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	2 840 273 000	COP	21. Jun. 2033	(55 046)
Erhält Festzinssatz 7,39%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	73 869 000	ZAR	21. Jun. 2024	(26 135)
Erhält Festzinssatz 4,78%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	373 929 000	CLP	21. Jun. 2028	(9 044)
Erhält Festzinssatz 4,75%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 246 757 000	CLP	21. Jun. 2028	(31 810)
Erhält Festzinssatz 4,76%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	890 541 000	CLP	21. Jun. 2028	(22 343)
Erhält Festzinssatz 8,64%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	47 868 000	MXN	18. Jun. 2025	(44 031)
Erhält Festzinssatz 4,56%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	356 244 000	CLP	21. Jun. 2028	(12 722)
Zahlt Festzinssatz 10,16%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	3 005 662 000	COP	21. Jun. 2028	(41 369)
Erhält Festzinssatz 4,53%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	361 533 000	CLP	21. Jun. 2028	(13 544)
Erhält Festzinssatz 5,00%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	203 000	PLN	21. Jun. 2028	(796)
Zahlt Festzinssatz 3,89%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	12 094 000	CZK	21. Jun. 2033	21 746
Zahlt Festzinssatz 3,87%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6 050 000	CZK	21. Jun. 2033	11 451
Zahlt Festzinssatz 3,15%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1 594 000	ILS	21. Jun. 2033	20 138

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 9,24%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	992 668 000	COP	21. Jun. 2033	(10 171)
Zahlt Festzinssatz 4,96%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 998 000	PLN	21. Jun. 2033	15 048
Zahlt Festzinssatz 5,00%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 960 000	PLN	21. Jun. 2033	13 202
Erhält Festzinssatz 6,11%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	26 026 000	INR	21. Jun. 2028	(2 352)
Erhält Festzinssatz 6,11%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	33 125 000	INR	21. Jun. 2028	(2 993)
Zahlt Festzinssatz 3,07%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	4 390 000	ILS	21. Jun. 2033	63 388
Zahlt Festzinssatz 2,94%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	2 053 260 000	KRW	21. Jun. 2033	6 500
Erhält Festzinssatz 4,29%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2 245 000	NZD	15. Mrz. 2028	(7 803)
Erhält Festzinssatz 4,32%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2 245 000	NZD	15. Mrz. 2028	(6 103)
Zahlt Festzinssatz 5,28%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4 105 000	PLN	21. Jun. 2033	8 329
Zahlt Festzinssatz 5,30%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 170 000	PLN	21. Jun. 2033	3 668
Zahlt Festzinssatz 5,30%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 190 000	PLN	21. Jun. 2033	3 702
Zahlt Festzinssatz 10,39%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	184 897 000	MXN	19. Jun. 2024	53 025
Zahlt Festzinssatz 5,32%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 320 000	PLN	21. Jun. 2033	3 136
Erhält Festzinssatz 4,26%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2 350 000	NZD	15. Mrz. 2028	(10 206)
Erhält Festzinssatz 4,22%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2 245 000	NZD	15. Mrz. 2028	(12 594)
Erhält Festzinssatz 4,07%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2 245 000	NZD	15. Mrz. 2028	(21 866)
Erhält Festzinssatz 3,98%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	348 000	NZD	21. Jun. 2033	(5 027)
Erhält Festzinssatz 4,02%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	350 000	NZD	21. Jun. 2033	(4 397)
Erhält Festzinssatz 4,22%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2 245 000	NZD	15. Mrz. 2028	(12 594)
Zahlt Festzinssatz 7,99%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10 100 000	ZAR	21. Jun. 2028	4 682
Zahlt Festzinssatz 7,98%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	12 626 000	ZAR	21. Jun. 2028	6 138
Erhält Festzinssatz 4,25%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2 240 000	NZD	15. Mrz. 2028	(10 253)
Erhält Festzinssatz 4,25%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2 245 000	NZD	15. Mrz. 2028	(10 276)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 6,33%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	333 021 000	INR	21. Jun. 2025	(1 950)
Erhält Festzinssatz 4,52%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	1 150 000	NZD	15. Mrz. 2028	3 127
Zahlt Festzinssatz 6,74%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 314 453 000	CLP	21. Jun. 2025	(501)
Zahlt Festzinssatz 6,78%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 263 223 000	CLP	21. Jun. 2025	(1 630)
Zahlt Festzinssatz 7,67%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	146 284 000	HUF	21. Jun. 2033	10 078
Zahlt Festzinssatz 6,46%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	108 873 000	INR	21. Jun. 2025	(3 807)
Erhält Festzinssatz 9,18%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	4 969 000	ZAR	21. Jun. 2033	1 093
Erhält Festzinssatz 9,18%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	11 183 000	ZAR	21. Jun. 2033	2 317
Zahlt Festzinssatz 7,64%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	80 362 000	ZAR	21. Jun. 2025	17 832
Erhält Festzinssatz 9,16%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20 823 964	ZAR	21. Jun. 2033	2 859
Erhält Festzinssatz 9,27%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16 438 056	ZAR	21. Jun. 2033	8 904
Zahlt Festzinssatz 8,48%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16 368 031	ZAR	21. Jun. 2028	(10 545)
Zahlt Festzinssatz 8,18%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32 533 692	ZAR	21. Jun. 2028	1 428
Zahlt Festzinssatz 8,30%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	27 111 787	ZAR	21. Jun. 2028	(6 395)
Zahlt Festzinssatz 8,30%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	27 247 954	ZAR	21. Jun. 2028	(6 273)
Erhält Festzinssatz 9,25%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16 933 206	ZAR	21. Jun. 2033	7 927
Zahlt Festzinssatz 8,35%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32 909 840	ZAR	21. Jun. 2028	(11 104)
Erhält Festzinssatz 9,30%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	20 663 996	ZAR	21. Jun. 2033	13 092
Zahlt Festzinssatz 8,36%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	22 914 644	ZAR	21. Jun. 2028	(8 507)
Erhält Festzinssatz 9,31%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	15 196 204	ZAR	21. Jun. 2033	10 187
Zahlt Festzinssatz 6,49%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	216 346 000	INR	18. Jun. 2028	(7 038)
Zahlt Festzinssatz 4,08%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1 681 222	ILS	21. Jun. 2033	(13 939)
Zahlt Festzinssatz 3,71%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1 637 452	ILS	21. Jun. 2033	25
Zahlt Festzinssatz 3,66%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	849 038	ILS	21. Jun. 2033	971

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 9,10%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	1 682 023 000	HUF	20. Jun. 2025	(7 331)
Zahlt Festzinssatz 9,10%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 3 Months	Morgan Stanley	2 390 440 000	HUF	19. Jun. 2025	(9 932)
Zahlt Festzinssatz 11,85%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 579 575 000	HUF	21. Jun. 2025	(28 439)
Zahlt Festzinssatz 12,00%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 026 809 000	HUF	21. Jun. 2025	(36 946)
Zahlt Festzinssatz 3,89%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	1 125 000	ILS	21. Jun. 2033	(4 427)
Zahlt Festzinssatz 8,45%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	31 091 000	MXN	15. Jun. 2033	(13 175)
Zahlt Festzinssatz 8,47%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	24 215 000	MXN	15. Jun. 2033	(11 020)
Zahlt Festzinssatz 8,48%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	27 280 052	ZAR	21. Jun. 2028	(17 513)
Erhält Festzinssatz 9,42%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16 995 724	ZAR	21. Jun. 2033	18 765
Erhält Festzinssatz 9,42%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	10 030 000	ZAR	21. Jun. 2033	10 964
Zahlt Festzinssatz 4,79%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	3 644 000	NZD	21. Jun. 2028	(42 698)
Zahlt Festzinssatz 4,68%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	2 429 000	NZD	21. Jun. 2028	(20 945)
Zahlt Festzinssatz 3,26%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	442 479 000	KRW	21. Jun. 2033	(2 815)
Zahlt Festzinssatz 3,23%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	884 281 000	KRW	21. Jun. 2033	(4 825)
Zahlt Festzinssatz 9,08%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	52 035 000	MXN	18. Feb. 2030	(99 050)
Erhält Festzinssatz 10,79%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	153 145 000	MXN	24. Feb. 2025	98 245
Zahlt Festzinssatz 3,61%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	12 231 000	MYR	21. Jun. 2025	(1 335)
Erhält Festzinssatz 5,85%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	6 030 000	PLN	21. Jun. 2033	45 859
Zahlt Festzinssatz 7,72%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	139 176 000	HUF	21. Jun. 2033	8 169
Zahlt Festzinssatz 3,03%					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	41 160 000	CNY	21. Jun. 2028	(40 208)
Erhält Festzinssatz 9,57%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	29 081 325 000	COP	21. Jun. 2028	254 791
Erhält Festzinssatz 6,12%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	391 745 000	CZK	21. Jun. 2025	119 971
Zahlt Festzinssatz 5,22%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	338 340 000	CZK	21. Jun. 2028	(339 234)
Erhält Festzinssatz 5,00%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	52 870 000	CZK	21. Jun. 2030	72 289

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 4,85%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	96 920 000	CZK	21. Jun. 2033	177 614
Zahlt Festzinssatz 3,44%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9 470 000	EUR	21. Jun. 2028	(115 871)
Erhält Festzinssatz 10,88%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	6 871 445 000	HUF	21. Jun. 2025	(292 805)
Zahlt Festzinssatz 8,90%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	5 956 405 000	HUF	21. Jun. 2028	104 728
Erhält Festzinssatz 8,22%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 862 505 000	HUF	21. Jun. 2033	23 056
Zahlt Festzinssatz 4,23%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	10 925 000	ILS	21. Jun. 2033	(127 694)
Erhält Festzinssatz 6,49%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	109 955 000	PLN	21. Jun. 2025	171 713
Zahlt Festzinssatz 5,92%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	94 010 000	PLN	21. Jun. 2028	(464 528)
Erhält Festzinssatz 5,93%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	26 490 000	PLN	21. Jun. 2033	237 789
Erhält Festzinssatz 7,91%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	95 170 000	ZAR	21. Jun. 2025	5 650
Zahlt Festzinssatz 8,43%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	236 340 000	ZAR	21. Jun. 2028	(122 665)
Erhält Festzinssatz 9,36%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	138 965 000	ZAR	21. Jun. 2033	123 293
Erhält Festzinssatz 10,82%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	30 515 000	ZAR	21. Jun. 2033	9 608
Erhält Festzinssatz 4,72%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	14 780 000	USD	21. Jun. 2025	148 892
Erhält Festzinssatz 3,63%					
Zahlt variablen Zinssatz USD SOFR 1 Day	Morgan Stanley	4 450 000	USD	21. Jun. 2033	140 238
Erhält Festzinssatz 6,68%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	283 795 000	INR	21. Jun. 2028	56 179
Zahlt Festzinssatz 2,52%					
Erhält variablen Zinssatz THB THOR 1 Day	Morgan Stanley	108 405 000	THB	21. Jun. 2028	(41 711)
Zahlt Festzinssatz 9,33%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	65 960 000	MXN	24. Feb. 2028	(110 940)
Erhält Festzinssatz 10,84%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	74 575 000	MXN	27. Feb. 2025	52 061
Erhält Festzinssatz 9,01%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	19 725 000	MXN	17. Feb. 2033	46 458
Zahlt Festzinssatz 3,72%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Goldman Sachs	15 860 000	MYR	21. Jun. 2025	(9 510)
Zahlt Festzinssatz 8,59%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	21 490 000	ZAR	20. Sep. 2028	(15 622)
Erhält Festzinssatz 3,88%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	9 130 000	EUR	21. Jun. 2025	39 678
Erhält Festzinssatz 3,31%					
Zahlt variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 020 000	EUR	21. Jun. 2033	33 051

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 5,60%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	912 457 000	CLP	22. Jun. 2033	(56 462)
Zahlt Festzinssatz 7,83%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	84 094 000	ZAR	20. Jun. 2025	(8 076)
Zahlt Festzinssatz 3,23%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 288 644 000	KRW	21. Jun. 2033	(7 109)
Zahlt Festzinssatz 5,91%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	7 513 600 000	CLP	22. Jun. 2028	(270 956)
Erhält Festzinssatz 6,55%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	5 227 920 000	CLP	22. Jun. 2026	112 974
Erhält Festzinssatz 7,96%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	142 555 000	ZAR	21. Jun. 2025	15 327
Erhält Festzinssatz 9,43%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	176 377 000	ZAR	20. Sep. 2033	151 086
Erhält Festzinssatz 9,61%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	74 516 000	ZAR	20. Sep. 2033	113 666
Zahlt Festzinssatz 7,93%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	114 985 000	ZAR	20. Sep. 2025	(15 568)
Zahlt Festzinssatz 8,50%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	92 712 000	ZAR	20. Sep. 2028	(48 235)
Zahlt Festzinssatz 4,03%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	7 736 000	ILS	20. Sep. 2033	(60 441)
Zahlt Festzinssatz 4,88%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	49 196 000	ILS	20. Sep. 2024	(61 542)
Erhält Festzinssatz 4,03%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	3 133 000	ILS	20. Sep. 2028	17 514
Erhält Festzinssatz 3,41%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 017 673 000	KRW	20. Sep. 2033	22 595
Zahlt Festzinssatz 5,64%					
Erhält variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	2 377 000	PLN	20. Sep. 2033	(11 479)
Erhält Festzinssatz 5,99%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	99 871 000	PLN	20. Sep. 2025	70 116
Zahlt Festzinssatz 7,69%					
Erhält variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	794 604 000	HUF	20. Sep. 2033	5 445
Erhält Festzinssatz 8,14%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	749 207 000	HUF	20. Sep. 2028	(18 420)
Erhält Festzinssatz 4,88%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	38 842 000	CZK	20. Sep. 2028	26 060
Zahlt Festzinssatz 9,45%					
Erhält variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	4 288 795 000	COP	20. Sep. 2028	(41 564)
Erhält Festzinssatz 8,97%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	10 706 700 000	COP	20. Sep. 2033	26 621
Erhält Festzinssatz 9,99%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	127 571 000	MXN	17. Sep. 2025	114 445
Zahlt Festzinssatz 8,95%					
Erhält variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	684 213 000	MXN	13. Sep. 2028	(1 201 529)
Erhält Festzinssatz 8,81%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	316 555 000	MXN	07. Sep. 2033	748 634

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 3,89%					
Zahlt variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	Standard Chartered Bank	8 124 000	MYR	20. Sep. 2028	15 065
Zahlt Festzinssatz 6,35%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 498 386 000	CLP	20. Sep. 2025	(14 380)
Zahlt Festzinssatz 6,49%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	2 624 760 000	CLP	20. Sep. 2025	(33 124)
Zahlt Festzinssatz 6,54%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	6 674 904 000	CLP	20. Sep. 2025	(91 720)
Erhält Festzinssatz 4,68%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 495 436 000	CLP	20. Sep. 2033	2 971
Erhält Festzinssatz 12,25%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	20 269 742 000	COP	21. Jun. 2024	34 707
Erhält Festzinssatz 2,78%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	54 218 000	CNY	20. Sep. 2025	18 872
Erhält Festzinssatz 3,14%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	20 479 000	CNY	17. Sep. 2028	96
Erhält Festzinssatz 3,23%					
Zahlt variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	35 577 000	CNY	17. Sep. 2028	13 176
Zahlt Festzinssatz 3,03%					
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	19 988 000	CNY	20. Sep. 2028	(13 551)
Zahlt Festzinssatz 6,65%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	349 453 000	INR	20. Sep. 2025	(34 171)
Zahlt Festzinssatz 6,68%					
Erhält variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	766 308 000	INR	17. Sep. 2028	(73 002)
Erhält Festzinssatz 6,66%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	254 864 000	INR	20. Sep. 2028	48 091
Zahlt Festzinssatz 5,27%					
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	1 243 979 000	CLP	20. Jun. 2025	(5 243)
Erhält Festzinssatz 5,46%					
Zahlt variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	3 829 008 000	CLP	20. Sep. 2028	114 995
Zahlt Festzinssatz 3,16%					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	18 261 000	NOK	20. Sep. 2033	(15 923)
Erhält Festzinssatz 3,50%					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	321 765 000	NOK	20. Sep. 2028	435 232
Zahlt Festzinssatz 3,69%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7 993 000	AUD	18. Sep. 2025	(25 233)
Zahlt Festzinssatz 3,94%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	58 566 000	AUD	20. Sep. 2025	(381 704)
Zahlt Festzinssatz 3,88%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	16 675 000	AUD	17. Sep. 2028	(101 765)
Zahlt Festzinssatz 4,06%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	23 278 000	AUD	20. Sep. 2028	(331 221)
Zahlt Festzinssatz 4,59%					
Erhält variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	21 575 000	AUD	20. Sep. 2033	(121 230)
Zahlt Festzinssatz 4,41%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	4 402 000	EUR	20. Sep. 2024	(25 856)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 4,31%					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 6 Months	Morgan Stanley	36 572 000	AUD	20. Sep. 2033	657 553
Zahlt Festzinssatz 4,42%					
Erhält variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	38 433 000	ILS	20. Sep. 2025	(96 691)
Zahlt Festzinssatz 3,78%					
Erhält variablen Zinssatz EUR EURIBOR 6 Months	Morgan Stanley	13 923 000	EUR	20. Sep. 2025	(100 559)
Erhält Festzinssatz 5,59%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	456 346 000	CZK	20. Sep. 2025	88 760
Zahlt Festzinssatz 4,45%					
Erhält variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	83 965 000	CZK	20. Sep. 2033	(56 517)
Erhält Festzinssatz 8,30%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	25 169 000	MXN	15. Jun. 2033	4 694
Erhält Festzinssatz 8,29%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	33 866 000	MXN	15. Jun. 2033	5 918
Erhält Festzinssatz 8,29%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	34 268 000	MXN	15. Jun. 2033	5 875
Erhält Festzinssatz 8,33%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	41 378 000	MXN	15. Jun. 2033	9 724
Erhält Festzinssatz 8,50%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	11 511 000	MXN	08. Jun. 2033	9 334
Erhält Festzinssatz 8,36%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	14 364 000	MXN	08. Jun. 2033	4 196
Erhält Festzinssatz 8,38%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	14 220 000	MXN	08. Jun. 2033	5 207
Erhält Festzinssatz 8,33%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	24 950 000	MXN	15. Jun. 2033	5 781
Erhält Festzinssatz 5,44%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 664 000	PLN	21. Jun. 2028	527
Erhält Festzinssatz 5,44%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	1 669 000	PLN	21. Jun. 2028	529
Erhält Festzinssatz 5,44%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	835 000	PLN	21. Jun. 2028	264
Erhält Festzinssatz 9,23%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	16 700 000	ZAR	21. Jun. 2033	6 345
Erhält Festzinssatz 9,23%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	13 889 000	ZAR	21. Jun. 2033	5 609
Erhält Festzinssatz 9,23%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	14 281 000	ZAR	21. Jun. 2033	5 373
Zahlt Festzinssatz 3,03%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	906 764 000	KRW	21. Jun. 2033	520
Zahlt Festzinssatz 3,78%					
Erhält variablen Zinssatz MYR KLIBOR 3 Months	J.P. Morgan	6 325 000	MYR	18. Jun. 2028	(382)
Erhält Festzinssatz 3,34%					
Zahlt variablen Zinssatz AUD BBR 3 Months	Morgan Stanley	15 180 000	AUD	20. Sep. 2026	5 417
Erhält Festzinssatz 4,39%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	3 100 000	NZD	21. Jun. 2028	2 406
Zahlt Festzinssatz 3,13%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 919 879 000	KRW	21. Jun. 2033	(5 107)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Zahlt Festzinssatz 3,14%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 266 673 000	KRW	21. Jun. 2033	(3 782)
Erhält Festzinssatz 3,19%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 603 459 000	KRW	21. Jun. 2028	3 725
Erhält Festzinssatz 3,38%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	8 745 497 000	KRW	21. Jun. 2025	9 432
Zahlt Festzinssatz 3,03%					
Erhält variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	1 053 077 000	KRW	21. Jun. 2033	4 411
Erhält Festzinssatz 8,45%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	9 271 000	MXN	08. Jun. 2033	5 872
Erhält Festzinssatz 8,50%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	25 936 000	MXN	08. Jun. 2033	21 186
Erhält Festzinssatz 8,56%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	13 149 000	MXN	08. Jun. 2033	13 586
Erhält Festzinssatz 8,45%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	16 483 000	MXN	08. Jun. 2033	10 440
Erhält Festzinssatz 7,65%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	68 948 000	ZAR	21. Jun. 2024	(14 756)
Erhält Festzinssatz 9,16%					
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	62 486 000	ZAR	21. Jun. 2033	8 580
Erhält Festzinssatz 4,41%					
Zahlt variablen Zinssatz CZK PRIBOR 6 Months	Morgan Stanley	47 133 000	CZK	21. Jun. 2028	(30 654)
Erhält Festzinssatz 5,15%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	15 805 000	PLN	21. Jun. 2028	(39 973)
Zahlt Festzinssatz 4,07%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	415 000	NZD	21. Jun. 2033	816
Erhält Festzinssatz 6,27%					
Zahlt variablen Zinssatz INR MIBOR 1 Day	Morgan Stanley	139 198 000	INR	21. Jun. 2028	(1 273)
Zahlt Festzinssatz 4,06%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	410 000	NZD	21. Jun. 2033	867
Zahlt Festzinssatz 4,13%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	615 000	NZD	21. Jun. 2033	392
Erhält Festzinssatz 4,25%					
Zahlt variablen Zinssatz ILS TELBOR 3 Months	Morgan Stanley	37 970 000	ILS	21. Jun. 2025	23 797
Erhält Festzinssatz 6,97%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	336 754 000	HUF	21. Jun. 2033	3 691
Zahlt Festzinssatz 10,61%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	65 897 000	ZAR	21. Jun. 2033	(1 502)
Erhält Festzinssatz 8,37%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	16 464 000	MXN	08. Jun. 2033	5 565
Erhält Festzinssatz 8,51%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	14 635 000	MXN	08. Jun. 2033	12 345
Erhält Festzinssatz 8,40%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	27 440 000	MXN	08. Jun. 2033	11 574
Erhält Festzinssatz 6,72%					
Zahlt variablen Zinssatz HUF BUBOR 6 Months	Morgan Stanley	243 524 000	HUF	21. Jun. 2033	(2 038)
Erhält Festzinssatz 8,40%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	5 223 000	MXN	15. Jun. 2033	1 792

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)					
Erhält Festzinssatz 8,38%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	8 383 000	MXN	15. Jun. 2033	2 687
Erhält Festzinssatz 8,34%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	6 511 000	MXN	08. Jun. 2033	1 436
Erhält Festzinssatz 8,33%					
Zahlt variablen Zinssatz MXN TIIE 28 Days	Morgan Stanley	6 511 000	MXN	08. Jun. 2033	1 190
Erhält Festzinssatz 5,19%					
Zahlt variablen Zinssatz PLN WIBOR 6 Months	Morgan Stanley	8 095 000	PLN	21. Jun. 2033	(28 760)
Zahlt Festzinssatz 10,82%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	32 368 000	ZAR	21. Jun. 2033	(10 366)
Zahlt Festzinssatz 10,77%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	54 142 000	ZAR	21. Jun. 2033	(13 380)
Zahlt Festzinssatz 9,18%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	11 964 000	ZAR	21. Jun. 2033	(2 390)
Zahlt Festzinssatz 9,17%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	29 846 000	ZAR	21. Jun. 2033	(4 647)
Zahlt Festzinssatz 9,12%					
Erhält variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	15 519 000	ZAR	21. Jun. 2033	8
Erhält Festzinssatz 3,02%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	641 905 000	KRW	21. Jun. 2033	(3 066)
Erhält Festzinssatz 4,14%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	5 662 000	NZD	20. Sep. 2033	(25 621)
Erhält Festzinssatz 4,17%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	675 000	NZD	20. Sep. 2033	(2 075)
Zahlt Festzinssatz 4,97%					
Erhält variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	6 012 000	NZD	20. Sep. 2024	5 445
Erhält Festzinssatz 4,60%					
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	7 670 000	NZD	20. Sep. 2025	(13 613)
Zahlt Festzinssatz 2,78%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	85 086 000	SEK	20. Sep. 2033	(7 010)
Zahlt Festzinssatz 3,22%					
Erhält variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	114 378 000	SEK	20. Sep. 2025	4 809
Erhält Festzinssatz 3,06%					
Zahlt variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	7 012 000	NOK	20. Sep. 2033	3 725
Zahlt Festzinssatz 3,25%					
Erhält variablen Zinssatz NOK NIBOR 6 Months	Morgan Stanley	345 354 000	NOK	20. Sep. 2025	3 422
Erhält Festzinssatz 8,34%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	5 197 560 000	COP	20. Sep. 2028	2 693
Erhält Festzinssatz 8,34%					
Zahlt variablen Zinssatz COP IBR 1 Day	Morgan Stanley	6 367 246 000	COP	20. Sep. 2028	3 431
Erhält Festzinssatz 2,72%					
Zahlt variablen Zinssatz SEK STIBOR 3 Months	Morgan Stanley	22 941 000	SEK	20. Sep. 2033	1 998
Erhält Festzinssatz 3,01%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	994 271 000	KRW	20. Sep. 2033	(4 268)
Erhält Festzinssatz 3,00%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	849 179 000	KRW	20. Sep. 2033	(4 057)
Erhält Festzinssatz 3,01%					
Zahlt variablen Zinssatz KRW CD 3 Months	Morgan Stanley	853 594 000	KRW	20. Sep. 2033	(3 664)

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zins-Swapkontrakte (Forts.)

Beschreibung	Kontrahent	Nennwert	Währung	Fälligkeitsdatum	Nicht realisierter Wertzuwachs/ (Wertverlust)	
Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)						
Erhält Festzinssatz 3,82%						
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4 885 000	NZD	18. Jun. 2028	(10 127)	
Erhält Festzinssatz 3,81%						
Zahlt variablen Zinssatz NZD BBR 3 Months	Morgan Stanley	4 885 000	NZD	18. Jun. 2028	(11 096)	
Zahlt Festzinssatz 2,87%						
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	5 711 000	CNY	20. Sep. 2028	2 150	
Zahlt Festzinssatz 2,90%						
Erhält variablen Zinssatz CNY REPO RATE 7 Days	Morgan Stanley	7 420 000	CNY	20. Sep. 2028	1 617	
Zahlt Festzinssatz 4,82%						
Erhält variablen Zinssatz CLP ICP 1 Day	Morgan Stanley	261 118 000	CLP	20. Sep. 2033	(1 062)	
Erhält Festzinssatz 9,18%						
Zahlt variablen Zinssatz ZAR JIBAR 3 Months	Morgan Stanley	18 030 000	ZAR	21. Jun. 2033	3 470	
					USD	(1 931 885)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent

Zum 31. März 2023 gestaltete sich die Exponierung bei in Bezug auf Derivatkontrakte zu erhaltenden Sicherheiten je Kontrahent wie folgt:

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten	
Schroder GAIA BlueTrend					
	HSBC	Barmittel	USD	2 810 000	
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	1 394 973	
	J.P. Morgan	Barmittel	MXN	131 065	
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	20 869 049	
	Merrill Lynch	Barmittel	EUR	1 460	
				USD	25 200 754
Schroder GAIA Contour Tech Equity					
	HSBC	Barmittel	USD	550 000	
				USD	550 000
Schroder GAIA Egerton Equity					
	Morgan Stanley	Barmittel	CAD	3	
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	11	
	Morgan Stanley	Barmittel	JPY	18	
				EUR	15
Schroder GAIA Helix					
	Goldman Sachs	Barmittel	EUR	2 854 448	
	Goldman Sachs	Barmittel	GBP	4 810 245	
	Goldman Sachs	Barmittel	HKD	413 044	
	Goldman Sachs	Barmittel	USD	1 235 925	
	HSBC	Barmittel	USD	1 550 000	
	J.P. Morgan	Barmittel	AUD	564	
	J.P. Morgan	Barmittel	CAD	13 104	
	J.P. Morgan	Barmittel	EUR	7 093 991	
	J.P. Morgan	Barmittel	GBP	186 908	
	J.P. Morgan	Barmittel	HKD	2 627 129	
	J.P. Morgan	Barmittel	JPY	292 551 735	
	J.P. Morgan	Barmittel	USD	10 557 577	
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	360 000	
				USD	33 257 798

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Zu erhaltende Sicherheiten je Kontrahent (Forts.)

Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Währung	Summe erhaltene Sicherheiten
Schroder GAIA Oaktree Credit	HSBC	Barmittel	USD	110 000
	UBS	Barmittel	USD	10 552
			USD	120 552
Schroder GAIA Sirios US Equity	Goldman Sachs	Barmittel	USD	2 380 000
	HSBC	Barmittel	USD	320 000
	Merrill Lynch	Barmittel	USD	2 280 000
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	80 000
			USD	5 060 000
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	543 615
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	10
			GBP	543 623
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Citi Bank	Barmittel	EUR	2 696 935
	HSBC	Barmittel	USD	1 970 000
	Morgan Stanley	Barmittel	EUR	9 933 654
	Morgan Stanley	Barmittel	GBP	319 000
	Morgan Stanley	Barmittel	SGD	310 597
	Morgan Stanley	Barmittel	USD	202 483
	Societe Generale	Barmittel	AUD	443 200
	Societe Generale	Barmittel	CAD	53
	Societe Generale	Barmittel	CHF	15
	Societe Generale	Barmittel	CZK	2
	Societe Generale	Barmittel	EUR	46
	Societe Generale	Barmittel	GBP	741 103
	Societe Generale	Barmittel	JPY	351 874 345
	Societe Generale	Barmittel	MXN	1
	Societe Generale	Barmittel	SEK	378 302
	Societe Generale	Barmittel	USD	5 265 894
	Societe Generale	Barmittel	ZAR	1 623 818
			USD	25 751 551
	Schroder GAIA Wellington Pagosa	BNP Paribas	Barmittel	USD
Deutsche Bank		Barmittel	USD	60 000
Goldman Sachs		Barmittel	USD	814 484
HSBC		Barmittel	USD	3 050 000
J.P. Morgan		Barmittel	USD	2 585 000
Morgan Stanley		Barmittel	AUD	28 066
Morgan Stanley		Barmittel	CAD	15 463
Morgan Stanley		Barmittel	CZK	2 870
Morgan Stanley		Barmittel	EUR	238 290
Morgan Stanley		Barmittel	GBP	94 202
Morgan Stanley		Barmittel	HKD	433 326
Morgan Stanley		Barmittel	NOK	3 302 240
Morgan Stanley		Barmittel	NZD	307 546
Morgan Stanley		Barmittel	SEK	302 220
Morgan Stanley		Barmittel	THB	95 588
Morgan Stanley		Barmittel	USD	3 080 866
Morgan Stanley		Barmittel	ZAR	121
			USD	10 770 155

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Ausweis von Transaktionskosten

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

Die Transaktionskosten für den Berichtszeitraum fielen wie folgt aus:

Teilfonds	Währung	Provisionen
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *	USD	6 585
Schroder GAIA BlueTrend	USD	85 450
Schroder GAIA Cat Bond	USD	21 080
Schroder GAIA Contour Tech Equity	USD	342 385
Schroder GAIA Egerton Equity	EUR	181 492
Schroder GAIA Helix	USD	591 977
Schroder GAIA Oaktree Credit	USD	-
Schroder GAIA Sirios US Equity	USD	207 521
Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *	GBP	29 450
Schroder GAIA Two Sigma Diversified	USD	83 508
Schroder GAIA Wellington Pagosa	USD	770 478

Dividenden

Während des Berichtszeitraums haben die folgenden Teilfonds Dividendenausschüttungen vorgenommen:

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus-schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
14. Okt. 2022	21. Okt. 2022	28. Okt. 2022	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	474,49	USD	2,934929
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD-abgesichert	995,43	SGD	3,892037
11. Nov. 2022	18. Nov. 2022	25. Nov. 2022	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1 009,86	USD	6,246428
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD-abgesichert	2 069,24	SGD	8,089599
09. Dez. 2022	16. Dez. 2022	23. Dez. 2022	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	985,14	USD	6,093138
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD-abgesichert	2 056,68	SGD	8,038289
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF, Aussch.	206 175,84	USD	19,220378
29. Dez. 2022	30. Dez. 2022	09. Jan. 2023	Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch.	17,86	USD	1,172043
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in CHF-abgesichert	104,27	CHF	1,026639
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in EUR-abgesichert	109,72	EUR	1,087351
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in GBP-abgesichert	106,85	GBP	1,051469
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch.	19,71	USD	1,290452
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in CHF-abgesichert	115,77	CHF	1,137699
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in EUR-abgesichert	121,93	EUR	1,206733
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in GBP-abgesichert	118,69	GBP	1,165501
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch.	20,63	USD	1,348226
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in CHF-abgesichert	119,12	CHF	1,169785
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in EUR-abgesichert	125,45	EUR	1,241205
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in GBP-abgesichert	122,20	GBP	1,199191
			13. Jan. 2023	20. Jan. 2023	27. Jan. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.
Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD-abgesichert	2 711,64	SGD				10,595244
10. Feb. 2023	17. Feb. 2023	24. Feb. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1 211,32	USD	7,491177
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD-abgesichert	2 578,76	SGD	10,072484
10. Mrz. 2023	17. Mrz. 2023	24. Mrz. 2023	Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch.	1 145,61	USD	7,084338
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse F, Aussch., in SGD-abgesichert	2 436,26	SGD	9,512930
			Schroder GAIA Cat Bond, Klasse IF, Aussch.	344 750,77	USD	28,503106
30. Mrz. 2023	31. Mrz. 2023	11. Apr. 2023	Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch.	20,16	USD	1,307328
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in CHF-abgesichert	120,07	CHF	1,169563
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in EUR-abgesichert	126,00	EUR	1,235247
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse A2, Aussch., in GBP-abgesichert	121,03	GBP	1,178142
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch.	21,99	USD	1,421332
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in CHF-abgesichert	132,51	CHF	1,286792
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in EUR-abgesichert	139,16	EUR	1,360962

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Ausschüttungen (Forts.)

Stichtag	Ex-Dividende-Tag	Zahlungsdatum	Teilfonds	Bruttoaus-schüttung	Währung	Ausschüttung pro Anteil
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse C, Aussch., in GBP-abgesichert	133,68	GBP	1,296884
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch.	22,47	USD	1,448996
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in CHF-abgesichert	136,30	CHF	1,322120
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in EUR-abgesichert	143,13	EUR	1,399021
			Schroder GAIA Oaktree Credit, Klasse E, Aussch., in GBP-abgesichert	23 340,52	GBP	1,320451

Gegenseitige Investitionen der Teilfonds

Zum 31. März 2023 beliefen sich die gegenseitigen Investitionen der Teilfonds auf insgesamt 9 586 906 EUR, daher würde der kombinierte Gesamt-NIW am Ende des Berichtszeitraums ohne gegenseitige Investitionen 4 936 394 029 EUR betragen. Die Einzelheiten zu den gegenseitigen Investitionen der Teilfonds sind in der folgenden Tabelle angegeben:

Investition	Währung des Teilfonds	Marktwert	% Netto-vermögen
Schroder GAIA Helix			
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *		10 397 000	3,48
	USD	10 397 000	3,48

Wechselkurs

Der folgende Wechselkurs wurde für die Berechnung des im Finanzbericht zum 31. März 2023 in EUR ausgewiesenen Gesamtbetrags verwendet:

1 Euro = 0,92208 US-Dollar

1 Euro = 1,13748 Pfund Sterling

Ukraine/Russland-Sanktionen

Die Invasion der Ukraine durch Russland seit 24. Februar 2022 hat das Bewertungs-, Liquiditäts- und Marktrisiko für Wertpapiere erhöht, die von der Ukraine, Belarus und Russland sowie, in gewissem Umfang, von den meisten globalen Märkten ausgegeben wurden. Zum Zeitpunkt dieses Berichts sind die Lösung dieses Konflikts und die potenziellen Auswirkungen auf die Fonds weiterhin ungewiss. Das Board of Directors beobachtet die Situation in Bezug auf alle in unseren Fonds gehaltenen Wertpapiere sehr genau. Wertpapiere russischer Emittenten, die in unseren Fonds gehalten werden, werden weiterhin durch eine Reihe von Massnahmen von Regierungen, Börsen und Kontrahenten, einschliesslich Sanktionsmassnahmen, beeinträchtigt, was zu erheblichen Bewertungs- und Liquiditätsproblemen führt. Der Handel an den russischen Märkten wurde ausgesetzt, und die Fonds werden auf absehbare Zeit nicht in Aktien aus Russland oder Belarus investieren. Das Board of Directors wird weiterhin angemessene Bewertungsgrundsätze in Übereinstimmung mit unseren Preisbildungsprozessen anwenden. Aufgrund dieser Umstände und der Tatsache, dass wir nicht in der Lage sind, diese Vermögenswerte zu handeln oder zu übertragen, ist der Wert der russischen Wertpapiere in unseren Fonds auf ein Minimum gesunken, und dies wird sich voraussichtlich bis auf Weiteres im NIW der betreffenden Fonds widerspiegeln.

Der folgende Teilfonds ist in russischen und ukrainischen Wertpapieren engagiert:

Schroder GAIA Helix

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Performancegebühren pro Anteilsklasse

Teilfonds und Anteilsklassen	An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren pro Anteilsklasse in Währung des Fonds	Prozentsatz der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *		
Klasse A Thes.	10	0,63%
Klasse C Thes.	10	0,67%
Klasse I Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse IZ Thes.	10	0,69%

Schroder GAIA BlueTrend

Klasse A Thes.	20	0,00%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes.	99	0,00%
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	114	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	23	0,00%
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00%
Klasse E Thes.	0	0,00%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00%
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	209	0,00%

Schroder GAIA Cat Bond

Klasse A Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse C Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse F Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse F Aussch.	entfällt #	entfällt #
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse I Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse IF Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse IF Aussch.	entfällt #	entfällt #

Teilfonds und Anteilsklassen	An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren pro Anteilsklasse in Währung des Fonds	Prozentsatz der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)		
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	8 984	0,02%
Klasse PI Aussch.	100 254	0,19%
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	14 748	0,17%
Klasse Y Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse Y1 Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse Y2 Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	entfällt #	entfällt #
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	entfällt #	entfällt #

Schroder GAIA Contour Tech Equity

Klasse A Thes.	0	0,00%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	0	0,00%
Klasse A1 Thes.	0	0,00%
Klasse C Thes.	0	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	0	0,00%
Klasse E Thes.	0	0,00%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	0	0,00%

Schroder GAIA Egerton Equity

Klasse A Thes.	0	0,00%
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%
Klasse A Thes., in USD abgesichert	0	0,00%
Klasse A Aussch. GBP	0	0,00%
Klasse A1 Thes.	0	0,00%
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes.	0	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in USD abgesichert	0	0,00%
Klasse C Aussch.	0	0,00%
Klasse C Aussch. GBP	0	0,00%
Klasse E Thes.	0	0,00%
Klasse X Thes.	0	0,00%

Performancegebühr wird der Anteilsklasse nicht berechnet.

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Anmerkungen zum Finanzbericht zum 31. März 2023 (Forts.)

Performancegebühren pro Anteilklasse (Forts.)

Teilfonds und Anteilsklassen	An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren pro Anteilklasse in Währung des Fonds	Prozentsatz der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW	Teilfonds und Anteilsklassen	An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren pro Anteilklasse in Währung des Fonds	Prozentsatz der Performancegebühren auf Basis des durchschnittlichen NIW
Schroder GAIA Helix			Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *		
Klasse A Thes.	0	0,00%	Klasse C Thes.	0	0,00%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in USD abgesichert	0	0,00%
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	0	0,00%	Klasse I Thes.	entfällt #	entfällt #
Klasse C Thes.	0	0,00%	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse K Thes., in USD abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse R Thes.	0	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse R Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	0	0,00%	Klasse R Thes., in USD abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	0	0,00%			
Klasse C1 Thes.	0	0,00%	Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
Klasse E Thes.	0	0,00%	Klasse C Thes.	932 926	0,35%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	47	0,00%
Klasse I Thes.	entfällt #	entfällt #	Klasse K Thes.	11 783	0,02%
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	entfällt #	entfällt #	Klasse K Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse S Aussch.	0	0,00%	Schroder GAIA Wellington Pagosa		
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse A Thes.	0	0,00%
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	464	0,00%
			Klasse A Thes., in SGD abgesichert	22	0,00%
Schroder GAIA Sirius US Equity			Klasse C Thes.	14 550	0,00%
Klasse A Thes.	1 038	0,00%	Klasse C Thes., in BRL abgesichert	567	0,00%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	367	0,00%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	2 331	0,00%
Klasse C Thes.	42 406	0,09%	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	285	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%	Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	1	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	846	0,00%	Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1 090	0,02%	Klasse E Thes.	50	0,00%
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	0	0,00%	Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0	0,00%
Klasse E Thes.	40	0,14%	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	917	0,01%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%	Klasse E Thes., in GBP abgesichert	219	0,00%
Klasse X Thes.	2	0,15%			
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0	0,00%			

Für den Schroder GAIA Oaktree Credit wird keine Performancegebühr erhoben.

Performancegebühr wird der Anteilklasse nicht berechnet.

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen.

Gesamtkostenquote («TER», Total Expense Ratio) ^ für Berichtszeitraum zum 31. März 2023

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr
Schroder GAIA Asian Equity Long Short *		
Klasse A Thes.	2,83%	0,63%
Klasse C Thes.	2,15%	0,67%
Klasse I Thes.	0,15%	entfällt #
Klasse IZ Thes.	1,93%	0,69%

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr
Schroder GAIA BlueTrend		
Klasse A Thes.	3,06%	1,06%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,97%	0,94%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	3,21%	1,18%
Klasse C Thes.	2,99%	1,59%
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	3,09%	1,66%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	2,42%	0,99%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	2,74%	1,31%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	2,51%	1,08%
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,80%	0,37%
Klasse E Thes.	3,48%	2,08%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	3,05%	1,62%
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	3,05%	1,62%
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	2,01%	0,58%
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	2,14%	0,72%
Klasse N Thes., in SEK abgesichert	1,84%	0,37%

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr
Schroder GAIA Cat Bond		
Klasse A Thes.	1,78%	entfällt #
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	1,82%	entfällt #
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	1,82%	entfällt #
Klasse C Thes.	1,38%	entfällt #
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,41%	entfällt #
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,42%	entfällt #
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,43%	entfällt #
Klasse F Thes.	1,72%	entfällt #
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	1,73%	entfällt #
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	1,73%	entfällt #
Klasse F Aussch.	1,72%	entfällt #
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	1,74%	entfällt #
Klasse I Thes.	0,15%	entfällt #
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	0,15%	entfällt #
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	0,13%	entfällt #
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,11%	entfällt #
Klasse IF Thes.	1,32%	entfällt #
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	1,33%	entfällt #
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	1,33%	entfällt #
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	1,34%	entfällt #
Klasse IF Aussch.	1,33%	entfällt #
Klasse PI Thes., in CHF abgesichert	0,62%	0,00%
Klasse PI Thes., in EUR abgesichert	0,65%	0,03%
Klasse PI Aussch.	0,90%	0,29%
Klasse PI Aussch., in GBP abgesichert	0,87%	0,25%

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr
Schroder GAIA Cat Bond (Forts.)		
Klasse Y Thes.	1,10%	entfällt #
Klasse Y Thes., in CHF abgesichert	1,11%	entfällt #
Klasse Y Thes., in EUR abgesichert	1,13%	entfällt #
Klasse Y1 Thes.	1,51%	entfällt #
Klasse Y1 Thes., in CHF abgesichert	1,53%	entfällt #
Klasse Y1 Thes., in EUR abgesichert	1,53%	entfällt #
Klasse Y2 Thes.	0,01%	entfällt #
Klasse Y2 Thes., in CHF abgesichert	0,01%	entfällt #
Klasse Y2 Thes., in EUR abgesichert	0,01%	entfällt #
Klasse Y2 Thes., in GBP abgesichert	0,01%	entfällt #

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr
Schroder GAIA Contour Tech Equity		
Klasse A Thes.	2,42%	0,00%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,45%	0,00%
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse A1 Thes.	2,92%	0,00%
Klasse C Thes.	1,67%	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,70%	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,70%	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,70%	0,00%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	1,70%	0,00%
Klasse E Thes.	1,42%	0,00%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,46%	0,00%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,46%	0,00%
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	1,45%	0,00%

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr
Schroder GAIA Egerton Equity		
Klasse A Thes.	2,42%	0,00%
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse A Thes., in USD abgesichert	2,45%	0,00%
Klasse A Aussch. GBP	2,43%	0,00%
Klasse A1 Thes.	2,92%	0,00%
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	2,96%	0,00%
Klasse C Thes.	1,67%	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,70%	0,00%
Klasse C Thes., in USD abgesichert	1,70%	0,00%
Klasse C Aussch.	1,68%	0,00%
Klasse C Aussch. GBP	1,67%	0,00%
Klasse E Thes.	1,63%	0,00%
Klasse X Thes.	1,57%	0,00%

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr
Schroder GAIA Helix		
Klasse A Thes.	2,43%	0,00%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,47%	0,00%
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	2,45%	0,00%
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,45%	0,00%

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen. Beachten Sie bitte, dass die Transaktionskosten – wie in den Anmerkungen zum Finanzbericht angegeben – sowie Transaktionskosten in Verbindung mit dem zugrundeliegenden Portfolio strukturierter Produkte nicht in der oben aufgeführten TER berücksichtigt werden.

Legende:

#: Den Anteilklassen/Teilfonds wurde keine Performancegebühr berechnet.

^ Die Gesamtkostenquote (TER) wurde in Übereinstimmung mit den Grundsätzen berechnet, die in den Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der Gesamtkostenquote (TER) von Organismen für gemeinsame Anlagen der Asset Management Association Switzerland (AMAS) vom 16. Mai 2008 beschrieben sind. Transaktionskosten (falls vorhanden) sind im Kauf-/Verkaufspreis der Wertpapiere inbegriffen. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der TER nicht enthalten. Die TER wird für die letzten zwölf Monate berechnet. Bei Zeiträumen kürzer als ein Jahr wird die TER annualisiert.

Gesamtkostenquote («TER», Total Expense Ratio) ^ für Berichtszeitraum zum 31. März 2023 (Forts.)

Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr	Teilfonds und Anteilklassen	TER	Performancegebühr
Schroder GAIA Helix (Forts.)			Schroder GAIA Sirios US Equity (Forts.)		
Klasse C Thes.	1,35%	0,00%	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,41%	0,00%	Klasse C Thes.	1,68%	0,00%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,39%	0,00%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,38%	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	1,14%	0,00%	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,70%	0,00%
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	1,40%	0,00%	Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,66%	0,00%
Klasse C1 Thes.	1,27%	0,00%	Klasse E Thes.	1,39%	0,00%
Klasse E Thes.	1,00%	0,00%	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,40%	0,00%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,00%	0,00%	Klasse X Thes.	1,51%	0,00%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0,99%	0,00%	Klasse X Thes., in EUR abgesichert	1,61%	0,00%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0,98%	0,00%			
Klasse I Thes.	0,13%	entfällt #	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund *		
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	0,17%	entfällt #	Klasse C Thes.	1,13%	0,00%
Klasse IZ Thes., in GBP abgesichert	1,16%	0,00%	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,17%	0,00%
Klasse S Aussch.	0,59%	0,00%	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,15%	0,00%
Klasse S Aussch., in EUR abgesichert	0,62%	0,00%	Klasse C Thes., in USD abgesichert	1,15%	0,00%
Klasse S Aussch., in GBP abgesichert	0,63%	0,00%	Klasse I Thes.	0,08%	entfällt #
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	0,74%	0,00%	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	1,67%	0,00%
			Klasse K Thes., in USD abgesichert	1,62%	0,00%
			Klasse R Thes.	1,13%	0,00%
			Klasse R Thes., in EUR abgesichert	1,15%	0,00%
			Klasse R Thes., in USD abgesichert	1,15%	0,00%
Schroder GAIA Oaktree Credit			Schroder GAIA Two Sigma Diversified		
Klasse A2 Thes.	1,39%	entfällt #	Klasse C Thes.	2,17%	0,34%
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	1,57%	entfällt #	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,86%	0,00%
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	1,57%	entfällt #	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,86%	0,00%
Klasse A2 Aussch.	1,35%	entfällt #	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,85%	0,00%
Klasse A2 Aussch., in CHF abgesichert	1,58%	entfällt #	Klasse K Thes.	2,35%	0,02%
Klasse A2 Aussch., in EUR abgesichert	1,59%	entfällt #	Klasse K Thes., in CHF abgesichert	2,34%	0,00%
Klasse A2 Aussch., in GBP abgesichert	1,58%	entfällt #	Klasse K Thes., in EUR abgesichert	2,36%	0,00%
Klasse C Thes.	1,06%	entfällt #			
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,09%	entfällt #	Schroder GAIA Wellington Pagosa		
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,08%	entfällt #	Klasse A Thes.	2,43%	0,00%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,08%	entfällt #	Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse C Aussch.	0,86%	entfällt #	Klasse A Thes., in EUR abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse C Aussch., in CHF abgesichert	1,09%	entfällt #	Klasse A Thes., in SGD abgesichert	2,46%	0,00%
Klasse C Aussch., in EUR abgesichert	1,09%	entfällt #	Klasse C Thes.	1,75%	0,07%
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	1,08%	entfällt #	Klasse C Thes., in BRL abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse E Thes.	0,90%	entfällt #	Klasse C Thes., in CHF abgesichert	1,70%	0,00%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	0,89%	entfällt #	Klasse C Thes., in EUR abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	0,93%	entfällt #	Klasse C Thes., in GBP abgesichert	1,72%	0,00%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	0,93%	entfällt #	Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	1,78%	0,05%
Klasse E Aussch.	0,61%	entfällt #	Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	1,71%	0,00%
Klasse E Aussch., in CHF abgesichert	0,94%	entfällt #	Klasse E Thes.	1,18%	0,00%
Klasse E Aussch., in EUR abgesichert	0,94%	entfällt #	Klasse E Thes., in CHF abgesichert	1,20%	0,00%
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	1,01%	entfällt #	Klasse E Thes., in EUR abgesichert	1,21%	0,00%
Klasse I Thes.	0,14%	entfällt #	Klasse E Thes., in GBP abgesichert	1,21%	0,00%
Schroder GAIA Sirios US Equity					
Klasse A Thes.	2,42%	0,00%			
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	2,46%	0,00%			

* Für Einzelheiten zu den Kapitalmassnahmen, die während des Berichtszeitraums vorgenommen wurden, wird auf den Bericht des Board of Directors verwiesen. Beachten Sie bitte, dass die Transaktionskosten – wie in den Anmerkungen zum Finanzbericht angegeben – sowie Transaktionskosten in Verbindung mit dem zugrundeliegenden Portfolio strukturierter Produkte nicht in der oben aufgeführten TER berücksichtigt werden.

Legende:

#: Den Anteilklassen/Teilfonds wurde keine Performancegebühr berechnet.

^ Die Gesamtkostenquote (TER) wurde in Übereinstimmung mit den Grundsätzen berechnet, die in den Richtlinien zur Berechnung und Offenlegung der Gesamtkostenquote (TER) von Organismen für gemeinsame Anlagen der Asset Management Association Switzerland (AMAS) vom 16. Mai 2008 beschrieben sind. Transaktionskosten (falls vorhanden) sind im Kauf-/Verkaufspreis der Wertpapiere inbegriffen. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der TER nicht enthalten. Die TER wird für die letzten zwölf Monate berechnet. Bei Zeiträumen kürzer als ein Jahr wird die TER annualisiert.

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 2023 nachfolgend detailliert aufgeführt:

Schroder GAIA Egerton Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen EUR	% verwaltetes Vermögen
6 030 576	1,36%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen EUR	% verwaltetes Vermögen
6 701 613	1,50%
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt EUR	% verwaltetes Vermögen
12 732 189	2,86%

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn grössten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen EUR
Goldman Sachs	5 869 927
Morgan Stanley	3 908 579
J.P. Morgan	1 609 795
Merrill Lynch	1 343 888
	12 732 189

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil der Sicherheit

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Währung der Sicherheit

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil der Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen EUR	Short-Positionen EUR	Summe EUR
weniger als 1 Tag	–	–	–
1 bis 7 Tage	–	–	–
1 bis 4 Wochen	–	383 528	383 528
1 bis 3 Monate	–	357 499	357 499
3 bis 12 Monate	177 726	2 355 252	2 532 978
mehr als 1 Jahr	5 852 850	3 605 334	9 458 184
Unbegrenzte Laufzeit	–	–	–
	6 030 576	6 701 613	12 732 189

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Egerton Equity (Forts.)

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert EUR
Getrennt	20 618 397
Gepoolt	-
Sonstige	-
	20 618 397

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 2023 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite EUR *
Nettozinsen auf Swaps **	2,06%	1 053 543
Realisierter Nettogewinn	39,68%	20 267 606
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	58,26%	29 754 218
	100,00%	51 075 367

* Absolut ausgedrückt.

** Die vorstehenden Angaben zu den Zinsen auf Swaps beziehen sich auf alle Swap-Geschäfte und nicht nur auf Total Return Swaps.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in «Nettogewinne aus Swaps» und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in «Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps» sowie unter «Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps» enthalten.

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Helix

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
-	-
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
10 780 223	3,61%
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% verwaltetes Vermögen
10 780 223	3,61%

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn grössten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
J.P. Morgan	7 394 160
Barclays Bank	1 512 669
Goldman Sachs	1 192 366
Morgan Stanley	681 028
	10 780 223

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil der Sicherheit

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Währung der Sicherheit

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil der Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	-	10 780 223	10 780 223
mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	-	10 780 223	10 780 223

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Helix (Forts.)

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

Kontrahent	Land
J.P. Morgan	Vereinigtes Königreich
Barclays Bank	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

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	10 100 000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	10 100 000

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 2023 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite USD *
Nettozinsen auf Swaps **	0,52%	456 215
Realisierter Nettoverlust	47,62%	42 031 176
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	51,86%	45 768 004
	100,00%	88 255 395

* Absolut ausgedrückt.

** Die vorstehenden Angaben zu den Zinsen auf Swaps beziehen sich auf alle Swap-Geschäfte und nicht nur auf Total Return Swaps.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in «Nettogewinne aus Swaps» und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in «Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps» sowie unter «Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachses/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps» enthalten.

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Sirios US Equity

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
2 703 138	1,42%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
5 156 572	2,72%
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% verwaltetes Vermögen
7 859 710	4,14%

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn grössten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Merrill Lynch	4 310 720
Goldman Sachs	3 445 294
Morgan Stanley	81 112
Barclays Bank	22 584
	7 859 710

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	80 000
	80 000

Fälligkeitsprofil der Sicherheit

Fälligkeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	80 000
1 bis 7 Tage	–
1 bis 4 Wochen	–
1 bis 3 Monate	–
3 bis 12 Monate	–
mehr als 1 Jahr	–
Unbegrenzte Laufzeit	–
	80 000

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

Währung der Sicherheit

Währung	Marktwert USD
USD	80 000
	80 000

Fälligkeitsprofil der Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	26 260	817 121	843 381
3 bis 12 Monate	2 676 878	3 306 643	5 983 521
mehr als 1 Jahr	-	1 032 808	1 032 808
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	2 703 138	5 156 572	7 859 710

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
Morgan Stanley	80 000
	80 000

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	370 000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	370 000

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.

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Sirius US Equity (Forts.)

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamtrendite	Rendite USD *
Nettozinsen auf Swaps **	9,90%	507 028
Realisierter Nettogewinn	12,15%	621 675
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	77,95%	3 989 459
	100,00%	5 118 162

* Absolut ausgedrückt.

** Die vorstehenden Angaben zu den Zinsen auf Swaps beziehen sich auf alle Swap-Geschäfte und nicht nur auf Total Return Swaps.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in «Nettogewinne aus Swaps» und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in «Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps» sowie unter «Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps» enthalten.

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	% verwaltetes Vermögen
2 191 713	0,39%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
–	–
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% verwaltetes Vermögen
2 191 713	0,39%

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn grössten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	2 191 713
	2 191 713

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

Aggregierte Transaktionsdaten

Art und Qualität der Sicherheiten

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Fälligkeitsprofil der Sicherheit

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Währung der Sicherheit

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Two Sigma Diversified (Forts.)

Fälligkeitsprofil der Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	-	-	-
3 bis 12 Monate	2 191 713	-	2 191 713
mehr als 1 Jahr	-	-	-
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	2 191 713	-	2 191 713

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

Zum 31. März 2023 waren keine Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	1 600 000
Gepoolt	-
Sonstige	-
	1 600 000

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 2023 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite USD *
Nettozinsen auf Swaps	-	-
Realisierter Nettogewinn	74,58%	46 433 094
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	25,42%	15 826 084
	100,00%	62 259 178

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in «Nettogewinne aus Swaps» und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in «Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps» sowie unter «Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps» enthalten.

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa

Globale Daten

Höhe der an Total Return Swaps beteiligten Vermögenswerte

Höhe der Vermögenswerte – Long-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
5 922 963	0,88%
Höhe der Vermögenswerte – Short-Positionen USD	% verwaltetes Vermögen
12 883 384	1,92%
Höhe der Vermögenswerte – insgesamt USD	% verwaltetes Vermögen
18 806 347	2,80%

Konzentrationsdaten

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

Zum 31. März 2023 waren keine Wertpapiere oder Rohstoffe als Sicherheiten für Total Return Swaps erhalten worden.

Die zehn grössten Kontrahenten

Kontrahent	Bruttovolumen der offenen Transaktionen USD
Morgan Stanley	9 199 793
Goldman Sachs	4 836 989
J.P. Morgan	4 769 565
	18 806 347

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	2 304 484
	2 304 484

Fälligkeitsprofil der Sicherheit

Fälligkeit	Marktwert USD
weniger als 1 Tag	2 304 484
1 bis 7 Tage	–
1 bis 4 Wochen	–
1 bis 3 Monate	–
3 bis 12 Monate	–
mehr als 1 Jahr	–
Unbegrenzte Laufzeit	–
	2 304 484

Anhang I – Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Forts.)

Schroder GAIA Wellington Pagosa (Forts.)

Währung der Sicherheit

Währung	Marktwert USD
USD	2 304 484
	2 304 484

Fälligkeitsprofil der Total Return Swaps

Fälligkeit	Long-Positionen USD	Short-Positionen USD	Summe USD
weniger als 1 Tag	-	-	-
1 bis 7 Tage	-	-	-
1 bis 4 Wochen	-	-	-
1 bis 3 Monate	34 497	40 344	74 841
3 bis 12 Monate	-	3 612	3 612
mehr als 1 Jahr	5 888 466	12 839 428	18 727 894
Unbegrenzte Laufzeit	-	-	-
	5 922 963	12 883 384	18 806 347

Land, in dem Kontrahenten für Total Return Swaps ansässig sind

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

Abrechnung und Clearing

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

Wiederverwendung von Sicherheiten

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

Verwahrung von Sicherheiten

Erhaltene Sicherheiten

Auf Total Return Swaps erhaltene Sicherheiten werden wie folgt verwahrt:

Verwahrstelle	Marktwert USD
J.P. Morgan	2 150 000
Goldman Sachs	154 484
	2 304 484

Gestellte Sicherheiten

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

Kontoart	Marktwert USD
Getrennt	1 812 401
Gepoolt	-
Sonstige	-
	1 812 401

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 Wellington Pagosa (Forts.)

Rendite und Kosten

Für den Berichtszeitraum zum 31. März 2023 gestalten sich die Angaben zur Rendite und zu den Kosten von Total Return Swaps wie folgt:

	% der Gesamrendite	Rendite USD *
Nettozinsen auf Swaps	–	–
Realisierter Nettogewinn	36,14%	9 460 866
Nettoveränderung des nicht realisierten Wertverlusts	63,86%	16 718 880
	100,00%	26 179 746

* Absolut ausgedrückt.

Die vorstehend angegebene Rendite aus Total Return Swaps ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung in «Nettogewinne aus Swaps» und in der Aufstellung der Veränderungen des Nettovermögens in «Realisierter Nettogewinn/(Verlust) aus Total Return Swaps» sowie unter «Nettoveränderung des nicht realisierten Wertzuwachs/(Wertverlusts) aus Total Return Swaps» enthalten.

Kosten

Die Total Return Swaps zugeordneten Kosten sind im Spread enthalten.

Anhang II – Wertentwicklung der Fonds Für das Kalenderjahr 2022*

	Schroder GAIA BlueTrend	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Helix	Schroder GAIA Oaktree Credit	Schroder GAIA Sirios US Equity	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse A Thes.	29,32%	(3,32%)	(10,14%)	(13,86%)	(6,37%)	-	(3,16%)	-	-	3,72%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	28,73%	-	(12,55%)	-	(8,51%)	-	(6,22%)	-	-	1,35%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	28,47%	(5,20%)	(12,34%)	-	(8,29%)	-	(6,03%)	-	-	1,71%
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	(12,87%)	-	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SEK abgesichert	-	(4,46%)	-	-	(7,80%)	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	(10,58%)	-	(6,57%)	-	-	-	-	3,59%
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	(11,51%)	-	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	(9,32%)	-	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	(10,59%)	(14,31%)	-	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	(11,96%)	-	-	-	-	-	-
Klasse A2 Thes.	-	-	-	-	-	(8,30%)	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	(10,82%)	-	-	-	-
Klasse A2 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	(10,53%)	-	-	-	-
Klasse C Thes.	29,81%	(2,94%)	(9,47%)	(13,18%)	(5,37%)	(8,05%)	(2,41%)	2,37%	2,80%	4,24%
Klasse C Thes., in BRL abgesichert	48,84%	-	-	-	-	-	-	-	-	20,52%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	29,08%	(5,39%)	(11,91%)	-	(7,64%)	(10,41%)	(5,12%)	0,40%	0,43%	2,09%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	28,93%	(4,81%)	(11,68%)	-	(7,44%)	(10,09%)	(4,85%)	0,73%	0,90%	2,23%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	30,66%	(2,98%)	(10,45%)	(12,14%)	(5,99%)	(8,70%)	(3,49%)	-	2,35%	3,94%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	(11,37%)	-	(6,46%)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	(5,60%)	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	(10,83%)	-	-	-	2,91%	-	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	(13,42%)	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	(8,65%)	-	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	30,78%	-	-	-	-	-	(3,56%)	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	(5,32%)	-	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,92%
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,45%
Klasse E Thes.	29,46%	-	(9,24%)	(13,13%)	(5,03%)	(7,94%)	(2,35%)	-	-	5,01%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	(11,70%)	-	(7,20%)	(10,22%)	-	-	-	2,73%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	28,33%	-	(11,46%)	-	(6,93%)	(9,92%)	(4,78%)	-	-	2,97%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	(5,51%)	(8,56%)	-	-	-	4,60%
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	(11,16%)	-	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	30,38%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	(3,27%)	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	(5,69%)	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	(5,15%)	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	(3,26%)	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	(3,46%)	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	-	(1,73%)	-	-	(4,20%)	(7,25%)	-	3,46%	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	(4,19%)	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	(3,61%)	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in JPY abgesichert	-	(3,81%)	-	-	(6,17%)	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	(2,88%)	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	(5,32%)	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	(4,77%)	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in SEK abgesichert	-	(3,99%)	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Aussch.	-	(2,88%)	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-	-	-	2,29%	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	(0,06%)	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	0,19%	0,40%	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	2,35%	-	-
Klasse N Thes., in EUR abgesichert	29,22%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	30,27%	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-	-	2,38%	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	0,73%	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	2,85%	-	-
Klasse X Thes.	-	-	-	(13,09%)	-	-	(2,21%)	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	(6,71%)	-	(5,08%)	-	-	-

* Bitte beachten Sie, dass Schroder GAIA Asian Equity Long Short nicht in die obige Tabelle aufgenommen wurde, da zum 31. Dezember 2022 der Teilfonds in diesem Zeitraum nicht aktiv war.

Anhang II – Wertentwicklung der Fonds

Drei Kalenderjahre bis zum 31. Dezember 2022*

	Schroder GAIA BlueTrend	Schroder GAIA Cat Bond	Schroder GAIA Contour Tech Equity	Schroder GAIA Egerton Equity	Schroder GAIA Helix	Schroder GAIA Sirius US Equity	Schroder GAIA Tellworth UK Dynamic Absolute Return Fund	Schroder GAIA Two Sigma Diversified	Schroder GAIA Wellington Pagosa
Klasse A Thes.	50,30%	-	11,67%	(1,03%)	3,43%	4,47%	-	-	12,12%
Klasse A Thes., in CHF abgesichert	45,94%	-	5,78%	-	(1,26%)	(1,18%)	-	-	7,34%
Klasse A Thes., in EUR abgesichert	46,10%	-	7,98%	-	(0,69%)	(0,68%)	-	-	7,91%
Klasse A Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	0,69%	-	-	-	-	-
Klasse A Thes., in SGD abgesichert	-	-	9,22%	-	3,46%	-	-	-	11,57%
Klasse A Thes., in USD abgesichert	-	-	-	3,75%	-	-	-	-	-
Klasse A Aussch. GBP	-	-	-	3,37%	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes.	-	-	10,44%	(2,45%)	-	-	-	-	-
Klasse A1 Thes., in USD abgesichert	-	-	-	2,31%	-	-	-	-	-
Klasse C Thes.	52,47%	5,34%	14,02%	1,05%	7,04%	6,41%	8,30%	1,58%	13,80%
Klasse C Thes., in CHF abgesichert	47,87%	-	9,24%	-	2,03%	1,05%	4,83%	(3,65%)	9,22%
Klasse C Thes., in EUR abgesichert	48,47%	-	10,07%	-	2,32%	1,61%	5,46%	(2,66%)	9,50%
Klasse C Thes., in GBP abgesichert	52,28%	-	12,05%	2,99%	5,24%	3,80%	-	0,15%	12,33%
Klasse C Thes., in SEK abgesichert	-	-	11,71%	-	-	-	-	-	-
Klasse C Thes., in SGD abgesichert	-	-	-	-	6,36%	-	-	-	-
Klasse C Thes., in USD abgesichert	-	-	-	6,52%	-	-	10,04%	-	-
Klasse C Aussch.	-	-	-	0,62%	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch. GBP	-	-	-	5,51%	-	-	-	-	-
Klasse C Aussch., in GBP abgesichert	52,45%	-	-	-	-	3,70%	-	-	-
Klasse C1 Thes.	-	-	-	-	7,42%	-	-	-	-
Klasse C1 Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	8,91%
Klasse C1 Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	-	9,85%
Klasse E Thes.	51,77%	-	14,59%	0,90%	8,96%	7,39%	-	-	16,22%
Klasse E Thes., in CHF abgesichert	-	-	9,56%	-	3,57%	-	-	-	11,01%
Klasse E Thes., in EUR abgesichert	48,02%	-	10,44%	-	4,46%	2,41%	-	-	11,52%
Klasse E Thes., in GBP abgesichert	-	-	-	-	7,43%	-	-	-	14,51%
Klasse E Thes., in SEK abgesichert	-	-	11,67%	-	-	-	-	-	-
Klasse E Aussch., in GBP abgesichert	51,72%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes.	-	4,27%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in CHF abgesichert	-	(1,12%)	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Thes., in EUR abgesichert	-	(0,07%)	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch.	-	4,27%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse F Aussch., in SGD abgesichert	-	3,62%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes.	-	9,32%	-	-	15,08%	-	14,62%	-	-
Klasse I Thes., in CHF abgesichert	-	3,67%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse I Thes., in EUR abgesichert	-	4,85%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes.	-	5,53%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in CHF abgesichert	-	0,06%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse IF Thes., in EUR abgesichert	-	1,18%	-	-	-	-	-	-	-
Klasse K Thes.	-	-	-	-	-	-	-	0,07%	-
Klasse K Thes., in CHF abgesichert	-	-	-	-	-	-	-	(5,13%)	-
Klasse K Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	3,65%	(4,11%)	-
Klasse K Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-	8,52%	-	-
Klasse N Thes., in GBP abgesichert	51,63%	-	-	-	-	-	-	-	-
Klasse R Thes.	-	-	-	-	-	-	8,26%	-	-
Klasse R Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	-	-	5,50%	-	-
Klasse R Thes., in USD abgesichert	-	-	-	-	-	-	10,01%	-	-
Klasse X Thes.	-	-	-	0,53%	-	-	-	-	-
Klasse X Thes., in EUR abgesichert	-	-	-	-	4,58%	-	-	-	-

* Bitte beachten Sie, dass Schroder GAIA Asian Equity Long Short und Schroder GAIA Oaktree Credit nicht in die obige Tabelle aufgenommen wurden, da zum 31. Dezember 2022 die Teilfonds in diesem Zeitraum nicht aktiv waren.

Die vergangene Wertentwicklung ist kein Hinweis auf die gegenwärtige oder künftige Wertentwicklung. In diesen Performedaten wurden keine Provisionen und Kosten berücksichtigt, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen anfallen.



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 2023 CHDE